Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.12.2020
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**			**4.389.189,68**	**Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C**	100%		4.389.189,68		4.389.189,68
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**									
1.	Bankguthaben			**52.712.757,11**	**Institute, Art. 119 CRR**	20%		52.712.757,11		10.542.551,42
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			**1.156.472,96**	**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		1.156.472,96		1.156.472,96
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.		39.819,21		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		39.819,21		39.819,21
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		271.539,81		**Unternehmen, Art. 122 CRR**	100%		271.539,81		271.539,81
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus		1.054.685,86	**1.366.044,88**	**Zentralstaaten, Art. 114 CRR**	0%		1.054.685,86		0,00
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**34.032,88**	**Institute, Art. 119, 120 CRR**					
					Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		56.588,65		11.317,73
					Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%		0,00		0,00
Bruttofondsvermögen				**69.658.497,51**		**Summe risikogewichete SA-Positionswerte**				**21.410.890,81**
						durchschnittliche Risikogewichtszahl in %				**30,74**

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil EUR	%
USD	202.596,53	0,3525
NOK	0,00	0,0000
MYR	0,00	0,0000
GBP	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,00	0,0000
PLN	3.044.851,48	5,2976
CZK	0,00	0,0000
Fremdwährungsanteil gesamt		**5,6501**

Land		Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
Frankreich	FR	442.691,68	**0,64**	442.691,68	**0,64**
Polen	PL	888.482,97	**1,28**	888.482,97	**1,28**
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	4.525.847,01	**6,50**	4.525.847,01	**6,50**
Privilegierte Forderungsklasse (Institute, Zentralstaaten)		63.801.475,85	**91,59**	15.553.869,15	**22,33**