## Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

**Datum:** 31.03.2018
**Sondervermögen:** SEB ImmoPortfolio Target Return 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** | | | **85.559.311,48** | **Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C** | 100% | | 85.559.311,48 | | 85.559.311,48 |
| **III.** | **LIQUIDITÄTSANLAGEN** | | | | | | | | | |
| 1. | Bankguthaben | | | **84.634.242,25** | **Institute, Art. 119 CRR** | 20% | | 84.634.242,25 | | 16.926.848,45 |
| 2. | Investmentanteile | Intransparenter Fonds | 0,00 | | **OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR** | 100% | | 0,00 | | 0,00 |
| | | Transparenter Fonds | 0,00 | **0,00** | | 0% | | 0,00 | | 0,00 |
| **IV.** | **SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE** | | | | | | | | | |
| 1. | Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung | | | **3.232.140,12** | **Unternehmen, Art. 122 CRR** | 100% | | 3.232.140,12 | | 3.232.140,12 |
| 2. | Forderungen an Immobilien-Gesellschaften | | | **209.254,79** | **Unternehmen, Art. 122 CRR** | 100% | | 209.254,79 | | 209.254,79 |
| 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 | | **Unternehmen, Art. 122 CRR** | 100% | | 0,00 | | 0,00 |
| | | - auf Notaranderkonto | 0,00 | | **Institute, Art. 120 CRR** | 50% | | 0,00 | | 0,00 |
| b.) | Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk. | | 1.991.654,86 | | **Unternehmen, Art. 122 CRR** | 100% | | 1.991.654,86 | | 1.991.654,86 |
| c.) | Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter | | 4.345.242,48 | | **Unternehmen, Art. 122 CRR** | 100% | | 4.345.242,48 | | 4.345.242,48 |
| d.) | Vorsteuer und Fdg./Verb. aus | | 2.309.637,70 | **8.646.535,04** | **Zentralstaaten, Art. 114 CRR** | 0% | | 2.309.637,70 | | 0,00 |
| 5. | Ansprüche aus Derivatgeschäften | | | **632.819,84** | **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% | | 438.763,07 | | 219.381,53 |
| **Bruttofondsvermögen** | | | | **182.914.303,52** | | **Summe risikogewichete SA-Positionswerte** | | | | **112.483.833,71** |
| | | | | | **durchschnittliche Risikogewichtszahl** | | | | | **61,50%** |

### Fremdwährungsanteil

| Währung | Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR | % |
|---|---|---|
| USD | 2.587.994,93 | 2,5923% |
| NOK | 0,00 | 0,0000% |
| MYR | 0,00 | 0,0000% |
| GBP | 2.758,82 | 0,0028% |
| CNY | 0,00 | 0,0000% |
| JPY | 0,00 | 0,0000% |
| SGD | 41,03 | 0,0000% |
| PLN | -10.796,32 | 0,0108% |
| CZK | 0,00 | 0,0000% |
| **Fremdwährungsanteil gesamt** | | **2,6059%** |

| Land | | Bruttofondsvermögen | Bemessungs-grundlage | Risikogewichteter SA-Positionswert | durchschnittliche Risikogewichtszahl |
|---|---|---|---|---|---|
| **Frankreich** | FR | 551.888,70 | **0,30%** | 414.306,29 | **0,23%** |
| **Polen** | PL | 87.577.556,22 | **47,88%** | 87.161.318,97 | **47,65%** |
| **Finnland** | FI | 1.969.971,08 | **1,08%** | 1.969.971,08 | **1,08%** |
| **Singapur** | SG | 272,73 | **0,00%** | 0,00 | **0,00%** |
| **USA** | US | 1.322.921,35 | **0,72%** | 680.370,23 | **0,37%** |
| **Deutschland** | DE | 6.857.451,19 | **3,75%** | 5.331.018,69 | **2,91%** |
| **Privilegierte Forderungsklasse** (Bankguthaben) | | 84.634.242,25 | **46,27%** | 16.926.848,45 | **9,25%** |