

### Übersicht

|                                       |   |
|---------------------------------------|---|
| Währung                               | USD   |
| ISIN                                  | CH0301770902  |
| Valor                                 | 30177090  |
| Bloomberg-ID                          | AWILSAU   |
| Bewertungsintervall                   | monatlich   |
| Ausgabe/<br>Rücknahme<br>von Anteilen | Ausgabe monatlich (ausser August/September),<br>mit 10 Kalendertagen Zeichnungsfrist<br>Rücknahme zweimal jährlich (Juni/Dezember),<br>mit 90 Kalendertagen Kündigungsfrist |
| Lancierungsdatum                      | 15.12.2015  |
| Benchmark                             | keine   |
| Asset Manager                         | Schroder Investment Management<br>(Switzerland) AG  |
| Verwahrstelle                         | Bank Julius Bär & Co. AG  |
| Wirtschaftsprüfer                     | PricewaterhouseCoopers AG   |

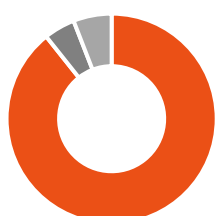
### Eckdaten

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| NAV (per 29.05.2026) | USD 1'708.24    |
| Vermögen             | USD 260'680'310 |
| Ansprüche            | 152'601.82      |
| Ausschüttung         | thesaurierend   |

### Risikocharakteristika in %

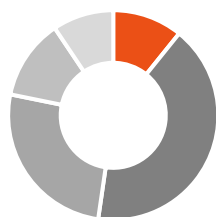
|                                     | Anlagegruppe |
|-------------------------------------|--------------|
| Yield                               | 10.60        |
| Portfolio Expected Loss             | -3.10        |
| Value at Risk 95%                   | -3.30        |
| Tail Value at Risk 95%              | -17.40       |
| Probability of a 0% Portfolio Loss  | 6.60         |
| Probability of a 10% Portfolio Loss | 3.30         |
| Probability of a 15% Portfolio Loss | 2.60         |
| Anzahl Holdings                     | 196          |

### Aufteilung nach Versicherungsrisiken



- 89.3% Naturkatastrophen
- 4.8% Nicht-Naturkatastrophen
- 5.9% Cash

### Aufteilung nach Laufzeit



- 10.8% <6 Monate
- 41.5% 6-12 Monate
- 25.9% 1-2 Jahre
- 12.4% 2-3 Jahre
- 9.4% >3 Jahre

### Aufteilung nach Anlageinstrumenten



- 47.9% Privattransaktionen
- 46.2% Cat Bonds
- 5.9% Cash

### Gebühren

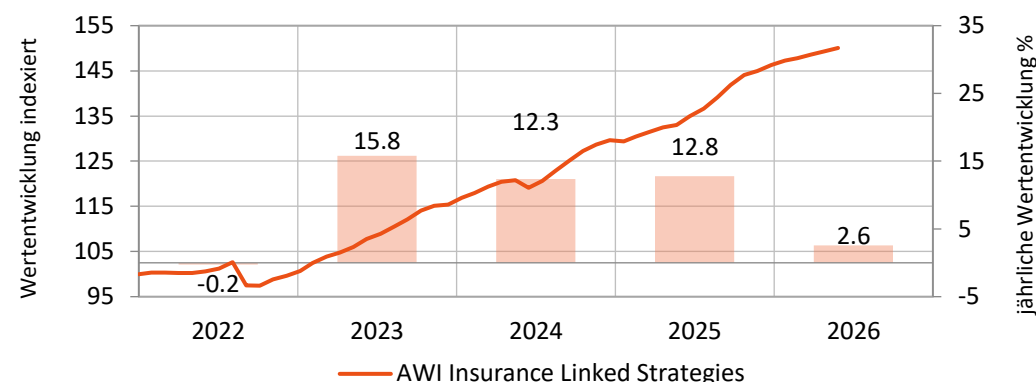
|                              | TER KGAST |
|------------------------------|-----------|
| Gesamtanlagevermögen         | 2025      |
| Kategorie A: < 5 (Mio. USD)  | 1.04%     |
| Kategorie B: 5-20 (Mio. USD) | 0.89%     |
| Kategorie C: > 20 (Mio. USD) | 0.84%     |

### Anlagepolitik

Die Anlagegruppe ILS investiert breit diversifiziert in handelbare (Cat-Bonds) und nicht handelbare (Privattransaktionen) Insurance Linked Securities oder in darauf basierende Derivate. Der Fokus liegt auf Naturkatastrophen, zur Diversifikation können bis zu 40% des Portfolios in nicht-Naturkatastrophen-Segmente investiert werden. Die Anlagepolitik zielt auf ein langfristiges Kapitalwachstum bei gleichzeitiger Risikodiversifikation ab. Ziel ist es, auf einem Portfolio von Insurance Linked Securities, eine über den Versicherungszyklus durchschnittliche Nettorendite (Rendite nach Abzug der Kosten) von SOFR (Secured Overnight Financing Rate) plus 5% pro Jahr zu erwirtschaften.

### Wertentwicklung Netto (in USD)

Die frühere Wertentwicklung, insbesondere bei kurzen Zeiträumen, lässt nicht auf zukünftige Renditen schliessen.



### Beitrag zum Expected Loss in %

|   | Anlagegruppe |
|---|--------------|
| USA Florida Tropical Cyclone                                | 14.10        |
| USA Northeast Tropical Cyclone                              | 10.90        |
| USA Southeast Tropical Cyclone                              | 10.10        |
| USA Gulf Tropical Cyclone                                   | 9.60         |
| USA California Earthquake                                   | 9.60         |
| Caribbean Tropical Cyclone                                  | 8.40         |
| Europe Winter Storm   | 7.90         |
| Rest of the World All Natural Perils                        | 6.40         |
| Other North Atlantic Tropical Cyclone                       | 5.20         |
| Europe Earthquake   | 3.60         |
| Non Life excl Natural Perils                                | 3.00         |
| Europe Flood  | 2.50         |
| USA Canada Severe Weather                                   | 2.30         |
| USA Canada (excl. California, Alaska and Hawaii) Earthquake | 2.00         |
| Japan Earthquake  | 1.50         |
| Australia New Zealand Earthquake                            | 1.40         |
| Japan Tropical Cyclone                                      | 1.40         |
| Life  | 0.10         |
| Australia Tropical Cyclone                                  | 0.00         |

### Portfoliosensitivität gegenüber historischen Ereignissen in %

|   | Anlagegruppe |
|---|--------------|
| 1906 San Francisco Earthquake (Mw 7.4)  | -19.40       |
| 1700 Great Cascadia Earthquake (Mw 8.9) | -16.60       |
| 1812 New Madrid Earthquake (Mw 8)       | -16.50       |
| 1926 Great Miami Hurricane (Cat 4)      | -12.00       |
| 1900 Galveston Hurricane (Cat 4)        | -11.10       |
| 1938 New England Hurricane (Cat 3)      | -10.40       |
| 2005 Hurricane Katrina (Cat 4)          | -9.80        |
| 1994 Northridge Earthquake (Mw 6.5)     | -5.20        |
| 1992 Hurricane Andrew (Cat 5)           | -4.70        |
| 1960 Hurricane Donna (Cat 3)            | -3.10        |
| 1923 Kanto Earthquake (Mw 7.9)          | -1.90        |
| 1886 Charleston Earthquake (Mw 7.3)     | -1.70        |
| 1954 Adelaide Earthquake (Mw 4.3)       | -1.60        |
| 1989 Hurricane Hugo (Cat 5)             | -1.50        |
| 1991 Typhoon Mireille (Cat 4)           | -1.10        |

### Wertentwicklung Netto (in USD)

| in %                  | 1 Monat | 3 Monate | YTD  | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | 5 Jahre p.a. | seit Auf-<br>lage p.a. |
|-----------------------|---------|----------|------|--------|--------------|--------------|------------------------|
| Anlagegruppe (Kat. A) | 0.48    | 1.55     | 2.60 | 12.80  | 12.26        | 8.21         | 5.23                   |
| Anlagegruppe (Kat. B) | 0.49    | 1.59     | 2.66 | 12.95  | 12.41        | 8.36         | 5.38                   |
| Anlagegruppe (Kat. C) | 0.49    | 1.60     | 2.68 | 13.00  | 12.46        | 8.41         | 5.43                   |

---

Nur zur Informations- und Werbezwecken - Bitte lesen Sie die gesetzlich erforderlichen Fondsdokumente, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Dieses Dokument wurde von der 1741 Fund Solutions AG als Fondsleitung (nachfolgend «1741») mit grösster Sorgfalt erstellt. Die 1741 gibt jedoch keine Gewähr hinsichtlich dessen Inhalt und Vollständigkeit und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung ergeben. Die hierin geäusserten Meinungen sind diejenigen der 1741 zum Erstellungszeitpunkt und können sich jederzeit unangekündigt ändern. Ist nichts anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Dieses Dokument ist in Zusammenhang mit den gesetzlich erforderlichen Fondsdokumenten (Fondsvertrag sowie Jahresbericht und soweit anwendbar Prospekt, Basisinformationsblatt sowie Halbjahresbericht) (nachfolgend «Fondsdokumente») zu lesen, welche kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank des Fonds bezogen werden können. Eine Zeichnung von Anteilen wird nur auf der Grundlage der Fondsdokumente angenommen. Diese Marketinganzeige betrifft die Anteile des betreffenden Fonds und nicht eines Basiswerts, welcher vom Fonds erworben wird. Die Angaben in diesem Dokument dienen lediglich Informationszwecken und sind weder als Angebot, Empfehlung oder Anlageberatung aufzufassen. Es berücksichtigt keine spezifischen Bedürfnisse und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung, allenfalls unter Beizug eines Beraters, die Informationen in Bezug auf die Vereinbarkeit mit seinen eigenen Verhältnissen, auf juristische, regulatorische, steuerliche und andere Konsequenzen zu prüfen. Die Anlagepolitik ist allenfalls nur in einer verkürzten Fassung wiedergegeben. Die vollständige Anlagepolitik inkl. aller Anlagebeschränkungen finden sich in den Fondsdokumenten. Der Fonds wird aktiv verwaltet. Mit jeder Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Bei Fremdwährungen besteht zusätzlich das Risiko, dass die Fremdwährung gegenüber der Referenzwährung des Anlegers an Wert verliert. Ein Totalverlust des investierten Betrages ist möglich. Umfassende Beschreibungen der Risiken sind den Fondsdokumenten zu entnehmen. Die dargestellte Wertentwicklung lässt die bei Zeichnung, Umtausch und Rückgabe sowie dem Halten von Fondsanteilen allfällig anfallenden Kommissionen und Kosten unberücksichtigt, welche die Rendite der Anleger reduzieren können. Angaben zum Nettoinventarwert (NAV) verstehen sich exklusive allfälliger Kommissionen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Performance eines allfälligen Vergleichsindex erreicht oder übertroffen wird. Dieser Fonds ist in der Schweiz domiziliert. Der Vertrieb richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbietet. Dieser Fonds ist nicht unter dem United States Securities Act von 1933 registriert. Nähere Informationen hierzu sowie zum öffentlichen Vertrieb in den einzelnen Ländern sind in den Fondsdokumenten zu finden. Alle Rechte vorbehalten.