CACEIS Bank S.A., Germany Branch

Frankfurt am Main, den 17.01.2023

Risikokennziffer für den SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

WKN: 980231
ISIN: DE 0009802314

Zeitraum 06.11.2021 - 31.12.2022			
(60 Wochen)	Mittelwert	0,0023036	%
	Standardabweichung	0,1120275	%
	Risikokennzahl	**0,5827113**	**%**
	(Normierungsfaktor 5,2015)		

Berechnungsgrundlagen:

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

Berechnung der durchschnittlichen Risikogewichtszahl (SA-Ansatz) gemäß CRRII

Datum: 31.12.2022
Sondervermögen: SEB ImmoPortfolio Target Return Fund

		EUR	EUR
I.	**IMMOBILIEN**		**0,00**
II.	**BETEILIGUNGEN AN IMMOBILIEN-GESELLSCHAFTEN**		**6.878.158,45**
III.	**LIQUIDITÄTSANLAGEN**		
	1. Bankguthaben		**34.685.765,70**