

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2016
 Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		333.700.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	333.700.000,00	333.700.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		99.994.797,55	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	99.994.797,55	99.994.797,55
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		13.682.547,67	Institute, Art. 119 CRR	20%	13.682.547,67	2.736.509,53
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		5.448.034,26	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	5.448.034,26	5.448.034,26
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		37.786.715,40	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	37.786.715,40	37.786.715,40
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.	3.347.279,67		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.347.279,67	3.347.279,67
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	12.000.305,07		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	12.000.305,07	12.000.305,07
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	<u>1.836.449,39</u>	17.184.034,13	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	1.836.449,39	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		1.758.304,64	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 20%	785.108,39 1.889.778,82	157.021,68 377.955,76
Bruttofondsvermögen		<u>509.554.433,65</u>			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	<u>495.548.618,93</u>

durchschnittliche Risikogewichtszahl 97,25%

Fremdwährungsanteil

	Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
		EUR	%
	USD	22.617,27	0,0059%
	NOK	90.924,99	0,0237%
	MYR	0,00	0,0000%
	GBP	-34.806,34	0,0091%
	CNY	0,00	0,0000%
	JPY	0,00	0,0000%
	SGD	56.091,96	0,0146%
	PLN	140.357,04	0,0367%
	CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt			<u>0,0900%</u>