Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 31.07.2021
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**				**112.376.870,00**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		112.376.870,00		112.376.870,00
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**										
1.	Bankguthaben				**64.383.235,63**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		64.383.235,63		12.876.647,13
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				**4.721.145,43**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		4.721.145,43		4.721.145,43
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften				**414.311,42**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		414.311,42		414.311,42
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			1.132.832,08		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.132.832,08		1.132.832,08
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			2.029.608,07	**3.608.363,53**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		2.029.608,07		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 **205.503.926,01**

Nettofondsvermögen (Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.) **166.262.325,90**

Summe risikogewichete SA-Positionswerte **141.967.729,44**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **85,39**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	31.709,10	0,0195
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	552.169,94	0,3401
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,3596**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage 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	434.790,33	**0,21**	434.790,33	**0,26**
USA	US	0,01	**0,00**	0,01	**0,00**
Frankreich	FR	109.899.005,29	**53,48**	109.899.005,29	**66,10**
Italien	IT	915.898,85	**0,45**	915.898,85	**0,55**
Polen	PL	147.110,38	**0,07**	147.110,38	**0,09**
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	7.694.277,45	**3,74**	7.694.277,45	**4,63**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		86.412.843,70	**42,05**	22.876.647,13	**13,76**
		205.503.926,01			
		0,00			