

Caractéristique

Devise	USD
ISIN	CH0301770902
Numéro de valeur	30177090
Bloomberg-ID	AWILSAU
Intervalle d'évaluation	mensuel
Emission/ Rachat	Emission mensuel (sauf août/septembre), avis de souscription au moins 10 jours calendaires avant la date de souscription Rachat semestriel (juin/décembre), avis de rachats au moins 90 jours calendaires avant la
Date de lancement	15.12.2015
Indice de référence	aucun
Gestion	Schroder Investment Management (Switzerland) AG
Banque de dépôt	Bank Julius Bär & Co. AG
Auditeur	PricewaterhouseCoopers AG

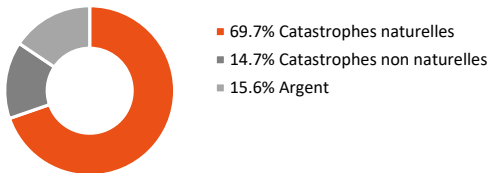
Données de référence

NAV (par 31.07.2023)	USD 1'240.11
Fortune	USD 155'632'714
Nombre de droits	125'498.66
Distribution	capitalisation

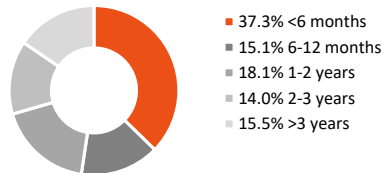
Caractéristiques de risque en %

	Portefeuille
Yield	14.90
Portfolio Expected Loss	-3.90
Value at Risk 95%	-4.80
Tail Value at Risk 95%	-16.30
Probability of a 0% Portfolio Loss	6.60
Probability of a 10% Portfolio Loss	3.80
Probability of a 15% Portfolio Loss	2.70
Nombre de lignes	152

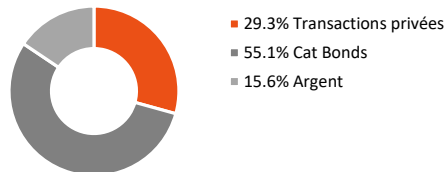
Répartition par instrument d'investissement



Répartition par durée résiduelle



Répartition par risques d'assurance



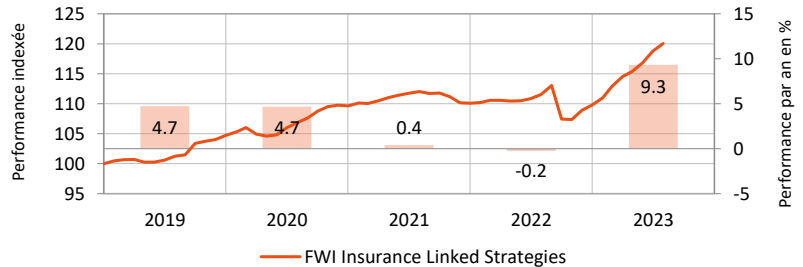
Tarif

	TER KGAST
Fortune totale	2022
Catégorie A: < 5 (Mio. USD)	1.22%
Catégorie B: 5-20 (Mio. USD)	1.07%
Catégorie C: > 20 (Mio. USD)	1.02%

Politique de placement

Le groupe de placement ILS investit, avec une large diversification, dans des Insurance Linked Securities négociables (cat bonds) et non négociables (transactions privées), ou dans des dérivés basés sur ceux-ci. Les risques d'assurance sont, pour l'essentiel, liés aux catastrophes naturelles. Dans un objectif de diversification, des investissements peuvent être effectués à hauteur de 40% au maximum dans des segments de catastrophes non naturelles. La politique d'investissement vise une croissance du capital à long terme tout en diversifiant les risques. L'objectif est d'obtenir, sur un portefeuille d'Insurance Linked Securities, un rendement moyen sur le cycle d'assurance de un rendement net moyen (rendement après déduction des frais) de SOFR (Secured Overnight Financing Rate) plus 5% par an.

Performance nette (en USD)



Contribution par Expected Loss en %

	Portefeuille
USA Florida Tropical Cyclone	14.60
USA Northeast Tropical Cyclone	9.80
USA Southeast Tropical Cyclone	9.50
USA California Earthquake	9.30
Caribbean Tropical Cyclone	9.20
USA Gulf Tropical Cyclone	9.10
Europe Winter Storm	8.90
Other North Atlantic Tropical Cyclone	5.50
Rest of the World All Natural Perils	5.00
Non-Life (excl. Natural Perils)	3.10
USA/Canada Severe Weather	2.60
Japan Tropical Cyclone	2.40
USA/Canada (excl. California, Alaska and Hawaii) Earthquake	2.20
Australia/New Zealand Earthquake	2.10
Europe Flood	1.90
Life	1.50
Japan Earthquake	1.40
Europe Earthquake	1.20
Australia Tropical Cyclone	0.70

Sensibilité du portfolio en regard des événements historiques en %

	Portefeuille
1906 San Francisco Earthquake (Mw 7.4)	-26.80
1926 Great Miami Hurricane (Cat 4)	-18.50
1812 New Madrid Earthquake (Mw 8)	-16.70
1700 Great Cascadia Earthquake (Mw 8.9)	-16.40
2005 Hurricane Katrina (Cat 4)	-14.60
1900 Galveston Hurricane (Cat 4)	-12.60
1938 New England Hurricane (Cat 3)	-12.10
1992 Hurricane Andrew (Cat 5)	-10.20
1960 Hurricane Donna (Cat 3)	-6.80
1994 Northridge Earthquake (Mw 6.5)	-6.40
1989 Hurricane Hugo (Cat 4)	-2.70
1886 Charleston Earthquake (Mw 7.3)	-2.50
1999 Windstorm Lothar	-2.40
1985 Mexico Earthquake (Mw 8)	-2.10
2005 Hurricane Wilma (Cat 5)	-1.80

Performance nette (en USD)

en %	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.	création p.a.
Portefeuille (Cat. A)	1.06	4.03	9.32	7.63	3.96	3.86	2.85
Portefeuille (Cat. B)	1.07	4.07	-9.14	7.78	4.11	4.01	3.00
Portefeuille (Cat. C)	1.07	4.08	-15.30	7.83	4.16	4.06	3.05

Informations générales: la vente de parts du groupe de placement repose sur les documents d'émission déterminants dans leur version en vigueur, en association avec le dernier rapport annuel ou, s'il est disponible, le dernier rapport semestriel du groupe de placement. Clause de non-responsabilité: le présent document a été établi par 1741 Fund Solutions AG (ci-après: «1741»). 1741 n'accorde aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité en cas de perte ou de dommages de quelque nature que ce soit, découlant directement ou indirectement de l'utilisation du présent document ou des informations qu'il contient. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de sa rédaction et peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Sauf mention contraire, l'ensemble des chiffres n'a pas été vérifié. Finalité informative uniquement: le présent document vise uniquement à informer son destinataire et ne constitue ni un conseil en placement, ni une offre ou une recommandation d'acheter des instruments financiers. Il ne dispense pas le destinataire de procéder à sa propre évaluation. Groupe cible: le présent document et les informations qu'il contient s'adressent exclusivement aux caisses de pension suisses. Par conséquent, ni le présent document, ni des copies de celui-ci ne peuvent être envoyés ou emportés aux États-Unis ou remis à des ressortissants américains, conformément à la Regulation S du US Securities Act de 1933. Restriction d'utilisation: ce document s'adresse expressément aux personnes dont la nationalité, le domicile ou d'autres motifs leur permettent d'accéder à de telles informations en vertu des lois en vigueur. En cas de doute, nous vous recommandons de contacter un point de vente ou un établissement bancaire local. Performance: chaque placement comporte des risques et en particulier des risques de fluctuations de la valeur et du rendement. Les placements sont volatils et un investissement peut également entraîner la perte totale des capitaux investis et d'éventuels rendements. De plus, les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais prélevés lors des émissions et/ou rachats. En outre, il est impossible de garantir que la performance de l'indice de référence sera atteinte, voire dépassée. Une évolution positive de la valeur par le passé ou l'indication d'une telle évolution ne saurait garantir l'évolution positive de la valeur à l'avenir. Les investissements dans des devises étrangères peuvent pâtir de fluctuations monétaires. Il existe également un risque que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Distribution en Suisse: en Suisse, ce groupe de placement ne peut être distribué qu'aux caisses de pension. Il s'agit d'un document de marketing.