

ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)

1. ZIEL

- **ILS SIDE POCKET 2** 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“ aufgrund einer Anlagestrategieänderung – neu nur noch Risiken im Zusammenhang mit Naturkatastrophen - als sogenannte «bezeichnete Anlagen» resp. «Designated Investments» klassifiziert und in die Anlagegruppe ILSSP2 ausgelagert. Dies soll verhindern, dass die Anlagegruppen „IST ILS USD“ und „IST ILS HEDGED CHF“ für Zeichnungen und Rücknahmen geschlossen werden müssen.
- Die überführten Anlagen werden danach liquidiert. Es handelt sich ausschliesslich um illiquide Anlagen im Bereich Lebensrisiken.

2. ANLAGERICHTLINIEN

- Ansprüche der Anlagegruppe ILSSP2 können nicht gehandelt werden (keine Ausgaben und Rücknahmen von Ansprüchen, ausser der Rücknahmen zur Liquidierung oder Teilliquidierung).
- Ansprüche werden in Tranchen oder als Ganzes zurückgenommen, bis die Anlagegruppe liquidiert ist.
- Nach der letzten Devestition wird die Anlagegruppe liquidiert.
- Es gibt keine Nachschusspflicht.
- Es dürfen keine Zukäufe getätigt werden und es sind keine Kredite (Leverage) erlaubt.
- Kosten und Gebühren dürfen nicht den Anlagegruppen „IST ILS USD“ und „IST ILS HEDGED CHF“ belastet werden.
- Die Anlagegruppe ILSSP2 ist nicht gegen den Schweizer Franken abgesichert.
- Rechnungseinheit der Anlagegruppe ILSSP2 ist der Schweizer Franken.
- Es können Anspruchsklassen in verschiedenen Währungen emittiert werden.

Stand: 13.12.2023