Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.05.2018
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**			**85.469.985,79**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		85.469.985,79		85.469.985,79
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**20.429.863,02**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		20.429.863,02		4.085.972,60
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			**3.110.015,19**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		3.110.015,19		3.110.015,19
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften			**220.313,28**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		220.313,28		220.313,28
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.		2.473.504,03		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		2.473.504,03		2.473.504,03
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		4.307.101,64		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		4.307.101,64		4.307.101,64
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		2.001.198,04	**8.781.803,71**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		2.001.198,04		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**234.084,43**	**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%		27.003,12		13.501,56
Bruttofondsvermögen				**118.246.065,42**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**99.680.394,09**
						durchschnittliche Risikogewichtszahl				**84,30%**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-102.373,64	0,1029%
NOK	0,00	0,0000%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	2.758,53	0,0028%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	42,41	0,0000%
PLN	-9.349,78	0,0094%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,1151%**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR	551.888,70	**0,47%**	414.306,29	**0,35%**
Polen	PL	87.514.425,65	**74,01%**	87.036.519,51	**73,61%**
Finnland	FI	1.969.971,08	**1,67%**	1.969.971,08	**1,67%**
Singapur	SG	281,91	**0,00%**	0,00	**0,00%**
USA	US	1.395.062,19	**1,18%**	717.471,83	**0,61%**
Deutschland	DE	6.384.572,87	**5,40%**	5.456.152,78	**4,61%**
Privilegierte Forderungsklasse (Bankguthaben)		20.429.863,02	**17,28%**	4.085.972,60	**3,46%**