

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2016
 Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	=	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		330.500.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		330.500.000,00		330.500.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		76.238.085,96	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%		76.238.085,96		76.238.085,96
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN								
1. Bankguthaben		23.020.440,18	Institute, Art. 119 CRR	20%		23.020.440,18		4.604.088,04
2. Investmentanteile			OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100%		0,00		0,00
Intransparenter Fonds	0,00			0%		0,00		0,00
Transparenter Fonds	0,00	0,00						
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE								
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		3.356.428,33	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		3.356.428,33		3.356.428,33
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		14.485.767,41	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		14.485.767,41		14.485.767,41
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			Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		0,00		0,00
- an Verkäufer	0,00		Institute, Art. 120 CRR	50%		0,00		0,00
- auf Notaranderkonto	0,00							
b.) Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.	9.559.738,57		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		9.559.738,57		9.559.738,57
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	13.282.422,75		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		13.282.422,75		13.282.422,75
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	5.006.760,06	27.848.921,38	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		5.006.760,06		0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		338.095,85	Institute, Art. 119, 120 CRR					
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		995.663,87		199.132,77
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		158.952,24		79.476,12
Bruttofondsvermögen		475.787.739,11				Summe risikogewichtete SA-Positionswerte		452.305.139,95
						durchschnittliche Risikogewichtszahl		95,06%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	15.424,02	0,0049%
NOK	0,00	0,0000%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-4.548,35	0,0014%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	52.520,09	0,0167%
PLN	133.345,53	0,0423%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>0,0653%</u>

Land	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR 45.546.045,97	9,57%
Polen	PL 156.837.870,63	32,96%
Finnland	FI 19.389.031,96	4,08%
Singapur	SG 29.484.296,94	6,20%
USA	US 51.263.650,23	10,77%
Deutschland	DE 149.784.244,22	31,48%