Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.05.2019
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**			**4.524.462,40**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR**	100%		4.524.462,40		4.524.462,40
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**57.053.882,11**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		57.053.882,11		11.410.776,42
2.	Termingeld	12 Monate		**10.000.000,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%		10.000.000,00		5.000.000,00
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**									
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**2.588.200,91**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		2.588.200,91		2.588.200,91
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften			**0,00**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		0,00		0,00
3.	Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben			**0,00**	**Institute, Art. 120 CRR**	50%		0,00		0,00
4.	Sonstige Forderungen									
a.)	Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI	0,00		**Institute, Art. 120 CRR**	50%		0,00		0,00
b.)	Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.		0,00		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		0,00		0,00
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		329.001,19		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		329.001,19		329.001,19
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		1.395.187,19	**1.724.188,38**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.395.187,19		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%		2.584,77		516,95
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		-30.162,19		-15.081,09
Bruttofondsvermögen				**75.890.733,80**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**23.837.876,78**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **31,41**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-352,76	0,0006
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	2,19	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	693,67	0,0012
PLN	-80,91	0,0001
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,0019**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Frankreich	FR	294.012,81	**0,39**	294.012,81	**0,39**
Polen	PL	5.385.732,29	**7,10**	5.385.732,29	**7,10**
Finnland	FI	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Singapur	SG	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
USA	US	0,00	**0,00**	0,00	**0,00**
Deutschland	DE	1.761.919,40	**2,32**	1.761.919,40	**2,32**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		68.449.069,30	**90,19**	16.396.212,28	**21,61**