

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.10.2016
Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	=	Risikogewichteter SA-Positionswert
I. IMMOBILIEN		330.500.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		330.500.000,00		330.500.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		76.380.912,50	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CRR	100%		76.380.912,50		76.380.912,50
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN								
1. Bankguthaben		16.103.982,15	Institute, Art. 119 CRR	20%		16.103.982,15		3.220.796,43
2. Investmentanteile	Intransparenter Fonds	0,00	OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100%		0,00		0,00
	Transparenter Fonds	0,00		0%		0,00		0,00
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE								
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		3.516.033,87	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		3.516.033,87		3.516.033,87
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		14.452.739,98	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		14.452.739,98		14.452.739,98
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	Unternehmen, Art. 122 CRR Institute, Art. 120 CRR	100%		0,00		0,00
	- auf Notaranderkonto	0,00		50%		0,00		0,00
b.) Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.	10.475.156,64		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		10.475.156,64		10.475.156,64
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	13.536.825,03		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		13.536.825,03		13.536.825,03
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	0,00	24.011.981,67	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		0,00		0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		169.507,99	Institute, Art. 119, 120 CRR					
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs- /Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		842.420,32		168.484,06
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		109.118,01		54.559,01
Bruttofondsvermögen		465.135.158,16						
			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte					452.305.507,52

durchschnittliche Risikogewichtszahl 97,24%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-554.240,69	0,1758%
NOK	94.764,68	0,0301%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-1.046,28	0,0003%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	30.504,43	0,0097%
PLN	281.554,19	0,0893%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>0,3052%</u>

Land	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR 46.008.276,00	9,89%
Polen	PL 155.543.624,69	33,44%
Finnland	FI 19.452.805,60	4,18%
Singapur	SG 29.258.185,83	6,29%
USA	US 51.700.947,12	11,12%
Deutschland	DE 150.341.668,28	32,32%