Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 31.08.2021
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**			**112.329.870,00**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%	112.329.870,00	112.329.870,00
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**64.170.643,92**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	64.170.643,92	12.834.128,78
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			**4.697.223,35**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	4.697.223,35	4.697.223,35
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		1.268.731,85		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	1.268.731,85	1.268.731,85
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		2.016.835,23	**3.731.490,46**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	2.016.835,23	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 **205.343.539,15**

Nettofondsvermögen (Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.) **166.079.436,97**

Summe risikogewichete SA-Positionswerte **141.990.188,78**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **85,50**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	31.500,24	0,0194
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	555.602,89	0,3426
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,3620**

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	434.790,33	**0,26**	434.790,33	**0,26**
USA	US	0,01	**0,00**	0,01	**0,00**
Frankreich	FR	109.849.005,29	**66,14**	109.849.005,29	**66,14**
Italien	IT	915.898,85	**0,55**	915.898,85	**0,55**
Polen	PL	148.024,97	**0,09**	148.024,97	**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	7.808.340,55	**4,70**	7.808.340,55	**4,70**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		86.187.479,15	**51,90**	22.834.128,78	**13,75**
		205.343.539,15			
		0,00			