Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.10.2019
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**			**4.446.420,09**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CI**	100%		4.446.420,09		4.446.420,09
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**56.387.247,20**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		56.387.247,20		11.277.449,44
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			**1.154.948,84**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.154.948,84		1.154.948,84
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		329.210,23		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		329.210,23		329.210,23
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		1.379.473,12	**1.712.325,55**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.379.473,12		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**12.689,12**	**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%		-18.497,10		-9.248,55
Bruttofondsvermögen				**73.713.630,80**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**22.202.422,25**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **30,12**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-153.122,07	0,2606
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	-7.135,05	0,0121
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	290,42	0,0005
PLN	-38,10	0,0001
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,2733**

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	5.310.687,74	**7,20**	5.310.687,74	**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	329.520,81	**0,45**	329.520,81	**0,45**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		67.779.409,44	**91,95**	16.268.200,89	**22,07**