

Politique d'investissement

Le Baloise Senior Secured Loan Fund investit au moins 80 % de ses actifs en prêts garantis de premier rang (Senior Secured Loans) émis en US-Dollar. La rémunération des Senior Secured Loans est variable car liée au taux d'intérêt du marché monétaire et offre donc ainsi une protection contre les hausses de taux d'intérêt. De plus, le fonds peut également investir dans d'autres placements (prêts garantis de deuxième rang, obligations high yield, ainsi que d'autres instruments de notation Non-Investment Grade). L'approche multi-managers propose une combinaison de positionnement stratégique et d'analyse (de crédit) fondamentale au travers de plusieurs loan-managers, afin d'investir de manière largement diversifiée dans des Senior Secured Loans. L'objectif du fonds est d'offrir un ratio rendement / risque intéressant.

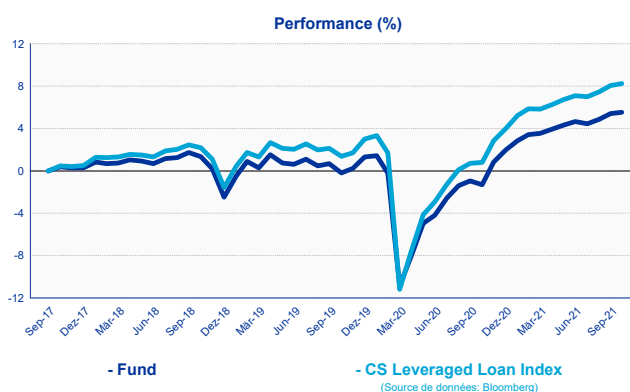
Gestion

Thomas Haueter
Gestionnaire
Senior Secured Loans



Performance

Performance	Fonds (net de frais)	Indice de référence (sans coûts)
	Fonds	CS Leveraged Loan Index
1 mois	0.12%	0.16%
3 mois	0.84%	1.14%
Année en cours (YTD)	3.50%	4.07%
1 an	6.53%	7.28%
Depuis le lancement	5.53%	8.23%
Depuis le lancement (ann.)	1.33%	1.96%



Évaluation actuelle

Cours d'émission par part (NAV)	CHF	1'055.32
Fortune de la classe de parts	CHF	3'350'401
Fortune totale du fonds	USD	1'976'290'699

Informations détaillées sur le portefeuille

Top 10 des secteurs

Consumer Discretionary	24.1%
Technology	17.5%
Communications	15.7%
Health Care	12.2%
Financials	8.6%
Materials	8.1%
Industrials	8.0%
Consumer Staples	2.7%
Energy	1.9%
Utilities	0.9%

Top 10 des émetteurs

Asurion LLC	1.3%
CSC Holdings LLC	0.9%
TransDigm Inc	0.9%
Verscend Holding Corp	0.8%
Bausch Health Americas Inc	0.7%
Harbor Freight Tools USA Inc	0.7%
athenahealth Inc	0.7%
Gainwell Acquisition Corp	0.6%
Peraton Corp	0.6%
Crown Finance US Inc	0.6%

Top 10 de la répartition géographique

US	91.2%
LU	3.1%
CA	1.3%
FR	0.6%
IE	0.6%
NL	0.5%
GB	0.4%
KY	0.3%
AU	0.3%
SE	0.3%

Répartition par échéances

<1 Y	0.2%
1-3 Y	10.9%
3-5 Y	35.9%
5-7 Y	50.8%
7-10 Y	2.1%

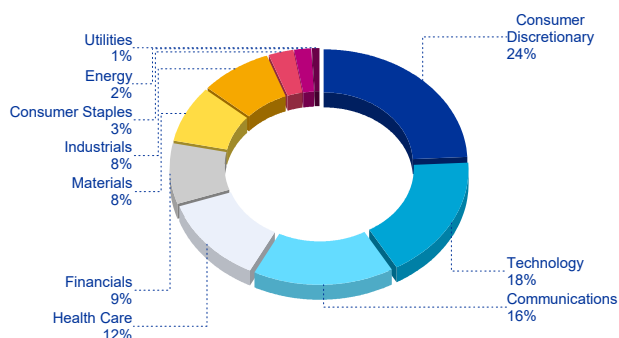
Répartition par notation

BBB	1.3%
BB	19.6%
B	69.0%
CCC	8.6%
D	0.1%
NR	1.5%

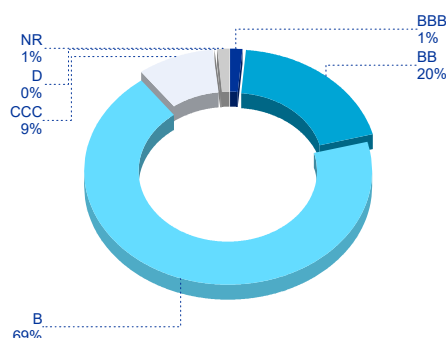
Répartition par devise

USD	100.0%
-----	--------

Top 10 des secteurs



Répartition par notation



Baloise Senior Secured Loan Fund (LU1548481263)

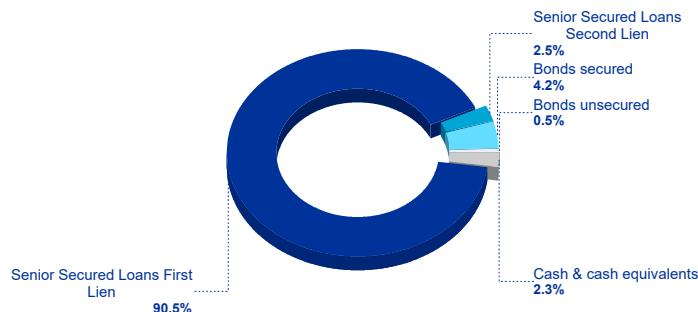
Classe de parts I-H CHF Cap

29.10.2021

Informations détaillées sur le portefeuille

Allocation d'actifs

Senior Secured Loans	93.0%
First Lien	90.5%
Second Lien	2.5%
Bonds	4.7%
Secured	4.2%
Unsecured	0.5%
Cash & cash equivalents	2.3%
Cash & cash equivalents	2.3%



Informations sur le fonds

Type de fonds:	Fonds de placement alternatif
Affectation du revenu:	Capitalisation
Monnaie de la classe de parts:	CHF
ISIN:	LU1548481263
Domicile:	Luxembourg
Calcul de la NAV:	mensuel
Date de souscription:	Dernier jour du mois
Date de remboursement:	Dernier jour du mois
Fin de la souscription / remboursement:	10 jo avant la date de souscription /20 jo avant la date de remboursement, 12h CET
Date de lancement:	28.02.2017
Date d'émission de la classe de p:	30.09.2017

Frais

Nombre d'émetteurs:	708	TER annuel escompté:	0.65
Spread moyenne pondérée supérieur au USD-LIBOR 3 mois:	365	Souscription minimale:	EUR 125'000
Durée résiduelle moyenne pondérée (années):	5.03		
Notation moyenne:	B		
Yield to Maturity:	3.96%		

Informations complémentaires

Gérant de fortune:	Baloise Asset Management Schweiz AG
Organe de révision:	Ernst & Young Luxembourg
Gestionnaire:	State Street Bank International GmbH, Luxembourg
Alternative Inv. Fund Manager:	Came Global Fund Managers Luxembourg S.A.
Dépositaire:	State Street Bank International GmbH, Luxembourg

Classes de parts disponibles

I-H CHF Cap (hedged in CHF)	LU1548481263
I USD Cap	LU1548481008
S USD Cap	LU2081271285
S-H CHF Cap (hedged in CHF)	LU2081270121

Prenez Contact avec nous

E-mail:	assetmanagement@baloise.com
Tél:	+41 58 285 72 99

Informations juridiques importantes

Ce document publicitaire a pour seul but d'informer. Il ne constitue ni une offre, ni une incitation à acheter ou à vendre des parts de fonds et ne doit pas non plus être considéré comme une incitation à soumettre une offre de conclusion d'un contrat portant sur un service de titres ou un service complémentaire. Il ne s'adresse explicitement pas aux personnes dont la nationalité ou domicile interdit l'accès à de telles informations en raison de la législation en vigueur. Il est interdit d'envoyer, d'emporter ou de distribuer le présent document ou toute copie de celui-ci aux États-Unis ou de le remettre à une personne américaine (au sens de la Régulation S de l'US Securities Act de 1933 dans sa version en vigueur). Ce document n'a pas vocation à remplacer un conseil personnalisé. Le prospectus du fonds ainsi que le rapport annuel actuel, constituent la seule base ayant un caractère obligatoire dans le cadre de l'acquisition de parts de fonds de placement. Le prospectus du fonds, les statuts ainsi que le rapport annuel peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant suisse, Acolin Fund Services AG, Leutschenbachstrasse 50, CH- 8050 Zurich, ainsi qu'auprès de l'autorité de paiement, State Street Bank International GmbH, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, CH-8027 Zurich ou de l'agent de distribution, Baloise Asset Management AG, Aeschengraben 21, CH- 4002 Bâle. Nous déclinons toute responsabilité concernant l'exactitude, l'exhaustivité ou l'actualité des informations contenues dans ce document. Baloise Alternative Invest S.A. SICAV-RAIF est un fonds «umbrella» de droit luxembourgeois pour investisseurs qualifiés au sens de l'art. 10 al. 3 et 3ème LPCC. Pour certains compartiments ou certaines classes de parts, le cercle des investisseurs peut être restreint davantage dans le contrat de fonds. Les évolutions de la valeur passées, les simulations et les pronostics ne constituent pas un indicateur fiable de l'évolution de la valeur future. L'évolution de la valeur passée indiquée ne tient pas compte des éventuels frais appliqués lors de la souscription ou du rachat de parts. Les commissions et frais ont un effet négatif sur la performance. Tout placement implique des risques, notamment des fluctuations de valeur et de rendement. Si la devise du produit financier ne devait pas concorder avec votre monnaie de référence, les fluctuations de change sont susceptibles d'en augmenter ou d'en diminuer le rendement. Les informations contenues dans ce document ne tiennent compte ni des objectifs de placement spécifiques ou futurs, ni de la situation fiscale ou financière, ni des besoins individuels du destinataire. Ce document est une traduction à titre d'information. Seul le texte allemand est contraignant.