

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.04.2016
 Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		333.700.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	333.700.000,00	333.700.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		96.779.380,20	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	96.779.380,20	96.779.380,20
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		13.703.645,60	Institute, Art. 119 CRR	20%	13.703.645,60	2.740.729,12
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds 0,00 Transparenter Fonds 0,00	0,00	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100% 0%	0,00 0,00	0,00 0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE						
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		3.244.913,33	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	3.244.913,33	3.244.913,33
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		37.903.267,85	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	37.903.267,85	37.903.267,85
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen						
a.) Anzahlungen auf noch nicht erworbene Objekte	- an Verkäufer 0,00 - auf Notaranderkonto 0,00		Unternehmen, Art. 122 CRR Institute, Art. 120 CRR	100% 50%	0,00 0,00	0,00 0,00
b.) Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.	2.522.024,36		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.522.024,36	2.522.024,36
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	12.766.913,90		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	12.766.913,90	12.766.913,90
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus	4.130.845,07	19.419.783,33	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	4.130.845,07	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		1.791.185,02	Institute, Art. 119, 120 CRR			
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	1.032.230,14	206.446,03
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	1.684.453,04	336.890,61
Bruttofondsvermögen		506.542.175,33			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	490.200.565,40
					durchschnittliche Risikogewichtszahl	96,77%

Fremdwährungsanteil

	Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
		EUR	%
	USD	60.480,57	0,0159%
	NOK	92.986,85	0,0244%
	MYR	0,00	0,0000%
	GBP	-35.548,83	0,0093%
	CNY	0,00	0,0000%
	JPY	0,00	0,0000%
	SGD	229.014,32	0,0600%
	PLN	250.946,36	0,0658%
	CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt			<u>0,1753%</u>