Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 31.12.2021
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**			**111.367.376,41**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%	111.367.376,41	111.367.376,41
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**84.291.823,74**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	84.291.823,74	16.858.364,75
2.	Termingeld	12 Monate		**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%	0,00	0,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**							
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**4.033.125,11**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	4.033.125,11	4.033.125,11
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		800.177,12		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	800.177,12	800.177,12
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		447.159,78		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	447.159,78	447.159,78
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		2.021.831,14	**3.269.168,04**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	2.021.831,14	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 **203.375.804,72** — **Summe risikogewichete SA-Positionswerte** **133.920.514,59**

Nettofondsvermögen (Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.) **165.634.335,58** — **durchschnittliche Risikogewichtszahl in %** **80,85**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	31.488,34	0,0195
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	548.450,68	0,3398
GBP	0,00	0,0000
HUF	0,00	0,0000
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,3593**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungsgrundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert		durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Niederlande	NL	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Grossbritanien	GB	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Belgien	BE	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Luxemburg	LU	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Österreich	AT	434.790,33	**0,26**	434.790,33	0,26	**0,26**
USA	US	0,01	**0,00**	0,01	0,00	**0,00**
Frankreich	FR	109.649.500,71	**66,20**	109.649.500,71	66,20	**66,20**
Italien	IT	915.898,85	**0,55**	915.898,85	0,55	**0,55**
Polen	PL	146.119,51	**0,09**	146.119,51	0,09	**0,09**
Japan	JP	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Ungarn	HU	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Singapur	SG	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Finnland	FI	0,00	**0,00**	0,00	0,00	**0,00**
Deutschland	DE	5.915.840,43	**3,57**	5.915.840,43	3,57	**3,57**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		86.313.654,88	**52,11**	16.858.364,75		**10,18**
		203.375.804,72				
		0,00				