

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 rachat |
| 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 |

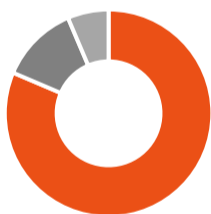
Données de référence

| | |
|----------------------|-----------------|
| NAV (par 31.10.2024) | USD 1'448.73 |
| Fortune | USD 202'604'869 |
| Nombre de droits | 139'850.08 |
| Distribution | capitalisation |

Caractéristiques de risque en %

| Caractéristiques de risque en % | Portfeuille |
|-------------------------------------|-------------|
| Yield | 12.60 |
| Portfolio Expected Loss | -3.10 |
| Value at Risk 95% | -1.10 |
| Tail Value at Risk 95% | -14.20 |
| Probability of a 0% Portfolio Loss | 5.40 |
| Probability of a 10% Portfolio Loss | 2.90 |
| Probability of a 15% Portfolio Loss | 2.20 |
| Nombre de lignes | 179 |

Répartition par instrument d'investissement



- 81.4% Catastrophes naturelles
- 12.2% Catastrophes non naturelles
- 6.4% Cash

Répartition par durée résiduelle



- 44.3% <6 months
- 6.3% 6-12 months
- 14.9% 1-2 years
- 19.4% 2-3 years
- 15.1% >3 years

Répartition par risques d'assurance



- 37.3% Transactions privées
- 56.3% Cat Bonds
- 6.4% Cash

Tarif

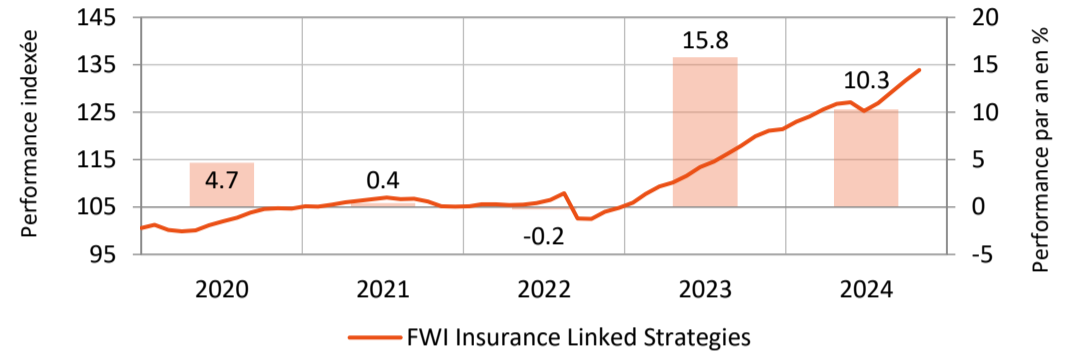
| Fortune totale | TER KGAST 2023 |
|------------------------------|----------------|
| Catégorie A: < 5 (Mio. USD) | 1.07% |
| Catégorie B: 5-20 (Mio. USD) | 0.92% |
| Catégorie C: > 20 (Mio. USD) | 0.87% |

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)

Les performances passées, en particulier sur de courtes périodes, ne préjugent pas des rendements futurs.



Contribution par Expected Loss en %

| Contribution par Expected Loss en % | Portfeuille |
|---|-------------|
| USA Florida Tropical Cyclone | 13.30 |
| USA Northeast Tropical Cyclone | 10.90 |
| USA California Earthquake | 9.90 |
| USA Southeast Tropical Cyclone | 9.80 |
| Europe Winter Storm | 9.10 |
| Caribbean Tropical Cyclone | 8.50 |
| USA Gulf Tropical Cyclone | 7.80 |
| Other North Atlantic Tropical Cyclone | 5.60 |
| Rest of the World All Natural Perils | 5.20 |
| Non Life excl Natural Perils | 5.00 |
| Europe Flood | 2.80 |
| USA Canada Severe Weather | 2.50 |
| USA Canada (excl. California, Alaska and Hawaii) Earthquake | 2.40 |
| Japan Tropical Cyclone | 2.40 |
| Japan Earthquake | 1.70 |
| Australia New Zealand Earthquake | 1.70 |
| Europe Earthquake | 0.90 |
| Life | 0.50 |
| Australia Tropical Cyclone | 0.00 |

Sensibilité du portfolio en regard des évènements historiques en %

| Sensibilité du portfolio en regard des évènements historiques en % | Portfeuille |
|--|-------------|
| 1906 San Francisco Earthquake (Mw 7.4) | -23.70 |
| 1812 New Madrid Earthquake (Mw 8) | -18.40 |
| 1700 Great Cascadia Earthquake (Mw 8.9) | -14.30 |
| 1938 New England Hurricane (Cat 3) | -11.90 |
| 1900 Galveston Hurricane (Cat 4) | -10.20 |
| 1926 Great Miami Hurricane (Cat 4) | -9.60 |
| 2005 Hurricane Katrina (Cat 4) | -7.20 |
| 1992 Hurricane Andrew (Cat 5) | -5.10 |
| 1994 Northridge Earthquake (Mw 6.5) | -4.90 |
| 1960 Hurricane Donna (Cat 3) | -2.50 |
| 1985 Mexico Earthquake (Mw 8) | -1.90 |
| 1923 Kanto Earthquake (Mw 7.9) | -1.60 |
| 1989 Hurricane Hugo (Cat 4) | -1.60 |
| 2008 Hurricane Ike (Cat 2) | -1.40 |
| 1886 Charleston Earthquake (Mw 7.3) | -1.30 |

Performance nette (en USD)

| en % | 1 mois | 3 mois | YTD | 1 an | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | création p.a. |
|----------------------|--------|--------|-------|-------|------------|------------|---------------|
| Portfeuille (Cat. A) | 1.68 | 5.48 | 10.28 | 11.61 | 8.03 | 6.20 | 4.25 |
| Portfeuille (Cat. B) | 1.69 | 5.52 | 10.41 | 11.76 | 8.18 | 6.35 | 4.40 |
| Portfeuille (Cat. C) | 1.70 | 5.53 | 10.45 | 11.81 | 8.23 | 6.40 | 4.45 |

A des fins d'information et de publicité uniquement - Veuillez lire les documents légaux du fonds avant de prendre une décision finale d'investissement. Ce document a été préparé avec le plus grand soin par 1741 Fund Solutions AG en tant que société de gestion (ci-après "1741"). Toutefois, 1741 ne fournit aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité pour les pertes résultant de son utilisation. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de la préparation et peuvent être modifiées sans préavis. Sauf indication contraire, tous les chiffres ne sont pas audités. Ce document doit être lu conjointement avec les documents légaux du fonds (contrat de fonds et rapport annuel et, le cas échéant, prospectus, document d'information clé et rapport semestriel) (ci-après "documents du fonds"), qui peuvent être obtenus gratuitement auprès de la direction du fonds et de la banque dépositaire du fonds. Les souscriptions de parts ne sont acceptées que sur la base des documents du fonds. Cette communication marketing se rapporte aux parts du fonds concerné et non à un actif sous-jacent acquis par le fonds. Les informations contenues dans ce document sont données à titre indicatif et ne doivent pas être interprétées comme une offre, une recommandation ou un conseil en investissement. Elles ne tiennent pas compte de besoins spécifiques et ne dispensent pas le destinataire d'évaluer lui-même, le cas échéant avec l'aide d'un conseiller, la compatibilité des informations avec sa propre situation et les conséquences juridiques, réglementaires, fiscales et autres qui en découlent. La politique d'investissement ne peut être reproduite que dans une version abrégée. La politique d'investissement complète, y compris toutes les restrictions d'investissement, peut être consultée dans les documents du fonds. Le fonds est géré activement. Tout investissement comporte des risques, en particulier des fluctuations de valeur et de revenu. Dans le cas des devises étrangères, il existe un risque supplémentaire que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Une perte totale du montant investi est possible. Une description détaillée des risques figure dans les documents du fonds. La performance indiquée ne tient pas compte des commissions et des frais encourus lors de la souscription, de la conversion, du rachat ou de la détention de parts de fonds, qui peuvent réduire le rendement de l'investisseur. Les informations sur la valeur nette d'inventaire (VNI) s'entendent hors commissions. Il n'y a aucune garantie que la performance d'un indice de référence soit égale ou dépassée. Ce fonds est domicilié en Suisse. La distribution n'est expressément pas destinée aux personnes dont la nationalité ou la résidence interdit l'accès à ces informations en vertu du droit applicable. Ce fonds n'est pas enregistré en vertu de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933. De plus amples informations à ce sujet et sur la distribution publique dans les différents pays sont disponibles dans les documents du fonds. Tous droits réservés.