Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2020
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**			**4.423.467,42**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		4.423.467,42		4.423.467,42
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**55.553.583,59**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		55.553.583,59		11.110.716,72
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			**1.085.154,53**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.085.154,53		1.085.154,53
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.		65.086,43		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		65.086,43		65.086,43
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		326.973,97		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		326.973,97		326.973,97
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb.		1.712.947,74	**2.105.008,14**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.712.947,74		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**8.345,33**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**					
					Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		22.635,20		4.527,04
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%		0,00		0,00
Bruttofondsvermögen				**73.175.559,01**				**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**		**22.015.926,11**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **30,09**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	37.850,95	0,0640
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	-6.939,55	-0,0117
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	282,45	0,0005
PLN	3.711,34	0,0063
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**0,0707**

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	809.722,05	**1,11**	809.722,05	**1,11**
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	4.796.947,49	**6,56**	4.796.947,49	**6,56**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		67.274.876,66	**91,94**	16.115.243,76	**22,02**