Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.07.2019
Sondervermögen: SEB Global Property Fund

			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**			**5.936.904,86**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 (**	100%		5.936.904,86		5.936.904,86
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**11.779.711,68**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		11.779.711,68		2.355.942,34
2.	Termingeld	12 Monate		**3.000.000,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%		3.000.000,00		1.500.000,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**									
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**934.407,42**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		934.407,42		934.407,42
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
4.	Sonstige Forderungen	Debitorische Kreditoren								
a.)	Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer	0,00		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		0,00		0,00
		- auf Notaranderkonto	0,00		**Institute, Art. 120 CRR**	50%		0,00		0,00
b.)	sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten/Debitorische Kredi.		**241,61**		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		241,61		241,61
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		**0,00**		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		0,00		0,00
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb.		**187.928,87**	**188.170,48**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		187.928,87		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)	50%		0,00		0,00
Bruttofondsvermögen				**21.839.194,44**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**10.727.496,23**
						durchschnittliche Risikogewichtszahl in %				**49,12**

Fremdwährungsanteil

Ungesicherter Fremdwährungsanteil		
Währung	**EUR**	**%**
USD	169.092,83	0,9878
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	715.377,17	4,1789
HUF	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**5,1666**

Land		**Bruttofondsvermögen**	**Bemessungs-grundlage in %**	**Risikogewichteter SA-Positionswert**	**durchschnittliche Risikogewichtszahl in %**
Niederlande	NL	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Polen	PL	2.516.330,26	**11,52**	2.516.330,26	**11,52**
USA	US	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Deutschland	DE	4.355.223,63	**19,94**	4.355.223,63	**19,94**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		14.967.640,55	**68,54**	3.855.942,34	**17,66**