

I de capitalisation JPY Hedged | Données au 28.02.2022

Objectifs et politique d'investissement du fonds

Le fonds vise à dégager un rendement positif après déduction des frais sur une période de trois ans en fournissant une exposition aux risques d'assurance qui remplissent les critères de durabilité du gestionnaire.

Pour plus de détails sur la politique d'investissement du compartiment, veuillez vous reporter au document d'information clé pour l'investisseur (DICI) du compartiment.

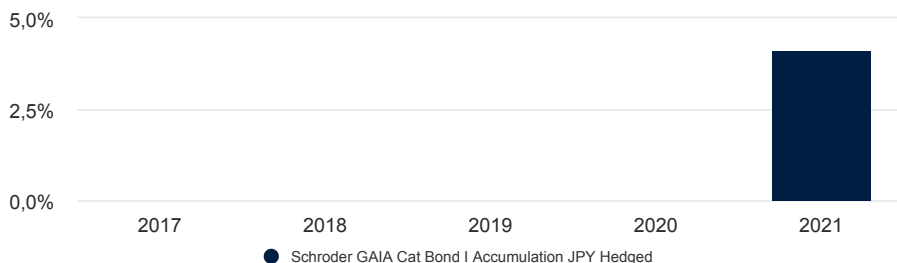
Les risques associés à un investissement dans ce compartiment sont indiqués au verso et doivent faire l'objet d'un examen attentif avant de procéder à tout investissement. L'Objectif d'investissement du compartiment est indiqué ci-dessus. Pour de plus amples informations sur la Politique d'investissement du compartiment, veuillez consulter le DICI.

Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs et pourraient ne pas se répéter. La valeur des investissements et le revenu qu'ils peuvent générer peut évoluer à la hausse comme à la baisse et il est possible que les investisseurs ne récupèrent pas les montants initialement investis. Les taux de change peuvent faire évoluer la valeur des investissements étrangers à la hausse comme à la baisse.

Performance des catégories de parts (%)

Performance cumulée	1 mois	3 mois	Depuis le début de l'année				1 an	3 ans	5 ans	Depuis le lancement			
Catégorie de parts (net)	0,1	0,0	-0,0				2,8	-	-	6,7			
Performance sur 12 mois	Performance annuelle - Févr.					Performance calendaire							
	2017	2018	2019	2020	2021	2017	2018	2019	2020	2021			
	-	-	-	-	-								
	2018	2019	2020	2021	2022								
Catégorie de parts (net)	-	-	-	-	2,8	-	-	-	-	-	4,1		
Performance mensuelle	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juill.	Août	Sept	Oct.	Nov.	Déc.	Fin de l'exercice
2020													
Catégorie de parts (net)	-	-	-	-	-	-	-	-	1,2	0,3	0,1	0,3	2,5
2021													
Catégorie de parts (net)	0,8	0,5	0,3	0,2	0,2	0,2	0,4	-1,1	2,2	-0,1	0,5	0,0	4,1
2022													
Catégorie de parts (net)	-0,1	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Performance sur 5 ans %



Caractéristiques du fonds

Gérant(s) du fonds	Daniel Ineichen
Depuis le	21.10.2013
Société de gestion	Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Domiciliation	Luxembourg
Date de lancement du fonds	21.10.2013
Date de lancement de la catégorie de parts	14.08.2020
Devise de référence du fonds	USD
Devise de la catégorie de parts	JPY
Taille du fonds (en millions)	USD 2.321,30
VL	JPY 10.667,8300
Fréquence de négociation	Quotidienne
Fréquence de distribution	Pas de distribution
Période de préavis	Subscriptions: T-3 ; Redemptions: T-7
Mois positifs	83,3%
Pire mois	-1,1%
Fund Yield (%)	6,3%
% du niveau d'investissement	93,7

Commissions et frais

Frais courants	0,15%
Frais de sortie	0,00%
Frais d'entrée maximum	-

Informations de souscription

Montant minimum de souscription initiale	JPY 5M ; EUR 5M ; USD 5M ou l'équivalent proche dans une autre devise librement convertible.
--	--

Codes

ISIN	LU2197696284
Bloomberg	SGCBIIJA LX
SEDOL	BMB3BF3

I de capitalisation JPY Hedged | Données au 28.02.2022

Facteurs de risque

Risque de performance : Les objectifs d'investissement expriment un résultat escompté mais rien ne permet de garantir qu'un tel résultat sera obtenu. Selon les conditions de marché et l'environnement macroéconomique, il peut devenir plus difficile d'atteindre les objectifs d'investissement

Risque de catastrophe : une obligation catastrophe peut perdre tout ou partie de sa valeur s'il advient une catastrophe couverte par ladite obligation, pouvant entraîner des pertes pour le fonds.

Veuillez consulter le DICI et le Prospectus pour obtenir une liste complète des considérations relatives aux risques applicables à ce compartiment.

« Mois positifs » correspond au nombre de rendements mensuels positifs depuis le lancement divisé par le nombre de total de mois depuis le lancement, indiqué sous forme de pourcentage. « Pire mois » correspond au rendement mensuel du pire mois depuis le lancement

Indicateur de risque SRRI

À RISQUE PLUS FAIBLE
Performance généralement plus faible

À RISQUE PLUS ÉLEVÉ
Performance généralement plus élevée



La catégorie de risque a été calculée à l'aide de données de performance historique et peut ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du Compartiment. Rien ne garantit que la catégorie de risque du compartiment restera inchangée. Veuillez consulter le Document d'information clé pour l'investisseur pour en savoir plus.

Allocation d'actifs

Veuillez noter que les informations sur l'analyse des risques dans cette fiche d'information reflètent la vision du risque de Schroders Capital ILS (SCILS). Ceci est calculé en utilisant les informations et les données reçues par SCILS, quel que soit leur état, dans nos modèles de risque. Cela fait partie de notre processus exclusif d'analyse des risques et peut s'appliquer à toutes les composantes du risque. Source: Schroders. Les principales participations et l'allocation d'actifs s'entendent au niveau du fonds.

Zones de danger de catastrophes naturelles - Contribution

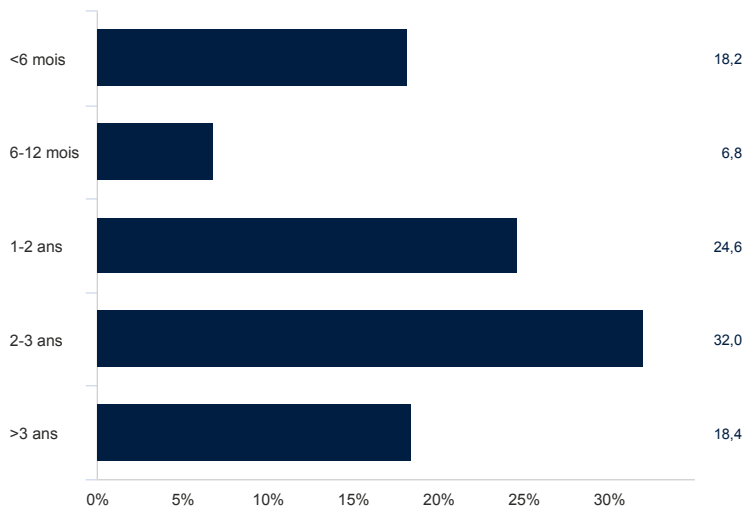
Cyclone tropical - États-Unis, Floride	18,8
Cyclone tropical - États-Unis, Nord-Est	13,2
Cyclone tropical - États-Unis, Sud-Est	12,5
Cyclone tropical - États-Unis, Golfe	11,3
Cyclone tropical - Caraïbes	11,2
Séisme - États-Unis, Californie	10,6
Cyclone tropical - Autres zones Nord Atlantique	7,8
Europe - Tous périls naturels	6,3
Reste du monde - Tous périls naturels	2,5
Tremblement de terre, Japon	1,8
USA/Canada (excl. California, Alaska and Hawaii) Earthquake	1,5
Cyclone tropical - Japon	1,3
Conditions climatiques extrêmes États-Unis/Canada	0,9
Vie et autres	0,2
Australie/Nouvelle-Zélande - Tous périls naturels	0,1

Risk Characteristics (%)

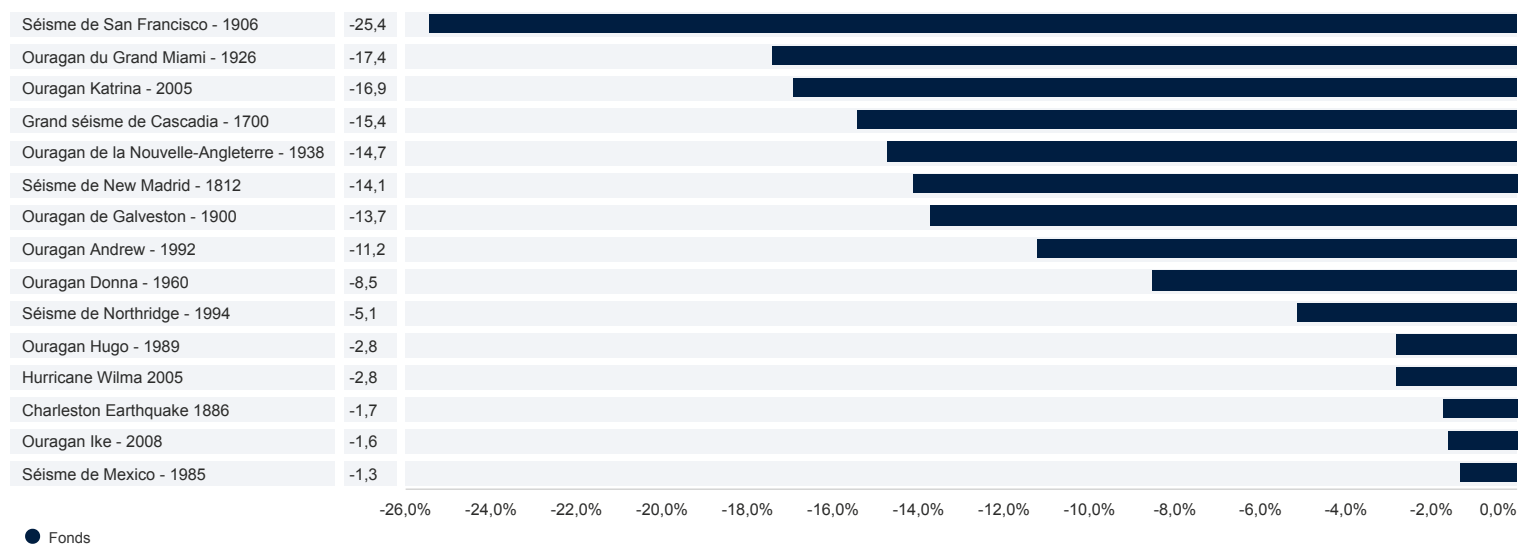
Perte attendue du portefeuille	-3,0
VaR 95 %	-11,3
VaR 95 %	-31,4
VaR 99 %	-23,6
Tail VaR 99 %	-35,0
Probabilité d'une perte pour le portefeuille de 0 %	12,3
Probabilité d'une perte pour le portefeuille de 10 %	5,4
Probabilité d'une perte pour le portefeuille de 15 %	4,0

I de capitalisation JPY Hedged | Données au 28.02.2022

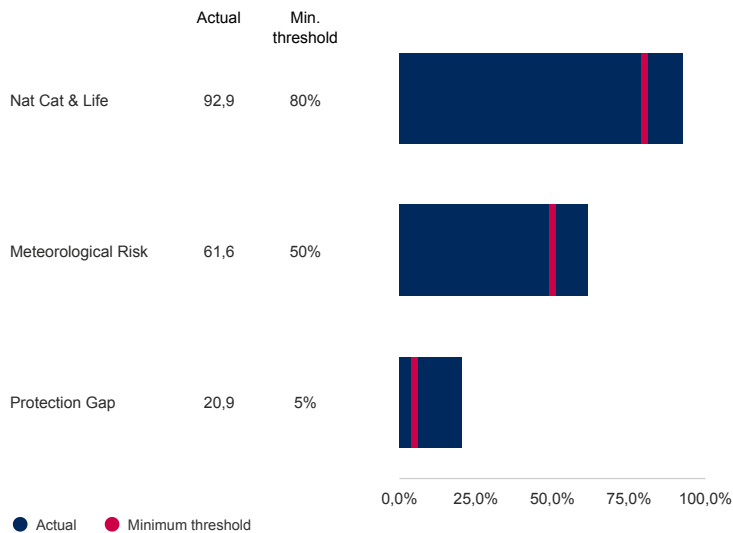
Maturité des investissements en valeur de marché (%)



Modélisation des pertes du portefeuille dues aux catastrophes historiques (%)



Section ESG (%)



I de capitalisation JPY Hedged | Données au 28.02.2022

Coordonnées

Schroder Investment Management (Europe) S.A.
5, rue Höhenhof
Sennigerberg
Luxembourg
L-1736
Téléphone: +352 341 342 202
Fax: +352 341 342 342

Pour votre sécurité, les communications peuvent être enregistrées et surveillées.

Informations relatives aux modifications apportées au gestionnaire de fonds, à l'objectif d'investissement, à l'indice de référence et aux informations sur les opérations sur titres

Le fonds Schroder GAIA Cat Bond a été lancé le 21.10.2013 afin de faire face au transfert des actionnaires du fonds Next Generation Absolute Return-Secquaero ILS vers la Schroder GAIA SICAV. La performance du Fonds doit être évaluée par rapport à son objectif de référence, à savoir fournir un rendement positif sur une période de trois ans. L'indice de référence cible a été sélectionné car le rendement cible du Fonds est de fournir le rendement de cet indice de référence tel qu'indiqué dans l'objectif d'investissement. Le gestionnaire investit de manière discrétionnaire et ses investissements ne se limitent pas aux placements respectant la composition d'un indice de référence. Le Fonds n'est pas tenu de reproduire la performance d'un indice de référence.

Indices de référence

Le gestionnaire d'investissement investit de manière discrétionnaire et il n'existe aucune restriction quant à la mesure dans laquelle le portefeuille et la performance du compartiment peuvent s'écarter de l'indice de référence. Le gestionnaire d'investissement investira dans des sociétés ou des secteurs qui ne figurent pas dans l'indice de référence afin de tirer parti de certaines opportunités d'investissement. Pour la période précédant le 21.10.2013, le fonds utilise l'historique de performance du fonds Next Generation Absolute Return-Secquaero ILS (lancé le 02.05.2011), à compter de la date de lancement effective de la classe d'actions. Source: Schroders

Source et informations sur les notations

Source de toutes les données de performances, sauf indication contraire : Morningstar, cours acheteur à cours acheteur, revenu net réinvesti, net de frais.

Informations importantes

Coûts

Certains coûts associés à votre investissement dans le compartiment peuvent être encourus dans une devise différente de celle de votre investissement. Ces coûts peuvent augmenter ou diminuer en raison des fluctuations des taux de change et des devises.

Si une commission de performance s'applique à ce compartiment, les détails du modèle de commission de performance et de sa méthode de calcul sont disponibles dans le prospectus du compartiment. Il comprend une description de la méthode de calcul de la commission de performance, des dates auxquelles la commission de performance est payée et des détails sur la manière dont la commission de performance est calculée par rapport à l'indice de référence de la commission de performance du compartiment, qui peut différer de l'indice de référence figurant dans l'objectif d'investissement ou la politique d'investissement du compartiment.

Pour de plus amples informations sur les coûts et frais associés à votre investissement, veuillez consulter les notices d'offre et le rapport annuel du compartiment.

Généralités

Schroder GAIA (la "Société") est une Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV) de droit luxembourgeois et est coordonnée au regard de la réglementation européenne. La Société et certains de ses compartiments ont obtenu l'autorisation de commercialisation en France de l'Autorité des Marchés Financiers. Ce document ne constitue en aucun cas une offre contractuelle ni une offre ou une sollicitation en vue de la souscription des actions de la Société. Aucune information ou affirmation contenue dans ce document ne doit être considérée comme une recommandation. Les souscriptions des actions de la Société ne peuvent être effectuées que sur la base du document d'informations clés pour l'investisseur et du prospectus en vigueur, accompagné du dernier rapport annuel audité (ainsi que de tout rapport semestriel non-audité si celui-ci a été publié ultérieurement). Des exemplaires de ces documents peuvent être obtenus gratuitement auprès de Schroder Investment Management (Europe) S.A. ou du correspondant centralisateur de la Société en France, Société Générale, 29 boulevard Haussmann, F-75009. **Tout investissement dans la Société comporte des risques qui sont définis de manière plus détaillée dans le document d'informations clés pour l'investisseur et le prospectus. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les cours des actions ainsi que le revenu qui en découle peuvent évoluer à la baisse comme à la hausse et les investisseurs peuvent ne pas récupérer le montant qu'ils ont investi.** Schroders est responsable du traitement de vos données personnelles. Pour obtenir des informations sur la façon dont Schroders pourrait traiter vos données personnelles, veuillez consulter notre Politique de confidentialité disponible à l'adresse suivante: www.schroders.com/en/privacy-policy ou sur demande au cas où vous n'auriez pas accès à cette page Web. Ce document est produit par Schroder Investment Management (Europe) S.A., 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Luxembourg.R.C. Luxembourg B 37.799. Pour votre sécurité, les communications peuvent être enregistrées et surveillées. D'autres catégories de parts pour ce fonds pourraient être disponibles Schroders est responsable du traitement de vos données personnelles. Pour obtenir des informations sur la façon dont Schroders pourrait traiter vos données personnelles, veuillez consulter notre Politique de confidentialité disponible à l'adresse suivante: www.schroders.com/en/privacy-policy ou sur demande au cas où vous n'auriez pas accès à cette page Web. Les données de parties tierces sont la propriété du fournisseur de données ou celui-ci y est autorisé sous licence, et ne peuvent être reproduites ou extraites et utilisées à aucune autre fin sans l'autorisation du fournisseur de données. Ces données sont fournies sans aucune garantie de quelque nature que ce soit. Le fournisseur des données et l'émetteur du document ne peuvent aucunement être tenus responsables par rapport aux données de parties tierces. Le prospectus et/ou www.schroders.com contiennent les avertissements supplémentaires applicables aux données des parties tierces