

## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.12.2016  
 Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert =
<b>I. IMMOBILIEN</b>		<b>187.400.000,00</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	100%		187.400.000,00	187.400.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		<b>49.034.393,24</b>	<b>Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR</b>	100%		49.034.393,24	49.034.393,24
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>							
1. Bankguthaben		104.831.623,29	Institute, Art. 119 CRR	20%		104.831.623,29	20.966.324,66
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					
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>							
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		5.708.608,47	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		5.708.608,47	5.708.608,47
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		14.269.163,92	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		14.269.163,92	14.269.163,92
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.	10.126.311,34		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		10.126.311,34	10.126.311,34
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	12.106.057,51		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		12.106.057,51	12.106.057,51
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	4.561.387,37	26.793.756,22	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		4.561.387,37	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		82.740,60	Institute, Art. 119, 120 CRR				
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		140.261,44	28.052,29
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		484.476,66	242.238,33
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>388.120.285,74</b>				<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>299.881.149,75</b>

**durchschnittliche Risikogewichtszahl 77,27%**

### Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-25.643,31	0,0077%
NOK	94.351,53	0,0284%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-336.477,80	0,1012%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	-1.825,68	0,0005%
PLN	75.661,40	0,0228%
CZK	0,00	0,0000%
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b><u>0,1606%</u></b>

Land	Bruttofonds- vermögen	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR 50.326.115,13	46.045.635,93	11,86%
Polen	PL 156.054.384,46	155.470.351,72	40,06%
Finnland	FI 19.860.323,17	19.506.708,70	5,03%
Singapur	SG 289,29	0,00	0,00%
USA	US 54.273.096,02	53.522.326,43	13,79%
Deutschland	DE 107.606.077,67	25.336.126,97	6,53%