

ILS SIDE POCKET (ILSSP)

Eckdaten

Depotbank	Bank Lombard Odier & Co AG
Lancierung	Januar 2021
Währung	USD/CHF
Ende Geschäftsjahr	30. September
Ausschüttung	thesaurierend
Fondsvermögen	USD 24.79 Mio.
Kursquelle	Bloomberg ISSPUUA SW istfunds.ch
NAV Kategorie I USD	USD 89.39
NAV Kategorie II CHF	CHF 101.19

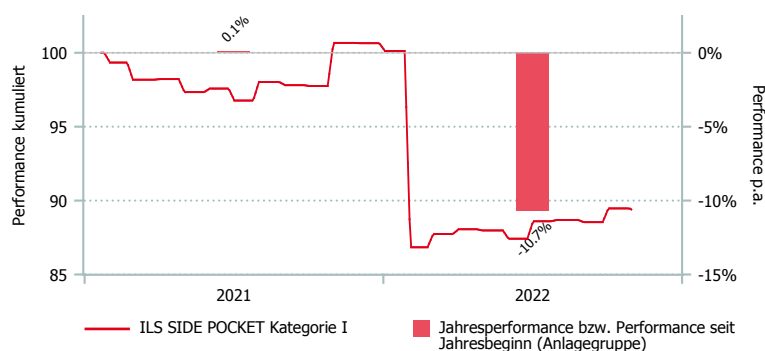
Fondsmanager

Fondsmanager	Securis Investment Partners LLP
Fondsmanager seit	Januar 2021
Unterzeichnung UNPRI	ja

Anlagepolitik

ILS SIDE POCKET ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe mit Anlagen in Insurance Linked Securities weltweit. Dabei werden einzelne oder mehrere Anlagen der Anlagegruppen „IST ILS USD“ und „IST ILS HEDGED CHF“, für welche sich aufgrund eines bedeutenden Versicherungsereignisses kein zuverlässig ermittelbarer Wert feststellen lässt, als sogenannte «bezeichnete Anlagen» resp. «Designated Investments» klassifiziert und in die Anlagegruppe ILSSP ausgelagert. Dies soll verhindern, dass die Anlagegruppen „IST ILS USD“ und „IST ILS HEDGED CHF“ für Zeichnungen und Rücknahmen geschlossen werden müssen. Die Anlagegruppe ist gegen den Schweizer Franken nicht abgesichert.

Performance in USD (in %, netto nach Kosten)



	1 Mt.	3 Mt.	6 Mt.	1 J.	3 J.*	5 J.*	Vol. 3 J.
ILSSP Kat. I USD	-0.09	0.79	1.60	-11.20	-	-	-
ILSSP Kat. II CHF	1.59	5.91	4.76	-2.75	-	-	-

*annualisiert

	2016	2017	2018	2019	2020	2021*	YTD
ILSSP Kat. I USD	-	-	-	-	-	0.12	-10.72
ILSSP Kat. II CHF	-	-	-	-	-	3.18	-1.93

*seit Lancierung

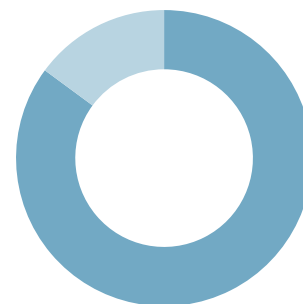
Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

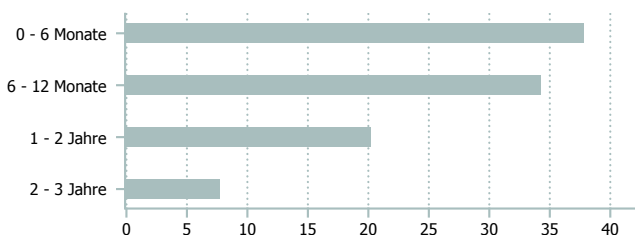
	ILSSP
Fronted Facility All Perils WW A	32.3
Occurr. Excess of loss All Perils WW A	11.9
Quota Share All Perils WW A	9.9
Aggregate Excess of Loss All Perils USA	6.0
Specialty All Perils WW	4.5
Fronted Facility All Perils WW B	3.5
Occurr. Excess of loss All Perils WW B	3.4
Quota Share All Perils WW B	3.2
Quota Share Marine WW	2.9
Quota Share All Perils WW C	2.0

Instrumente (in %)

	ILSSP
Off Risk	85.1
Sonstige (inkl. Liq.)	14.9



Fälligkeiten (in %)



Kategorienübersicht

	Kategorie I	Kategorie II
Valor	58.879.336	58.879.356
ISIN	CH0588793361	CH0588793569
TER KGAST ¹ in % p.a. per 30.09.2022	1.09	1.09
davon TER Zielfonds ² in % p.a. per 30.09.2022	0.92	0.92

¹ Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

² Die TER Zielfonds entsprechen den gewichteten TER der unterliegenden Publikumfonds respektive der institutionellen Fonds der IST. Die Angabe entspricht der Höhe des zuletzt berechneten TER und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.