

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz)

Datum: 31.03.2016
Sondervermögen: SEB Global Property Fund

	EUR	EUR	Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X Positionswert	Risikogewichteter SA-Positionswert =
I. IMMOBILIEN		64.800.000,00	Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%	64.800.000,00	64.800.000,00
II. BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN		43.817.280,00	Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 I	100%	43.817.280,00	43.817.280,00
III. LIQUIDITÄTSANLAGEN						
1. Bankguthaben		25.694.187,10	Institute, Art. 119 CRR	20%	25.694.187,10	5.138.837,42
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		2.725.269,39	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	2.725.269,39	2.725.269,39
2. Forderungen an Immobilien-Gesellschaften		4.534.125,00	Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	4.534.125,00	4.534.125,00
3. Zinsansprüche aus befristeten Bankguthaben		0,00	Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00	0,00
4. Sonstige Forderungen	Debitorische Kreditoren					
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.) sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten/Debitorische Kredi.	342.262,21		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	342.262,21	342.262,21
c.) Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter	839.272,21		Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	839.272,21	839.272,21
d.) Vorsteuer und Fdg./Verb.	<u>2.460.564,17</u>	3.642.098,59	Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	2.460.564,17	0,00
5. Ansprüche aus Derivatgeschäften		208.263,37	Institute, Art. 119, 120 CRR Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate) Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20% 20%	-1.907,44 257.352,50	-381,49 51.470,50
Bruttofondsvermögen		<u>145.421.223,45</u>			Summe risikogewichtete SA-Positionswerte	<u>122.248.135,24</u>
					durchschnittliche Risikogewichtszahl	84,06%

Fremdwährungsanteil

Währung	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
	EUR	%
USD	-23.829,41	0,0173%
SEK	0,00	0,0000%
CNY	0,00	0,0000%
JPY	0,00	0,0000%
SGD	0,00	0,0000%
PLN	5.615.298,25	4,0821%
HUF	0,00	0,0000%
Fremdwährungsanteil gesamt		<u>4,0995%</u>