

Aperçu du fonds

Banque dépositaire	Banque Lombard Odier & Cie SA
Année de lancement	Janvier 2021
Monnaie	USD/CHF
Clôture de l'exercice	30 septembre
Distribution	aucune, capitalisation
Fortune totale	USD 24.55 mn
Source	Bloomberg ISSPUUA SW istfunds.ch
VNI Catégorie I USD	USD 88.54
VNI Catégorie II CHF	CHF 97.74

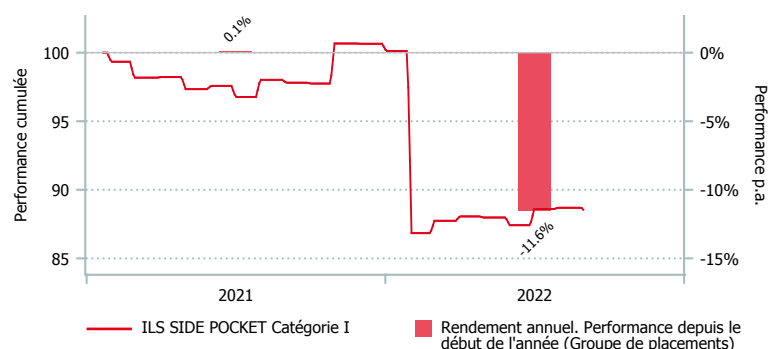
Gérant du fonds

Gérant du fonds	Securis Investment Partners LLP
Gérant du fonds dès	Janvier 2021
Signataire UNPRI	oui

Politique d'investissement

ILS SIDE POCKET est un groupe de placements géré activement qui investit dans des titres liés à l'assurance (Insurance Linked Securities) dans le monde entier. Les placements individuels ou multiples des groupes de placements IST INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS) et IST INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH), pour lesquels aucune valeur déterminable de manière fiable ne peut être établie en raison d'un événement d'assurance important, sont classés comme « placements désignés » ou « Designated Investments » et transférés au groupe de placements ILSSP. Cette mesure vise à éviter que les groupes de placements ILS et ILH ne doivent être fermés aux souscriptions et aux rachats. Le groupe de placements ILSSP n'est pas couvert contre le franc suisse.

Performance en USD (en %, nette de frais)



	1 m.	3 m.	6 m.	1 a.	3 a.*	5 a.*	Vol. 3 a.
ILSSP cat. I USD	-0.17	1.28	0.91	-9.48	-	-	-
ILSSP cat. II CHF	2.30	3.12	7.35	-3.56	-	-	-

*annualisée

	2016	2017	2018	2019	2020	2021*	YTD
ILSSP cat. I USD	-	-	-	-	-	0.12	-11.57
ILSSP cat. II CHF	-	-	-	-	-	3.18	-5.27

*depuis lancement

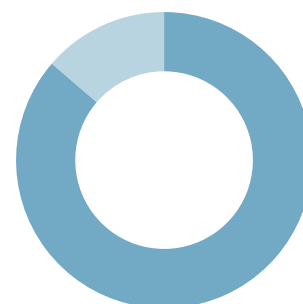
Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

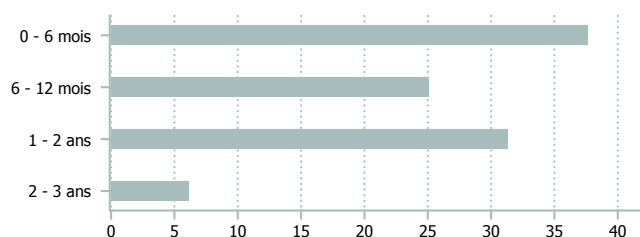
	ILSSP
Fronted Facility All Perils WW A	32.4
Occurr. Excess of loss All Perils USA A	12.0
Quota Share All Perils WW A	9.4
Aggregate Excess of Loss All Perils WW	6.0
Specialty All Perils WW	4.5
Fronted Facility All Perils WW B	3.4
Occurr. Excess of loss All Perils USA B	3.3
Quota Share All Perils WW B	2.9
Quota Share Marine WW	2.9
Quota Share All Perils WW C	2.0

Instruments (en %)

	ILSSP
Off Risk	86.3
Autres (liq. comp.)	13.7



Echéances (en %)



Points de repère

	Catégorie I	Catégorie II
Numéro de valeur	58.879.336	58.879.356
ISIN	CH0588793361	CH0588793569
TER KGAST/CAFP ¹ en % p.a. au 30.09.2021	1.06	1.09
dont TER fonds cibles ² en % p.a. au 30.09.2021	0.89	0.89

¹ Le ratio des charges d'exploitation TER KGAST/CAFP comprend l'entier des frais avec pour exceptions les coûts de transactions ainsi que le droit de timbre et les taxes de bourse

² Le TER fonds cibles est composé du TER de chaque fonds cible pondéré par son poids, respectivement des fonds institutionnels de IST. Le chiffre indiqué correspond à la valeur du dernier TER calculé. Il est susceptible d'évoluer à la hausse comme à la baisse dans le futur.