

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2019
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		5.920.353,27	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR	100%		5.920.353,27	5.920.353,27
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN							
1. Bankguthaben		11.721.835,88	Institute, Art. 119 CRR	20%		11.721.835,88	2.344.367,18
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		817.009,70	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		817.009,70	817.009,70
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 Debitoren							
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/Debitoren	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.	190.794,41	191.036,02	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		190.794,41	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		21.650.234,87				Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	10.581.971,76

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 48,88

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%	Land	Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
USD	172.797,41	1,0124	Niederlande NL	0,00	0,00	0,00	0,00
SEK	0,00	0,0000	Polen PL	2.518.179,28	11,63	2.518.179,28	11,63
CNY	0,00	0,0000	USA US	0,00	0,00	0,00	0,00
JPY	0,00	0,0000	Deutschland DE	4.219.425,30	19,49	4.219.425,30	19,49
SGD	0,00	0,0000	Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	14.912.630,29	68,88	3.844.367,18	17,76
PLN	700.974,31	4,1070					
HUF	0,00	0,0000					
Fremdwährungsanteil gesamt		5,1194					