

KGAL immoSUBSTANZ

Anteilwertermittlung zum 30.11.2021

 Ansprechpartner: Martin Faubel
 Telefon: +49 40 377 077 204

Solvabilitätskennziffer und Anrechnungsbetrag nach den Regelungen der CRR II (Standardansatz)

Position	Forderungsklasse (Art. 112 CRR)	Rechts- grundlage CRR	Nettofonds- vermögen (in EUR)	Anteil am Fonds- vermögen (in %)	Risikopositions- wert (EaD in EUR)	Risiko- gewicht (in %)	Risikogewichteter Positionswert (RWA in EUR)	Risikogewichteter Positionswert in % vom NFV
I Immobilien	Sonstige Posten	Art. 134 (1)	14.710.000,00	26,19	14.710.000,00	100,00	14.710.000,00	26,19
II Beteiligungen an Immobiliengesellschaften								
1. Mehrheitsbeteiligungen	Beteiligungspositionen	Art. 133	30.625.749,73	54,53	30.625.749,73	100,00	30.625.749,73	54,53
2. Minderheitsbeteiligungen	Beteiligungspositionen	Art. 133	0,00	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00
III Liquiditätsanlagen								
1. Bankguthaben (detaillierte Aufstellung in Anlage 1)	Institute	Art. 119-121	13.577.550,68	24,17	13.577.550,68	20,00	2.715.510,14	4,83
2. Geldmarktpapiere			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
3. Investmentanteile (detaillierte Aufstellung in Anlage 2)	OGA	Art. 132	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
4. Wertpapiere			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IV Sonstige Vermögensgegenstände								
1. Forderungen aus der Grundstücksbewirtschaftung	Sonstige Posten	Art. 134 (1)	17.739,61	0,03	17.739,61	100,00	17.739,61	0,03
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften	Sonstige Posten	Art. 134 (1)	0,00	0,00	0,00	100,00	0,00	0,00
3. Zinsansprüche	Sonstige Posten	Art. 134 (3)	0,00	0,00	0,00	20,00	0,00	0,00
4. Anschaffungsnebenkosten für Immobilien	Sonstige Posten	Art. 134 (1)	1.225.798,66	2,18	1.225.798,66	100,00	1.225.798,66	2,18
5. Andere (ohne Derivate)	Sonstige Posten	Art. 134 (1)	822.143,80	1,46	822.143,80	100,00	822.143,80	1,46
informativ: Forderungen aus Derivaten			0,00					
6. Ansprüche aus Derivatgeschäften (detaillierte Aufstellung in Anlage 3)	Institute	Art. 119-121			0,00	0,00	0,00	0,00
V Verbindlichkeiten und Rückstellungen			-4.812.277,76	-8,57	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe			56.166.704,72	100,00	60.978.982,48		50.116.941,94	89,23

Durchschauansatz (LTA)	EUR	in %
Summe der risikogewichteten Positionswerte in EUR	50.116.941,94	
Summe Nettofondsvermögen in EUR	56.166.704,72	
Risikogewicht (nach CRR II)		89,23

Fremdwährungsanteil am Fondsvermögen (nach Sicherung)	0,0000
---	--------

CVA Risiko (Credit Value Adjustments gem. Art. 381 ff. CRR) in EUR	0,00
CVA Risiko (Credit Value Adjustments gem. Art. 381 ff. CRR) in % vom NFV	0,0000

Kein Risiko aus der Struktur des Geschäfts gemäß Artikel 7(1) der EU-Verordnung 1187/2014

Für die Frage nach dem zusätzlichen Risiko im Sinne des Artikel 7(1) der EU-Verordnung 1187/2014 gilt, dass nach Einschätzung des BVI bei OGAWs und offenen inländischen Publikums-AIF sowie bei offenen inländischen Spezialfonds mit festen Anlagebedingungen kein zusätzliches Risiko vorliegt. Da es sich bei dem vorliegenden Fonds um einen offenen inländischen Publikumsfonds mit festen Anlagebedingungen handelt, wird dieser von der vorstehenden Einschätzung erfasst.

KSA Risikogewichte nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers nach 10d KWG n.F.

				keine länderbezogenen Angaben bekannt																			länderbezogene Angaben bekannt (Länderkürzel gemäß Tabelle ISO 3166)																					
				Nicht benötigte Länderkürzel bleiben unbelegt, Nullwerte werden nicht berücksichtigt																																								
maximal 60 belegte Positionen -->				1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22																			
Datum	WKN	ISIN	Bemessungsgrundlage (7)/ Ermittlungsansatz (2 = KSA)	das der Risikoposition zugrundeliegende Schuldnerland kann nicht oder nur mit unverhältnismäßigem Aufwand ermittelt werden (Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1157/2014)	Risikogewicht resultiert aus den Risikopositionen bestimmter privilegierter Forderungsklassen (wie z.B. Zentralregierungen gem. Artikel 140 (4) CRD IV befreit)	AT	DE																																					
30.11.2021	A2H9BS	DE000A2H9BS6	2	0,0000	4,8347	55,02450	29,36970																																					
30.11.2021	A2H9BS	DE000A2H9BS6	7	0,0000	24,1737	55,02450	29,36970																																					

