

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 30.11.2016
 Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert =
I. IMMOBILIEN		331.800.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%		331.800.000,00	331.800.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		79.177.009,40	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 C	100%		79.177.009,40	79.177.009,40
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN							
1. Bankguthaben		157.976.897,88	Institute, Art. 119 CRR	20%		157.976.897,88	31.595.379,58
2. Investmentanteile			OGA-Risikopositionen, Art. 132 CRR	100%		0,00	0,00
Intransparenter Fonds	0,00			0%		0,00	0,00
Transparenter Fonds	0,00	0,00					
IV. SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE							
1. Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung		3.919.121,67	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		3.919.121,67	3.919.121,67
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		14.672.754,69	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		14.672.754,69	14.672.754,69
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			Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		0,00	0,00
- an Verkäufer	0,00		Institute, Art. 120 CRR	50%		0,00	0,00
- auf Notaranderkonto	0,00						
b.) Forderungen an Dritte/sonstige Forderungen/Ansch.Nk.	-130.964.994,32		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		-130.964.994,32	-130.964.994,32
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	13.325.792,47		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%		13.325.792,47	13.325.792,47
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb. aus	4.798.874,11	-112.840.327,74	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%		4.798.874,11	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		66.356,29	Institute, Art. 119, 120 CRR				
			Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%		454.418,78	90.883,76
			Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	50%		432.183,86	216.091,93
Bruttofondsvermögen		474.771.812,19				Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	343.832.039,17

durchschnittliche Risikogewichtszahl 72,42%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-67.751,90	0,0214%
NOK	95.073,76	0,0301%
MYR	0,00	0,0000%
GBP	-1.012,25	0,0003%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	49.886,09	0,0158%
PLN	-70.868,37	0,0224%
CZK	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>0,0901%</u>

Land	Risikogewichteter SA-Positionswert	durchschnittliche Risikogewichtszahl
Frankreich	FR 47.032.269,78	9,91%
Polen	PL 155.126.464,86	32,67%
Finnland	FI 19.441.486,64	4,09%
Singapur	SG 30.864.762,22	6,50%
USA	US 53.057.959,39	11,18%
Deutschland	DE 38.309.096,28	8,07%