

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2019
Sondervermögen: SEB ImmoInvest

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert =
I. IMMOBILIEN		75.560.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	75.560.000,00	75.560.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		226.245.253,95	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 CRR	100%	226.245.253,95	226.245.253,95
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		190.024.134,37	Institute, Art. 119 CRR	20%	190.024.134,37	38.004.826,87
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds Transparenter Fonds - SEB Immo Cash - SEB Total Return Quant Fund - SEB WP Direkt	0,00 0,00 0,00 0,00	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100%	0,00	0,00
		<u>0,00</u>		0%	0,00	0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		23.024.395,48	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	23.024.395,48	23.024.395,48
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		160.468.600,93	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	160.468.600,93	160.468.600,93
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben aus Wertpapieren		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
		<u>0,00</u>		50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI	42.302.614,05	Institute, Art. 120 CRR	50%	42.302.614,05	21.151.307,03
b.) Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		158.540.436,93	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	158.540.436,93	158.540.436,93
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		1.420.351,60	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.420.351,60	1.420.351,60
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		<u>1.900.934,05</u>	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	1.900.934,05	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%	509.050,01	101.810,00
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	1.938.884,93	969.442,47
Bruttovermögen		879.486.721,36			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	705.486.425,26

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % 80,22

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%	Land	Bruttovermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
USD	26.416,47	0,0034	Niederlande	977.150,48	0,11	977.150,48	0,11
SEK	0,00	0,0000	Grossbritannien	30.261,17	0,00	30.261,17	0,00
CNY	0,00	0,0000	Belgien	68.153,51	0,01	68.153,51	0,01
JPY	5.205,97	0,0007	Luxemburg	0,00	0,00	0,00	0,00
SGD	627,43	0,0001	Österreich	474.339,03	0,05	474.339,03	0,05
PLN	-7.604,11	0,0010	USA	258.275.820,47	29,37	258.275.820,47	29,37
GBP	-50.277,60	0,0064	Frankreich	111.644.708,80	12,69	111.644.708,80	12,69
HUF	0,00	0,0000	Italien	150.667.163,62	17,13	150.667.163,62	17,13
CZK	0,00	0,0000	Polen	26.796.718,05	3,05	26.796.718,05	3,05
Fremdwährungsanteil gesamt		0,0115	Japan	0,00	0,00	0,00	0,00
			Ungarn	1.920,00	0,00	1.920,00	0,00
			Singapur	0,00	0,00	0,00	0,00
			Finnland	0,00	0,00	0,00	0,00
			Deutschland	96.322.803,76	10,95	96.322.803,76	10,95
			Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)	234.227.682,47	26,63	60.227.386,37	6,85