

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.05.2016
Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		332.300.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	332.300.000,00	332.300.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		98.063.461,96	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	98.063.461,96	98.063.461,96
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		13.139.341,38	Institute, Art. 119 CRR	20%	13.139.341,38	2.627.868,28
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds 0,00 Transparenter Fonds 0,00	0,00	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100% 0%	0,00 0,00	0,00 0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		3.039.966,23	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.039.966,23	3.039.966,23
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		37.861.718,62	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	37.861.718,62	37.861.718,62
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer 0,00 - auf Notaranderkonto 0,00		Unternehmen, Art. 122 CRR Institute, Art. 120 CRR	100% 50%	0,00 0,00	0,00 0,00
b.) Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.	2.464.644,21		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.464.644,21	2.464.644,21
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	12.240.602,33		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	12.240.602,33	12.240.602,33
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus	4.706.924,05	19.412.170,59	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	4.706.924,05	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		807.897,39	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 20%	786.946,16 968.950,67	157.389,23 193.790,13
Bruttofondsvermögen		504.624.556,17			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	488.949.440,99

durchschnittliche Risikogewichtszahl 96,89%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	15.919,73	0,0042%
NOK	91.901,94	0,0241%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-46.195,94	0,0121%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	-2.389,99	0,0006%
PLN	256.893,76	0,0674%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		0,1085%