

## 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
<b>I. IMMOBILIEN</b>		<b>332.300.000,00</b>	<b>Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR</b>	100%	332.300.000,00	332.300.000,00
<b>II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN</b>		<b>98.063.461,96</b>	<b>Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C</b>	100%	98.063.461,96	98.063.461,96
<b>III. LIQUIDITÄTSANLAGEN</b>						
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
<b>IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE</b>						
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)	20%	786.946,16	157.389,23
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	968.950,67	193.790,13
<b>Bruttofondsvermögen</b>		<b>504.624.556,17</b>			<b>Summe risikogewichtete SA-Positionswerte</b>	<b>488.949.440,99</b>

**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%
<b>Fremdwährungsanteil gesamt</b>		<b>0,1085%</b>