

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.06.2016
Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	= Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		329.300.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	329.300.000,00	329.300.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		91.810.198,43	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%	91.810.198,43	91.810.198,43
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		29.628.433,05	Institute, Art. 119 CRR	20%	29.628.433,05	5.925.686,61
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		4.625.004,83	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	4.625.004,83	4.625.004,83
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		17.109.522,63	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	17.109.522,63	17.109.522,63
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.	2.843.271,58		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.843.271,58	2.843.271,58
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	11.803.527,62		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	11.803.527,62	11.803.527,62
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus	4.872.776,42	19.519.575,62	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	4.872.776,42	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		657.380,91	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 20%	826.948,45 783.383,22	165.389,69 156.676,64
Bruttofondsvermögen		492.650.115,47			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	463.739.278,04

durchschnittliche Risikogewichtszahl 94,13%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-43.378,65	0,0117%
NOK	92.013,44	0,0248%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-43.989,48	0,0119%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	48.649,18	0,0131%
PLN	-17.273,34	0,0047%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		0,0662%

Land	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	45.911.637,37	9,32%
Polen	155.505.201,97	31,57%
Finnland	19.587.402,81	3,98%
Singapur	29.646.838,80	6,02%
USA	61.334.566,41	12,45%
Deutschland	151.753.630,67	30,80%