Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.08.2019
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**			**4.488.692,55**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CI**	100%	4.488.692,55	4.488.692,55
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**							
1.	Bankguthaben			**56.429.211,95**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%	56.429.211,95	11.285.842,39
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			**1.228.730,04**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	1.228.730,04	1.228.730,04
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.		48.904,95		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	48.904,95	48.904,95
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		328.244,68		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%	328.244,68	328.244,68
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		1.434.403,43	**1.811.553,06**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%	1.434.403,43	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%	-30.540,07	-6.108,01
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%	2.503,71	1.251,86
Bruttofondsvermögen				**73.958.187,60**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**		**22.375.558,45**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **30,25**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-1.236,84	0,0021
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	32,54	0,0001
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	696,21	0,0012
PLN	-312,05	0,0005
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,0039**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Frankreich	FR	294.012,81	**0,40**	294.012,81	**0,40**
Polen	PL	5.331.330,73	**7,21**	5.331.330,73	**7,21**
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	469.228,68	**0,63**	469.228,68	**0,63**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		67.863.615,38	**91,76**	16.280.986,23	**22,01**