Schroders
capital

Schroder GAIA Cat Bond

Material comercial para clientes profesionales, inversores minoristas asesorados por un asesor de inversiones profesional o que sean inversores sofisticados.

A de Acumulación USD | Datos a fecha 31.10.2022

Política de inversión y objetivos del fondo

El objetivo del fondo es proporcionar una rentabilidad positiva, una vez deducidas las comisiones, durante un periodo de tres años. El fondo se gestiona de forma activa e invertirá en valores relacionados con riesgos de seguros (denominados valores vinculados a seguros), principalmente en bonos de catástrofes o "CAT".

Para obtener más información sobre la política de inversión del fondo, consulte el Documento de datos fundamentales para el inversor (KIID) del fondo.

El Fondo tiene características medioambientales o sociales (en el sentido que se les atribuye en el artículo 8 del SFDR). El fondo mantiene una puntuación absoluta positiva en materia de sostenibilidad, según el sistema de calificación del gestor de inversiones.
Los riesgos relevantes asociados a una inversión en este fondo se muestran al dorso y deben tenerse especialmente en cuenta antes de realizar cualquier inversión.

La rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad futura y puede no volver a repetirse. El valor de las inversiones y de los ingresos generados por ellas puede bajar o subir, y es posible que los inversores no recuperen el importe original invertido. Las variaciones en los tipos de cambio pueden provocar que el valor de las inversiones disminuya o aumente. Los datos relativos a la rentabilidad no tienen en cuenta las comisiones ni los costes, si los hubiera, asociados a la emisión y el reembolso de las participaciones o las acciones de cualquier fondo, según sea aplicable.

Rentabilidad de la clase de participación (%)

Rentabilidad acumulada	1 mes	3 meses	En lo que va de año	1 año	3 años	5 años	Desde el lanzamiento
Rentabilidad neta	2,5	-5,4	-6,3	-6,0	1,4	-	3,0

Desglose de la rentabilidad anual	Oct 12 - Oct 13	Oct 13 - Oct 14	Oct 14 - Oct 15	Oct 15 - Oct 16	Oct 16 - Oct 17	Oct 17 - Oct 18	Oct 18 - Oct 19	Oct 19 - Oct 20	Oct 20 - Oct 21	Oct 21 - Oct 22
Rentabilidad neta	-	-	-	-	-	-	-	4,9	2,8	-6,0

Rentabilidad del año natural	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Variación de cuotaparte	-	-	-	-	-	-	-	-	4,8	2,8

Rentabilidad mensual	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Fin de año
2020													
Variación de cuotaparte	0,5	0,5	-1,9	1,0	-0,0	0,9	1,1	1,1	1,1	0,2	-0,0	0,3	4,8
2021													
Variación de cuotaparte	0,7	0,4	0,2	0,1	0,0	0,1	0,3	-1,3	2,1	-0,2	0,3	0,0	2,8
2022													
Variación de cuotaparte	-0,2	-0,1	-0,1	-0,1	-0,1	-0,2	-0,2	0,7	-8,3	2,5	-	-	-

Rentabilidad de 10 años (%)

Ficha del fondo

Gestor del fondo	Daniel Ineichen
Fondo gestionado desde	21.10.2013
Sociedad gestora de fondos	Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Domicilio	Luxemburgo
Fecha de lanzamiento del fondo	21.10.2013
Fecha de lanzamiento de la clase de participación	27.09.2019
Divisa de denominación del fondo	USD
Divisa de la clase de participación	USD
Tamaño del fondo (millones)	USD 2.007,04
Valor liquidativo neto por unidad	USD 1.379,2200
Frecuencia de negociación	Segundo y cuarto viernes de un mes y último día laborable de un mes
Frecuencia de distribución	Sin distribución
Período de notificación	Subscriptions: T-3 ; Redemptions: T-7
Meses positivos	62,2%
Peor mes	-8,3%
Fund Yield (%)	13,4%
Nivel de inversión %	96

Comisiones y gastos

Gastos de entrade de hasta	1,00%
Gastos corrientes	1,77%
Comisión de salida	0,00%

Datos de compra

Suscripción mínima inicial	USD 100.000 ; EUR 100.000 o su equivalente más próximo en cualquier otra moneda de libre conversión.

Consideraciones de riesgo

Riesgo de divisas: el fondo puede perder valor como resultado de movimientos en los tipos de cambio extranjeros.
Riesgo de derivados: los derivados se pueden utilizar para gestionar la cartera de forma eficiente. El fondo también puede invertir materialmente en derivados (por ejemplo, mediante técnicas de venta en corto y apalancamiento) con el fin de obtener rentabilidad. un derivado puede no rendir como se espera, generar pérdidas superiores al coste del derivado y suponer pérdidas para el fondo.
Riesgo de tipo de interés: el fondo puede perder valor como consecuencia directa de los cambios en los tipos de interés.
IBOR: la transición de los mercados financieros del uso de tipos de oferta interbancaria (IBOR) a tipos de referencia alternativos puede afectar a la valoración de determinadas participaciones y, en consecuencia, a la liquidez de determinados instrumentos. Esto puede afectar a la rentabilidad de la inversión del fondo.
Riesgo de rentabilidad: los objetivos de inversión expresan un resultado previsto, pero no hay garantía alguna de que se vaya a alcanzar dicho resultado. En función de las condiciones del mercado y del entorno macroeconómico, los objetivos de inversión pueden resultar más difíciles de lograr.
Riesgo de bonos de alto rendimiento: los bonos de alto rendimiento (normalmente de baja calificación o sin calificación) generalmente conllevan un mayor riesgo de mercado, crédito y liquidez.
Riesgo de catástrofe: Un bono "cat" puede perder gran parte o la totalidad de su valor si se produce una catástrofe cubierta por el mismo, lo que puede suponer pérdidas para el fondo.
Riesgo de concentración: el fondo puede concentrarse en un número limitado de regiones geográficas, sectores industriales, mercados o posiciones individuales. Esto puede dar lugar a cambios sustanciales en el valor del fondo, tanto al alza como a la baja.
Riesgo de crédito: el declive en la salud financiera de un emisor podría provocar la bajada del valor de sus bonos o una pérdida de su valor.
Riesgo de liquidez: en condiciones de mercado adversas, puede que el fondo no sea capaz de vender un valor a su valor completo o que no pueda venderlo en absoluto. Esto podría afectar el rendimiento y provocar que el fondo aplazara o suspendiera el reembolso de sus acciones.
Riesgo operativo: los procesos operativos, incluidos los relacionados con la custodia de activos, pueden fallar. Esto puede suponer pérdidas para el fondo.
Riesgo de sostenibilidad: El fondo tiene características medioambientales y/o sociales. Esto significa que puede tener una exposición limitada a algunas sociedades, industrias o sectores, y que puede renunciar a ciertas oportunidades de inversión, o deshacerse de ciertas participaciones, que no se ajusten a sus criterios de sostenibilidad, que han sido seleccionados por la gestora de inversiones. El fondo podrá invertir en sociedades que no reflejen las convicciones ni los valores de ningún inversor en particular.

Códigos

ISIN	LU2049314961
Bloomberg	SGCBAUA LX
SEDOL	BK5TWG1

"Meses positivos"es la cantidad de rentabilidades mensuales positivas desde el lanzamiento dividida por la cantidad total de meses desde el lanzamiento expresada en porcentaje. "Peor mes"es la rentabilidad mensual del mes con la peor rentabilidad desde el lanzamiento

Indicador sintético de riesgo/rentabilidad (en inglés, SRRI)

MENOR RIESGO
Remuneraciones potencialmente inferiore

MAYOR RIESGO
Remuneraciones potencialmente superiore

La categoría de riesgo se calculó utilizando datos de rentabilidad histórica y puede que no sea un indicador fiable del perfil de riesgo futuro del fondo. No se garantiza que la categoría de riesgo del fondo permanezca invariable. Consulte el Documento de datos fundamentales para el inversor para obtener más información.

Asignación de activos

Tenga en cuenta que la información del análisis de riesgos en esta hoja informativa refleja la visión del riesgo de Schroders Capital ILS (SCILS). Esto se calcula utilizando información y datos recibidos por SCILS, en cualquier estado, en nuestros modelos de riesgo. Esto es parte de nuestro proceso de análisis de riesgo patentado y puede aplicarse a todos y cada uno de los componentes del riesgo. Fuente: Schroders. Las posiciones principales y la asignación de activos se presentan a escala del fondo.

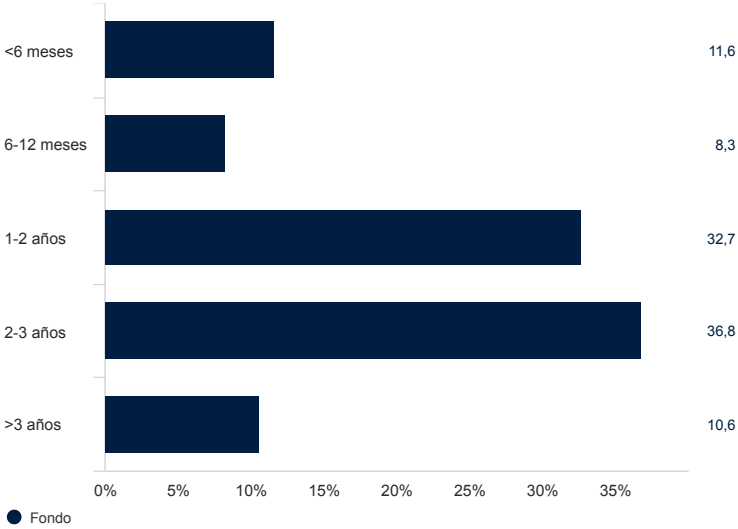
Zonas en peligro de sufrir catástrofes naturales - Contribuci

Ciclón tropical Florida, EE. UU.	18,1
Ciclón tropical noreste de EE. UU.	13,0
Ciclón tropical Golfo de EE. UU.	12,2
Ciclón tropical sudeste de EE. UU.	12,1
Ciclón tropical Caribe	11,1
Terremoto California, EE. UU.	10,8
Ciclón tropical Atlántico Norte otros	8,0
Todos los peligros naturales Europa	5,7
Todos los peligros naturales resto del mundo	2,6
Ciclón tropical Japón	1,9
USA/Canada (excl. California, Alaska and Hawaii) Earthquake	1,7
Terremoto Japón	1,4
Clima extremo EE. UU./Canadá	1,0
Todos los peligros naturales Australia/Nueva Zelanda	0,2
Vida y otros	0,2

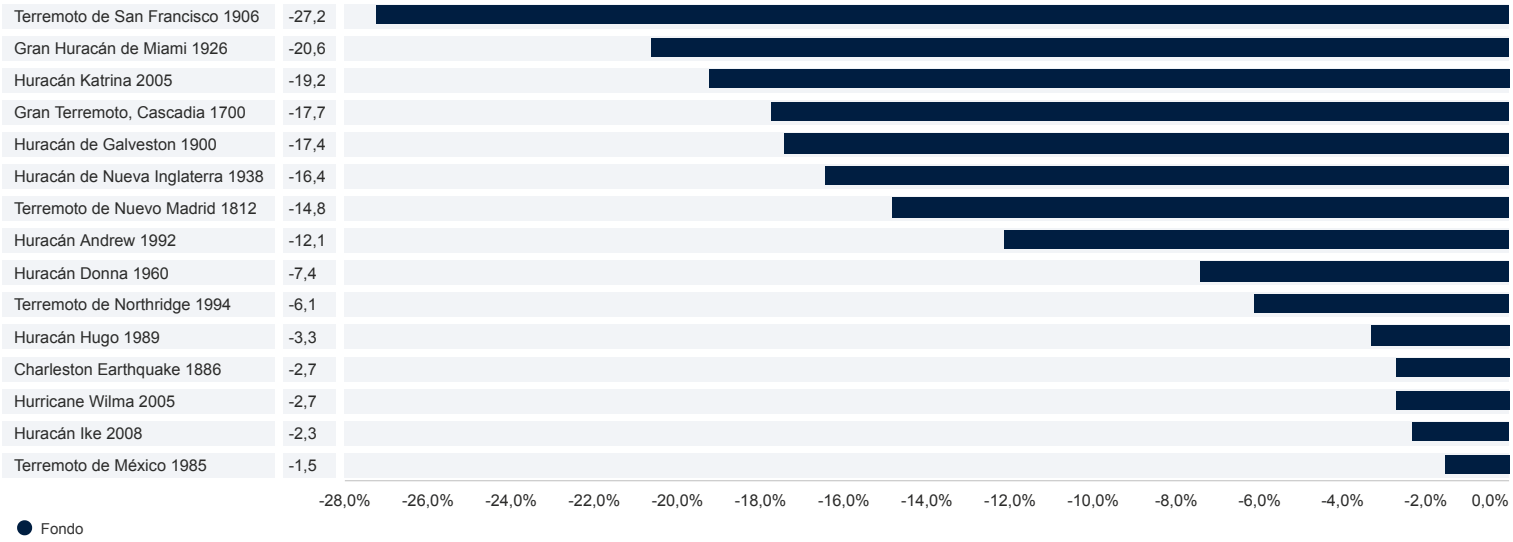
Risk Characteristics (%)

Pérdida estimada de la cartera	-3,3
Valor en riesgo 95%	-6,8
Valor en riesgo de cola 95%	-20,7
Valor en riesgo 99%	-29,3
Valor en riesgo de cola 99%	-32,9
Probabilidad de una pérdida de la cartera del 0%	7,0
Probabilidad de una pérdida de la cartera del 10%	4,2
Probabilidad de una pérdida de la cartera del 15%	3,4

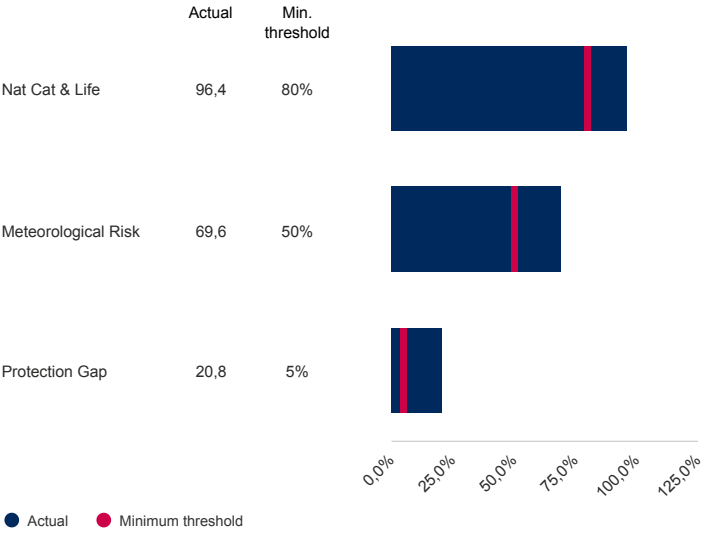
Vencimiento de las inversiones por valor de mercado (%) (%



Pérdidas de la cartera modeladas a partir de catástrofes históricas (%) (%)



Sección ESG (%)



Datos de contacto

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

Para su seguridad, se grabarán la conversaciones telefónicas.

Información relacionada con cambios de gestión del fondo, objetivo de inversión, valor de referencia o iniciativas corporativas

La rentabilidad del fondo se debe evaluar con respecto a su índice de referencia objetivo, que consiste en generar un rendimiento positivo a lo largo de un periodo de tres años.El índice de referencia objetivo se ha seleccionado porque el rendimiento objetivo del fondo es generar el rendimiento de dicho índice de referencia tal y como se establece en el objetivo de inversión. El gestor de inversiones invierte a su entera discreción y sus inversiones no están sujetas a límites impuestos por la composición de un índice de referencia. No se espera que el fondo reproduzca la rentabilidad de ningún índice de referencia. Schroder GAIA Cat Bond fue lanzado el 21.10.2013 para acomodar una transferencia de partícipes de Next Generation Absolute Return-Secquaero ILS Fund a Schroder GAIA SICAV.

Índices de referencia

La gestora de inversiones invierte a su entera discreción y no existen restricciones en la medida en que la cartera y la rentabilidad del fondo puedan desviarse del índice de referencia. La gestora de inversiones invertirá en empresas o sectores no incluidos en el índice de referencia con el fin de aprovechar oportunidades de inversión específicas.
Los nombres de los valores de referencia de este documento pueden estar abreviados. Consulte la documentación jurídica de los fondos para conocer el nombre completo de los valores de referencia. Antes del 21.10.2013 el fondo usa el historial de Next Generation Absolute Return-Secquaero ILS (lanzado el 02.05.2011) como historial de rentabilidad, desde la fecha de lanzamiento real de la clase de participación. Fuente: Schroders

Fuentes y calificaciones información

Fuente de todos los datos de rentabilidad, a menos que se indique lo contrario: Morningstar, precio de oferta (bid to bid), reinversión de ingresos netos, deducidas las comisiones.

Información importante

Costes

Ciertos costes asociados a su inversión en el fondo pueden producirse en una divisa diferente a la de su inversión. Dichos costes pueden aumentar o disminuir como resultado de las fluctuaciones de las divisas y los tipos de cambio.

En caso de que se aplique una comisión de rentabilidad a este fondo, consulte el folleto correspondiente para obtener más información sobre el modelo de comisión de rentabilidad y su metodología de cálculo. Dicha información incluye una descripción de la metodología de cálculo de la comisión de rentabilidad, las fechas en las que se paga la comisión de rentabilidad y los detalles de cómo se calcula la comisión de rentabilidad en relación con el índice de referencia de comisiones de rentabilidad del fondo, que puede diferir del índice de referencia del objetivo de inversión o de la política de inversión del fondo.

Para obtener más información sobre los costes y los gastos asociados a su inversión, consulte los documentos de oferta y el informe anual de los fondos.

General
Este documento tiene carácter meramente informativo y no constituye ninguna oferta, solicitud o recomendación de suscripción de participaciones de Schroder GAIA (la"Sociedad") por parte de ninguna persona. Ninguna información contenida en el mismo debe interpretarse como asesoramiento o consejo, financiero, fiscal, legal o de otro tipo. La Sociedad está inscrita en el Registro Administrativo de Instituciones de Inversión Colectiva extranjeras comercializadas en España de la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV), con el número 825. Su depositario es Brown Brothers Harriman (Europe) S.C.A. y su sociedad gestora es Schroder Investment Management (Europe) S.A. La Sociedad es un OICVM registrado en Luxemburgo. La adquisición de participaciones de la Sociedad por el inversor deberá efectuarse en base a, y de conformidad con, el Folleto Informativo y el Documento con los Datos Fundamentales para el Inversor (KIID) en vigor, y demás documentación relevante de la Sociedad. En este sentido, el inversor deberá recibir gratuitamente antes de la suscripción de las participaciones la documentación requerida por las disposiciones legales a tal efecto. Dicha documentación deberá ser facilitada, en su caso, junto con sus correspondientes traducciones en español. La misma se encuentra disponible de forma gratuita para la consulta del público en www.schroders. es Schroder Investment Management (Europe) S.A., la CNMV, las oficinas de los distribuidores de la Sociedad y Schroder Investment Management Limited Sucursal en España. Los inversores deben tener en cuenta que la inversión en la Sociedad conlleva riesgos (para más información véase el Folleto Informativo), y que la inversión puede no ser adecuada para los mismos. Publicado por: Schroder Investment Management (Europe) S.A., 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Luxembourg.R.C.S. Luxembourg: B 37.799. Para su seguridad, las comunicaciones serán grabadas o controladas.
El fondo tiene características medioambientales o sociales en el sentido que se les atribuye en el artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR, por sus siglas en inglés). Para obtener información sobre los aspectos relacionados con la sostenibilidad de este fondo, visite www.schroders.com.
Schroders será responsable del tratamiento de tus datos personales. Para obtener información sobre cómo Schroders podría tratar tus datos personales, consulta nuestra Política de privacidad disponible en www.schroders.com/en/privacy-policy o solicítala a infospain@schroders. es en caso de que no tengas acceso a este sitio web. Los datos de terceros son propiedad o están sujetos a licencia del proveedor de datos y no podrán reproducirse o extraerse y utilizarse con ningún otro fin sin el consentimiento del referido proveedor de datos. Los datos de terceros se facilitan sin garantías de ningún tipo. El proveedor de datos y el emisor del documento no serán responsables en modo alguno en relación con los referidos datos de terceros. El Folleto y/o www.schroders.comcontienen cláusulas adicionales de exoneración de responsabilidad aplicables a tales datos.