

ILS MULTI OPPORTUNITY

Die Anlagegruppe ILS Multi Opportunity investiert in Versicherungsverbriefungen (Private ILS, Cat-Bonds) sowie in von kleineren und mittelgrossen Versicherungsgesellschaften ausgegebene Fremdkapitalinstrumente 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.

Nettoperformance

| | Portfolio | BM |
|----------------------|-----------|--------|
| 3 Monate | 3.24% | 1.34% |
| Laufendes Jahr (YTD) | 5.88% | 2.76% |
| 1 Jahr | 12.44% | 5.68% |
| 5 Jahre p.a. | k.A. | k.A. |
| Seit Lancierung | 8.73% | 15.21% |

Volatilität

| | Portfolio | BM |
|----------------------|-----------|-------|
| 1 Jahr p.a. | 0.50% | 0.06% |
| 5 Jahre p.a. | k.A. | k.A. |
| Seit Lancierung p.a. | 4.26% | 0.52% |

Jahres-Nettoperformance

| Jahr | Portfolio | BM |
|------------------------------|-----------|-------|
| 2023 | 9.73% | 5.51% |
| 2022 | -6.16% | 3.75% |
| 2021 (Lancierung 01.04.2021) | -0.27% | 2.43% |

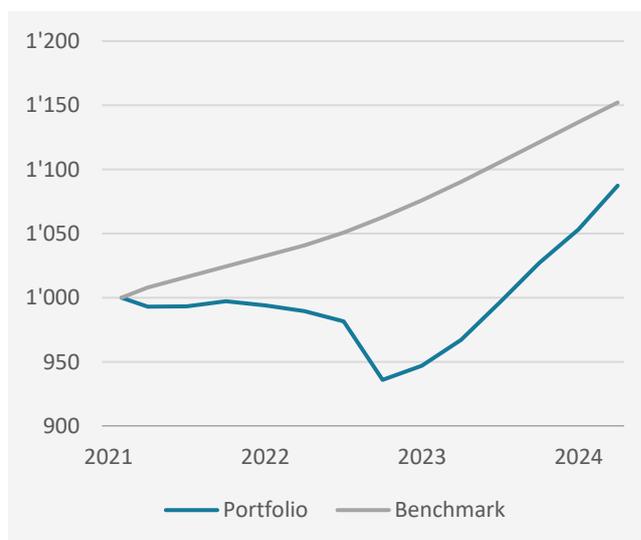
Eckwerte Anlagegruppe

| | |
|-----------------------|--|
| Datum | 30.06.2024 |
| Nettoinventarwert | CHF 1'087.341 |
| Anlagegruppenvermögen | CHF 32'361'932 |
| Lancierungsdatum | 01.04.2021 |
| ISIN | CH1107283090 |
| Investment Manager | Investas AG, Bern Twelve Capital AG, Zürich |
| Depotbank | Credit Suisse (Luxembourg) S.A. |
| Revisionsstelle | BDO AG, Zürich |
| TER KGAST | 1.08% |
| Referenzwährung | abgesichert in CHF |
| Benchmark | SARON 3 Monate + 4% p.a. |
| Ausgabe & Rücknahme | Quartalsweise (exklusive 30.09.) / Avisierung Zeichnung 45 Kalendertage, Rücknahmen 180 Kalendertage |

Risikokennzahlen

| | |
|-----------------------|--------|
| Modified Duration | 0.67% |
| Anzahl Positionen | 109 |
| Bestes Quartal | 3.24% |
| Schlechtestes Quartal | -4.65% |

Performance seit Auflage



Quartals-Nettoperformance

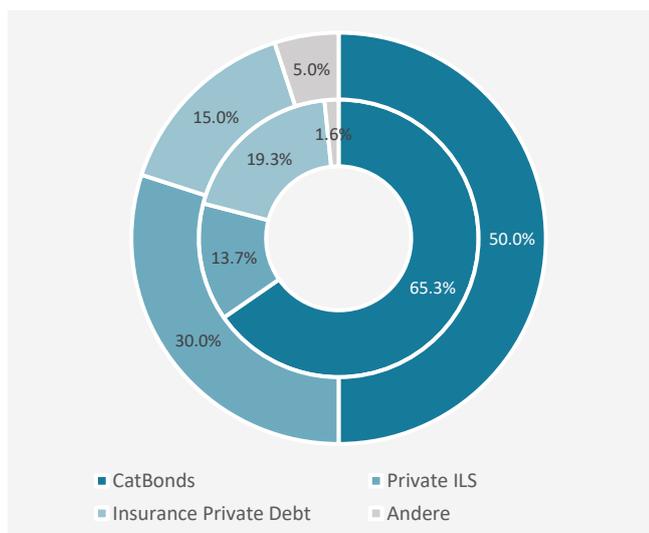
| 2024 | Portfolio | BM |
|------|-----------|-------|
| Q1 | 2.56% | 1.40% |
| Q2 | 3.24% | 1.34% |
| Q3 | | |
| Q4 | | |

Aufteilung nach Anlageklassen

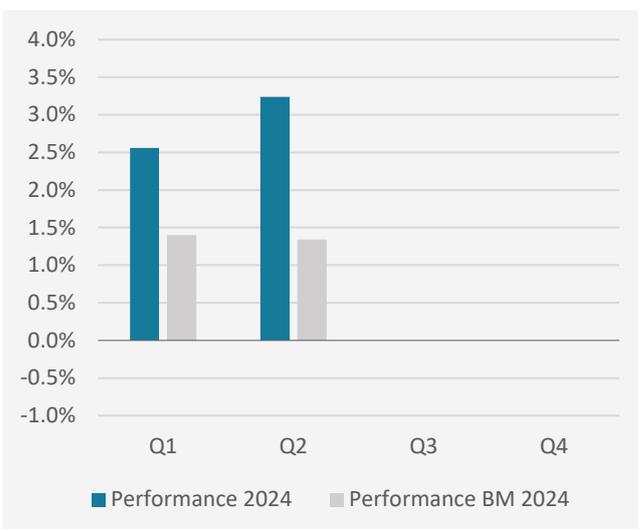
Aktuelles Portfolio: innerer Kreis

Zielportfolio: äusserer Kreis

Investiertes Kapital: 94.39%



Quartalsweise Performance



Quartalsbericht des Asset Managers

Versicherungsanleihen und ILS-Instrumente zeigten im vergangenen Quartal eine positive Performance. Im Juni wurden relativ viele Cat Bonds emittiert, wodurch sich der Gesamtbetrag auf 48 Milliarden USD erhöhte. Die atlantische Hurrikansaison 2024 begann offiziell am 1. Juni. Während des ersten Monats der Saison gab es drei benannte Stürme, darunter einen Kategorie 5 Hurrikan namens Beryl. Dieser brachte starke Winde nach Jamaika und traf schließlich als Kategorie 1 Hurrikan in Texas auf Land. Obwohl der Beginn der Hurrikansaison eine erhöhte Aktivität im Atlantik zeigte, wird derzeit kein Einfluss auf die Performance des Fonds erwartet.

Disclaimer

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

AVENIRPLUS Anlagestiftung

Bärenplatz 8 | Postfach | 3001 Bern | T +41 31 328 80 00 | avenirplus.ch | info@avenirplus.ch