

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.12.2016
Sondervermögen: SEB Global Property Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		0,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		0,00	0,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		67.193.803,24	Beteiligungsriskopositionen Art. 133 CI	100%		67.193.803,24	67.193.803,24
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN							
1. Bankguthaben		47.676.873,98	Institute, Art. 119 CRR	20%		47.676.873,98	9.535.374,80
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds Transparenter Fonds	0,00 <u>0,00</u>	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100% 0%		0,00 0,00	0,00 0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE							
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		1.384.515,55	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		1.384.515,55	1.384.515,55
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		28.205.292,30	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		28.205.292,30	28.205.292,30
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%		0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen	Debitorische Kreditoren						
a.) Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer - auf Notaranderkonto	0,00 0,00	Unternehmen, Art. 122 CRR Institute, Art. 120 CRR	100% 50%		0,00 0,00	0,00 0,00
b.) sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten/Debitorische Kredi.		410.382,46	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		410.382,46	410.382,46
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		133.073,85	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		133.073,85	133.073,85
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		<u>214.435,43</u>	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		214.435,43	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		0,00	Institute, Art. 119, 120 CRR				
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		0,00	0,00
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		0,00	0,00

Bruttofondsvermögen

145.218.376,81

Summe risikogewichtete SA-Positionswerte

106.862.442,20

durchschnittliche Risikogewichtszahl

73,59%

Fremdwährungsanteil

Währung	EUR	%
USD	141.586,99	0,1053%
SEK	0,00	0,0000%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	0,00	0,0000%
PLN	-4.180.652,86	4,6437%
HUF	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>4,7491%</u>

Land	Bruttofondsvermögen	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Niederlande	NL 37.296.922,78	37.294.595,54	25,68%
Polen	PL 59.267.735,07	58.792.613,85	40,49%
USA	US 0,00	0,00	0,00%
Deutschland	DE 48.653.718,96	10.775.232,80	7,42%