

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.08.2016
Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	Risikogewichteter SA- = Positionswert
I. IMMOBILIEN		329.600.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		329.600.000,00	329.600.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		76.156.315,08	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%		76.156.315,08	76.156.315,08
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN							
1. Bankguthaben		18.054.930,54	Institute, Art. 119 CRR	20%		18.054.930,54	3.610.986,11
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		3.983.289,37	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		3.983.289,37	3.983.289,37
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		16.996.768,34	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		16.996.768,34	16.996.768,34
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.	9.491.178,78		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		9.491.178,78	9.491.178,78
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	12.634.727,59		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		12.634.727,59	12.634.727,59
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	<u>5.052.695,87</u>	27.178.602,24	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		5.052.695,87	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		606.882,74	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 50%		1.112.956,35 377.424,69	222.591,27 188.712,35
Bruttofondsvermögen		<u>472.576.788,31</u>				Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	<u>452.884.568,88</u>
						durchschnittliche Risikogewichtszahl	95,83%

Fremdwährungsanteil

Ungesicherter Fremdwährungsanteil		
Währung	EUR	%
USD	-69.597,78	0,0220%
NOK	92.396,41	0,0292%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-209.780,76	0,0662%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	-75.666,84	0,0239%
PLN	460.644,02	0,1454%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>0,2867%</u>

Land	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR 45.849.768,37	9,70%
Polen	PL 155.265.787,63	32,86%
Finnland	FI 19.356.534,09	4,10%
Singapur	SG 29.367.072,16	6,21%
USA	US 53.866.251,01	11,40%
Deutschland	DE 149.179.155,64	31,57%