

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 24.24 mn |
| Source | Bloomberg ISSPUUA SW istfunds.ch |
| VNI Catégorie I USD | USD 87.42 |
| VNI Catégorie II CHF | CHF 94.78 |

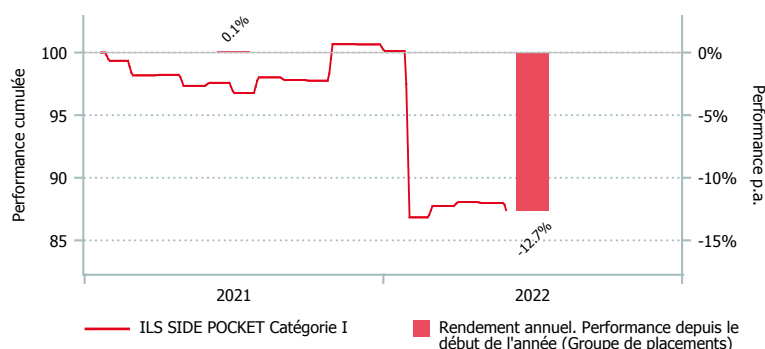
Gérant du fonds

| | |
|---------------------|---------------------------------|
| 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 | -0.64 | -0.36 | -13.14 | -10.41 | - | - | - |
| ILSSP cat. II CHF | -1.87 | 4.10 | -10.03 | -4.52 | - | - | - |

*annualisée

| | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021* | YTD |
|-------------------|------|------|------|------|------|-------|--------|
| ILSSP cat. I USD | - | - | - | - | - | 0.12 | -12.68 |
| ILSSP cat. II CHF | - | - | - | - | - | 3.18 | -8.14 |

*depuis lancement

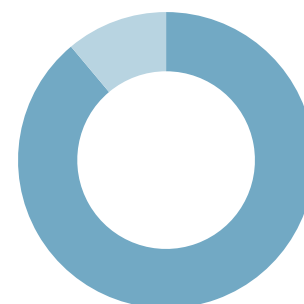
Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

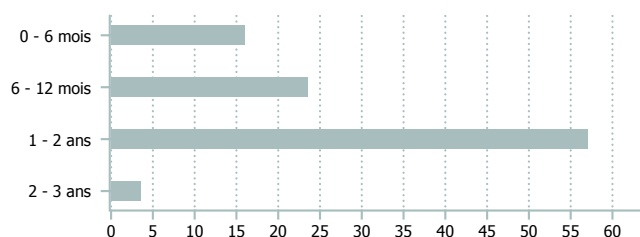
| | ILSSP |
|---|-------|
| Fronted Facility All Perils WW A | 32.8 |
| Occurr. Excess of loss All Perils USA A | 12.0 |
| Quota Share All Perils WW A | 10.9 |
| Aggregate Excess of Loss All Perils WW | 6.0 |
| Specialty All Perils WW | 5.8 |
| Fronted Facility All Perils WW B | 3.5 |
| Occurr. Excess of loss All Perils USA B | 3.3 |
| Quota Share Marine WW | 2.9 |
| Quota Share All Perils WW B | 2.7 |
| Quota Share All Perils WW C | 1.7 |

Instruments (en %)

| | ILSSP |
|---------------------|-------|
| Off Risk | 88.9 |
| Autres (liq. comp.) | 11.1 |



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.