CACEIS Bank S.A., Germany Branch Frankfurt am Main, den 09.08.2022

Risikokennziffer für den SEB ImmoInvest

WKN: 980230
ISIN: DE 0009802306

Zeitraum 06.06.2021 - 31.07.2022			
(60 Wochen)	Mittelwert	0,0133218	%
	Standardabweichung	0,35680957	%
	Risikokennzahl	**1,85594496**	**%**
	(Normierungsfaktor 5,2015)		

Berechnungsgrundlagen:
- Unterstellte Haltedauer in Börsentagen: 10 Tage
- Konfidenzniveau: 95,00%

Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch

Kennziffern gemäß BaFin-Rundschreiben 11/2011 (BA) vom 09.11.2011

Rentenanteil im Fondsvermögen	**0,00**	**%**
Duration	**0,00**	**Tage**

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: **31.07.2022**
Sondervermögen: **SEB ImmoInvest**

			EUR	EUR
I.	**IMMOBILIEN**			**0,00**
II.	**BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN**			**110.316.575,31**
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**			
1.	Bankguthaben			**24.568.009,05**
2.	Termingeld	12 Monate		**0,00**
IV.	**SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE**			
1.	Forderungen aus Immobilienbewirtschaftung			**3.955.817,56**
2.	Forderungen an Immobilien-Gesellschaften			**0,00**
3.	Zinsansprüche			
	aus befristeten Bankguthaben			**0,00**
	aus Wertpapieren			**0,00**

4.	Sonstige Forderungen			
a.)	Margin Account Devisentermingeschäfte	Kontrahent KI	0,00	
b.)	Sonstige Forderungen/Anschaffungsnebenkosten		1.039.656,91	
c.)	Forderungen/Vorauszahlungen an Hausverwalter		0,00	
d.)	Vorsteuer und Fdg./Verb. aus Umsatzsteuer		0,00	**1.039.656,91**
5.	Ansprüche aus Derivatgeschäften			**0,00**

Bruttofondsvermögen		**139.880.058,83**
Nettofondsvermögen	(Bruttofondsverm. abzgl. Verblkt und Rückstellg.)	**107.037.345,43**

Fremdwährungsanteil

	Ungesicherter Fremdwährungsanteil	
Währung	**EUR**	**%**
USD	809.050,74	0,7559
SEK	0,00	0,0000
CNY	0,00	0,0000
JPY	0,00	0,0000
SGD	0,04	0,0000
PLN	528.225,92	0,4935

Land	
Niederlande	NL
Grossbritanien	GB
Belgien	BE
Luxemburg	LU
Österreich	AT
USA	US
Frankreich	FR
Italien	IT
Polen	PL
Japan	JP

GBP	0,00	0,0000	**Ungarn**	HU
HUF	0,00	0,0000	**Singapur**	SG
CZK	0,00	0,0000	**Finnland**	FI
Fremdwährungsanteil gesamt		**1,2494**	**Deutschland**	DE

Privilegierte Forderungsklasse
(Institute, Zentralstaaten)

Risikopositionsklasse gem. Art. 112 CRR	Risikogewicht	X	Positionswert	=
Sonstige Positionen Art. 134 Abs. 1 CRR	100%			0,00
Beteiligungsrisikopositionen Art. 133 CI	100%			110.316.575,31
Institute, Art. 119 CRR	20%			24.568.009,05
Institute, Art. 120 CRR	50%			0,00
Unternehmen, Art. 122 CRR	100%			3.955.817,56
Unternehmen, Art. 122 CRR	100%			0,00
Institute, Art. 120 CRR	50%			0,00
	50%			0,00

Institute, Art. 120 CRR	50%	0,00
Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	1.039.656,91
Unternehmen, Art. 122 CRR	100%	0,00
Zentralstaaten, Art. 114 CRR	0%	0,00
Institute, Art. 119, 120 CRR		
Art. 119 Abs. 2 CRR (Ursprungs-/Restlaufzeit bis einschl. 3 Monate)	20%	0,00
Art. 120 Abs. 1 CRR (Sonstige)	20%	0,00

Summe risikogewichete SA-Positionswerte

durchschnittliche Risikogewichtszahl in %

Bruttofondsvermögen	Bemessungs-grundlage in %	Risikogewichteter SA-Positionswert
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
108.201.207,51	**101,09**	108.201.207,51
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00

0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
0,00	**0,00**	0,00
7.110.842,27	**6,64**	7.110.842,27
24.568.009,05	**22,95**	4.913.601,81

Risikogewichteter SA-Positionswert
0,00
110.316.575,31
4.913.601,81
0,00
3.955.817,56
0,00
0,00
0,00

	0,00
	1.039.656,91
	0,00
	0,00
	0,00
	0,00
120.225.651,59	
112,32	

	durchschnittliche Risikogewichtszahl in %
	0,00
	0,00
	0,00
	0,00
	0,00
	0,00
	101,09
	0,00
	0,00
	0,00

0,00
0,00
0,00
6,64
4,59