

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2021
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		0,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	0,00	0,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		112.549.106,76	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	112.549.106,76	112.549.106,76
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		82.757.138,20	Institute, Art. 119 CRR	20%	82.757.138,20	16.551.427,64
2. Termingeld 12 Monate		20.000.000,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	20.000.000,00	10.000.000,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		6.201.578,14	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	6.201.578,14	6.201.578,14
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		414.311,42	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	414.311,42	414.311,42
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
		0,00		50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Margin Account Devisentermingeschäfte Kontrahent KI		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		1.170.129,38	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.170.129,38	1.170.129,38
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		445.923,38	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	445.923,38	445.923,38
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		2.329.077,21	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.329.077,21	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		0,00	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	34.053,29	6.810,66
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00	0,00
Bruttofondsvermögen		225.867.264,49			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	147.339.287,38

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 65,23

Fremdwährungsanteil				Land			
Ungesicherter Fremdwährungsanteil				Bruttofondsvermögen			
Währung	EUR	%		Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %	
USD	4.484,80	0,0025	Niederlande NL	0,00	0,00	0,00	0,00
SEK	0,00	0,0000	Grossbritannien GB	0,00	0,00	0,00	0,00
CNY	0,00	0,0000	Belgien BE	0,00	0,00	0,00	0,00
JPY	0,00	0,0000	Luxemburg LU	0,00	0,00	0,00	0,00
SGD	0,00	0,0000	Österreich AT	475.798,84	0,21	475.798,84	0,21
PLN	540.980,51	0,3000	USA US	0,01	0,00	0,01	0,00
GBP	0,00	0,0000	Frankreich FR	110.156.578,42	48,77	110.156.578,42	48,77
HUF	0,00	0,0000	Italien IT	944.969,40	0,42	944.969,40	0,42
CZK	0,00	0,0000	Polen PL	152.628,08	0,07	152.628,08	0,07
Fremdwährungsanteil gesamt		0,3025	Japan JP	0,00	0,00	0,00	0,00
			Ungarn HU	0,00	0,00	0,00	0,00
			Singapur SG	0,00	0,00	0,00	0,00
			Finnland FI	0,00	0,00	0,00	0,00
			Deutschland DE	9.051.074,33	4,01	9.051.074,33	4,01
			Privilegierte Forderungskategorie (Institute, Zentralstaaten)	105.086.215,41	46,53	26.558.238,30	11,76