Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 30.11.2022
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**			**4.228.152,53**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%	4.228.152,53	4.228.152,53
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**130.160.871,07**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	130.160.871,07	26.032.174,21
2.	Termingeld	12 Monate		**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%	0,00	0,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**							
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**3.662.965,90**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	3.662.965,90	3.662.965,90
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften			**0,00**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	0,00	0,00
3.	Zinsansprüche							
	aus befristeten Bankguthaben			**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%	0,00	0,00
	aus Wertpapieren			**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		385.135,72		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	385.135,72	385.135,72
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		0,00		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	0,00	0,00
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		0,00	**385.135,72**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	0,00	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%	0,00	0,00
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00	0,00

Bruttofondsvermögen		**138.437.125,22**	**Summe risikogewichete SA-Positionswerte** **34.308.428,36**
Nettofondsvermögen	(Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.)	**106.694.934,74**	**durchschnittliche Risikogewichtszahl in %** **32,16**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	791.976,43	0,7423
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,04	0,0000
PLN	536.031,38	0,5024
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**1,2447**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	NL	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Grossbritanien	GB	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Belgien	BE	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Luxemburg	LU	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Österreich	AT	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
USA	US	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Frankreich	FR	2.127.428,89	**1,99**	2.127.428,89	**1,99**
Italien	IT	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Polen	PL	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
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	6.148.825,26	**5,76**	6.148.825,26	**5,76**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		130.160.871,07	**121,99**	26.032.174,21	**24,40**