Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 30.09.2021
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**			**112.279.147,62**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%	112.279.147,62	112.279.147,62
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**83.919.553,22**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	83.919.553,22	16.783.910,64
2.	Termingeld	12 Monate		**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%	0,00	0,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**							
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**4.693.002,03**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	4.693.002,03	4.693.002,03
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		1.377.148,57		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	1.377.148,57	1.377.148,57
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		2.016.096,49	**3.839.168,44**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	2.016.096,49	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 **205.145.182,73** — **Summe risikogewichete SA-Positionswerte** **135.993.443,66**

Nettofondsvermögen (Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.) **165.887.982,74** — **durchschnittliche Risikogewichtszahl in %** **81,98**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	31.871,52	0,0197
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	543.242,82	0,3354
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,3551**

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	109.799.485,91	**66,19**	109.799.485,91	**66,19**
Italien	IT	915.898,85	**0,55**	915.898,85	**0,55**
Polen	PL	144.732,04	**0,09**	144.732,04	**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	7.914.625,88	**4,77**	7.914.625,88	**4,77**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		85.935.649,71	**51,80**	16.783.910,64	**10,12**
		205.145.182,73			
		0,00			