

Anlagegruppe ILS Multi Opportunity

Die Anlagegruppe ILS Multi Opportunity investiert in Versicherungsverbriefungen (Private ILS, Cat-Bonds) sowie in von kleineren und mittelgrossen Versicherungsgesellschaften ausgegebene Fremdkapalinstrumente mit einem Emissionsvolumen von bis zu CHF 300 Mio. (Insurance Private Debt). ILS sind Finanzinstrumente, deren Wert vom (Nicht)Eintritt von Versicherungsereignissen bestimmt wird und unabhängig von Konjunkturzyklen ist. Durch die Verbindung von ILS, Cat-Bonds und Insurance Private Debt wird somit ein verbessertes Diversifikations- und Renditepotenzial verfolgt. Mindestens 90% des investierten Kapitals wird gegenüber dem Schweizer Franken permanent abgesichert.

Kennzahlen

Datum	31.12.2021
Nettoinventarwert	CHF 997.31
Volumen in Mio.	CHF 5.25
Lancierungsdatum	01.04.2021
ISIN	CH1107283090
Investment Manager	Investas AG /Twelve Capital AG
Depotbank	Credit Suisse (Luxembourg) S.A.
Revisionsstelle	BDO AG
TER (erwartet)	1.3%
Referenzwährung	CHF
Benchmark (BM)	nach Aufbauphase: Saron 3 Monate + 4% p.a.
Zeichnung / Rücknahme	Quartalsweise (exklusive 30.09) / Avisierung Zeichnungen 45 Kalendertage, Rücknahmen 180 Kalendertage

Risikokennzahlen

Volatilität	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Beta	N/A
Tracking Error	N/A
Information Ratio	N/A

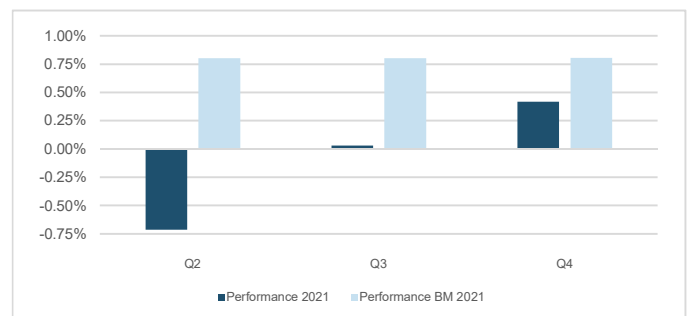
Bericht des Asset Managers

Die Anlagegruppe befindet sich im Aufbau und konnte per Dezember ein Volumen von rund CHF 5.25 Mio. aufweisen. Neben den Cat-Bonds wurde im vierten Quartal nun auch in Insurance Private Debt investiert.

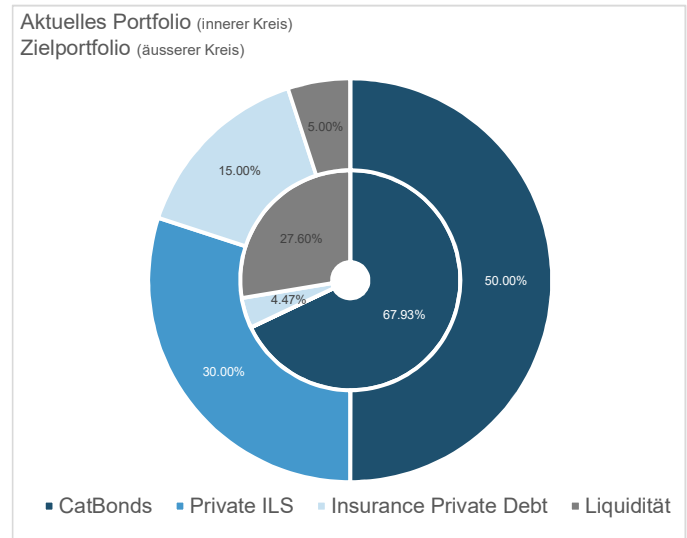
Performance YTD (ab 01.04.2021)

	Strategie	Benchmark
2021	-0.27%	2.43%

Quartalsweise Performance



Aufteilung nach Anlageklassen



Diese Publikation erhebt keinen Anspruch auf vollständige Richtigkeit. Die vergangene Performance ist keine Garantie für die zukünftige Entwicklung.