Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.09.2019
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**			**4.474.502,73**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		4.474.502,73		4.474.502,73
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**56.324.774,45**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		56.324.774,45		11.264.954,89
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			**1.234.526,64**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.234.526,64		1.234.526,64
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.		3.642,20		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		3.642,20		3.642,20
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		328.242,33		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		328.242,33		328.242,33
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb.		1.460.676,26	**1.792.560,79**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.460.676,26		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%		-30.592,68		-6.118,54
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		0,00		0,00
Bruttofondsvermögen				**73.826.364,61**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**22.299.750,25**
					durchschnittliche Risikogewichtszahl in %					**30,21**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-156.545,42	0,2659
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	-6.935,24	0,0118
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	292,34	0,0005
PLN	-1.968,49	0,0033
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,2816**

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	5.314.991,73	**7,20**	5.314.991,73	**7,20**
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	431.909,36	**0,59**	431.909,36	**0,59**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		67.785.450,71	**91,82**	16.258.836,35	**22,02**