Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.10.2020
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**			**4.360.086,87**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CI**	100%		4.360.086,87		4.360.086,87
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**52.668.315,42**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		52.668.315,42		10.533.663,08
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			**1.059.501,48**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.059.501,48		1.059.501,48
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.		91.167,08		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		91.167,08		91.167,08
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		271.092,33		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		271.092,33		271.092,33
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		1.669.068,87	**2.031.328,28**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.669.068,87		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**355,62**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**					
					Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		22.574,62		4.514,92
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%		2.829,68		565,94

Bruttofondsvermögen **70.119.587,67**

Summe risikogewichete SA-Positionswerte **21.320.591,70**

durchschnittliche Risikogewichtszahl in % **30,41**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	-597,99	-0,0011
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	-5.153,03	-0,0091
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	276,83	0,0005
PLN	-691,64	-0,0012
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**-0,0114**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Frankreich	FR	307.205,98	**0,44**	307.205,98	**0,44**
Polen	PL	796.510,19	**1,14**	796.510,19	**1,14**
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	4.678.131,59	**6,67**	4.678.131,59	**6,67**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		64.337.739,91	**91,75**	15.538.743,94	**22,16**