Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.11.2019
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**			**4.449.482,46**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CI**	100%		4.449.482,46		4.449.482,46
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**56.131.597,36**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		56.131.597,36		11.226.319,47
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			**1.147.580,37**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.147.580,37		1.147.580,37
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.		48.642,65		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		48.642,65		48.642,65
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		328.719,33		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		328.719,33		328.719,33
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		1.409.897,60	**1.787.259,58**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.409.897,60		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%		0,00		0,00
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		-30.808,45		-15.404,23
Bruttofondsvermögen				**73.515.919,77**				**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**		**22.185.340,05**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **30,18**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-148.283,91	0,2528
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	-7.206,21	0,0123
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	293,42	0,0005
PLN	-163,73	0,0003
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,2658**

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	5.301.689,97	**7,21**	5.301.689,97	**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	378.722,03	**0,52**	378.722,03	**0,52**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		67.541.494,96	**91,87**	16.210.915,24	**22,05**