

Basisinformationsblatt

Zweck

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die potenziellen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Produkt

Produktname/ISIN Twelve Capital UCITS ICAV - Twelve Cat Bond Fund - Anteilsklasse I-JSS Acc USD (das **Produkt**); ISIN IE00BD2B9488; in Anteilsklassenwährung USD
eine Anteilsklasse von Twelve Capital UCITS ICAV - Twelve Cat Bond Fund (der **Teilfonds**)
ein Teilfonds von Twelve Capital UCITS ICAV (der **Umbrella-Fonds** / die **Investmentgesellschaft**)

Das Produkt ist ein OGAW-Teilfonds mit Sitz in Irland. Er wird verwaltet von UBS Asset Management (Europe) S.A. (die **Verwaltungsgesellschaft**).

Produkthersteller **UBS Asset Management (Europe) S.A.**, 33A, avenue J.-F. Kennedy, L-1855 Luxemburg. Weitere Informationen erhalten Sie telefonisch unter +352 27 1511 oder auf der Website www.ubs.com/ame.

Zuständige Aufsichtsbehörde Zentralbank von Irland (die «CBI») ist für die Überwachung der UBS Asset Management (Europe) S.A. in Bezug auf dieses Basisinformationsblatt verantwortlich

Dieses Dokument wurde am 20. Mai 2026 erstellt.

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art: Dieses Produkt ist eine Investmentgesellschaft, die die Kriterien für OGAW-Teilfonds gemäss der OGAW-Richtlinie erfüllt.

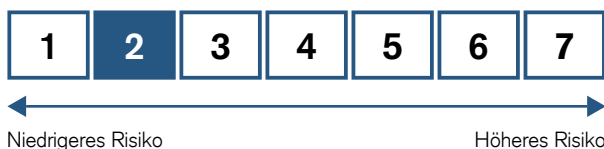
Laufzeit: Dieses Produkt hat kein Verfalldatum. Der Teilfonds wurde auf unbestimmte Zeit errichtet. Der Verwaltungsrat der Investmentgesellschaft ist einseitig dazu berechtigt, das Produkt jederzeit zu liquidieren, zu kombinieren oder neu zu positionieren, falls das Produkt nicht mehr im Sinne der Anleger verwaltet werden kann. Der Betrag, den der Anleger bei vorzeitiger Kündigung erhält, kann geringer sein als der investierte Betrag.

Ziele: Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und verfolgt das Ziel, durch mittel- bis langfristige Investition in Katastrophenanleihen (Cat Bonds) in beliebiger Währung Kapitalwachstum zu erzielen. Der Teilfonds fördert ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG-Kriterien) (im Sinne von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088) durch eine Kombination verschiedener Portfoliomanagement-Techniken. Einzelheiten hierzu finden sich im Prospekt und in den ESG-Offenlegungen des Teilfonds auf der Website. Das Teilfondsportfolio besteht aus Insurance-Linked Securities (ILS) oder Cat Bonds, denen bei Eintreten vorher festgelegter Versicherungsfälle wie Naturkatastrophen Kupon- und Kapitalverlust drohen. Diese Wertschriften werden in der Regel mit einem Kupon mit variablem Zinssatz strukturiert, wodurch der Anleger gegen schwankende Zinssätze abgesichert wird, können aber auch über eine Struktur mit festem Zinssatz oder Nullkupon verfügen. Cat Bonds werden entweder in Form von Special Purpose Vehicles (SPVs) zur Eliminierung von Gegenparteirisiken oder direkt von öffentlichen, privaten und halbprivaten Versicherungs- und Rückversicherungsgesellschaften, Regierungen, supranationalen Organisationen oder Kapitalgesellschaften emittiert. Der Teilfonds verwendet derivative Finanzinstrumente in Form von Devisentermingeschäften zur Absicherung gegen Währungsschwankungen. Diese Aktienklasse verzichtet auf Ausschüttungen. Der Teilfonds wird die Kosten für übliche Broker- und Bankgebühren tragen, die auf Wertpapiergeschäfte für das Portfolio zurückgehen.

Kleinanleger-Zielgruppe: Dieses Produkt richtet sich an Kleinanleger mit ausreichenden Kenntnissen und Erfahrungen in Bezug auf kollektive Kapitalanlagen und ähnliche Produkte, der Fähigkeit, einen geringfügigen Anlageverlust zu tragen, und einem langfristigen Anlagehorizont.

Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

(A) Gesamtrisikoindikator



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre halten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig auflösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen, und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück.

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln. Wir haben dieses Produkt als 2 von 7 eingestuft, eine niedrige Risikoklasse, und es ist äusserst unwahrscheinlich, dass ungünstige Marktbedingungen unsere Fähigkeit, Sie auszuzahlen, beeinträchtigen. **Beachten Sie das Währungsrisiko**, wenn Ihre Referenzwährung anders lautet als die Währung des Produkts. Sie erhalten unter Umständen Zahlungen in einer anderen Währung, sodass Ihre endgültige Rendite vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen wird. Anleger werden darauf hingewiesen, dass das Produkt weiteren Risiken ausgesetzt sein könnte, wie etwa operationellen, Gegenparte-, politischen, Nachhaltigkeits- und rechtlichen Risiken, die der Gesamtrisikoindikator nicht berücksichtigt. Das Produkt kann aufgrund versicherungsrelevanter Katastrophenereignisse oder anderer Ereignisse, darunter die ungewöhnliche Häufung unabhängiger Katastrophenereignisse, einen Teilverlust oder einen erheblichen Verlust erleiden. Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

(B) Performance-Szenarien

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Bei den angeführten Zahlen ist Ihre persönliche steuerliche Situation nicht berücksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel Sie zurückerhalten. **Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen.**

Das dargestellte pessimistische, mittlere und optimistische Szenario veranschaulichen die schlechteste, durchschnittliche und beste Wertentwicklung des Produkts / eines geeigneten Benchmarks in den letzten 10 Jahren. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln.

Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten.

| | | | |
|---|---|---|---------------------------|
| Empfohlene Haltedauer: | 5 Jahre | | |
| Anlagebeispiel: | USD 10.000 | | |
| Szenarien | Wenn Sie aussteigen nach 1 Jahr | Wenn Sie aussteigen nach 5 Jahren (Empfohlene Haltedauer) | |
| Stress-szenario | Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten Jährliche Durchschnittsrendite | USD 8.830 -11,7% | USD 8.463 -3,3% |
| Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage Twelwe Capital UCITS ICAV - Twelwe Cat Bond Fund I-JSS Acc USD zwischen 05.2025-05.2026. | | | |
| Pessimistisches Szenario | Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten Jährliche Durchschnittsrendite | USD 9.671 -3,3% | USD 11.021 2,0% |
| Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage Twelwe Capital UCITS ICAV - Twelwe Cat Bond Fund I-JSS Acc USD zwischen 12.2018-12.2023. | | | |
| Mittleres Szenario | Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten Jährliche Durchschnittsrendite | USD 10.534 5,3% | USD 13.018 5,4% |
| Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage Twelwe Capital UCITS ICAV - Twelwe Cat Bond Fund I-JSS Acc USD zwischen 04.2021-04.2026. | | | |
| Optimistisches Szenario | Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten Jährliche Durchschnittsrendite | USD 11.783 17,8% | USD 14.805 8,2% |

Was geschieht, wenn UBS Asset Management (Europe) S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Anlegern, die in dieses Produkt investiert haben, drohen bei einem Zahlungsausfall der UBS Asset Management (Europe) S.A. keine finanziellen Verluste, da der Teilfonds als eigenständiger Rechtsträger mit getrennt geführten Vermögenswerten betrachtet wird.

Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen, wie lange Sie das Produkt halten und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume.

Wir haben folgende Annahmen zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0% Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt
- USD 10.000 sind angelegt

| | Wenn Sie aussteigen nach 1 Jahr | Wenn Sie aussteigen nach 5 Jahren (Empfohlene Haltedauer) |
|--|--|---|
| Gesamtkosten | USD 124 | USD 617 |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten (*) | 1,2% | 1,2% |

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr 6,6% vor Kosten und 5,4% nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

| Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg | | Wenn Sie aussteigen nach 1 Jahr |
|--|---|---------------------------------|
| Einstiegskosten | 0,1% des Wertes Ihrer Anlage beim Einstieg. Darin enthalten sind Vertriebskosten in Höhe von 0,1% des investierten Betrags. | USD 5 |
| Ausstiegskosten | 0,0% des Werts Ihrer Anlage, bevor sie an Sie ausgezahlt wird. | USD 0 |
| Laufende Kosten pro Jahr | | |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 1,1% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. | USD 111 |
| Transaktionskosten | 0,1% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen. | USD 8 |
| Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen | | |
| Performance-Gebühren | Bei diesem Produkt fällt keine Performance-Gebühr an. | n/a |

Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre

Die empfohlene Haltedauer wird auf der Basis des oben dargestellten Gesamtrisikoidikators errechnet. Gemäss dem oben beschriebenen Anlageziel ist das Produkt auf einen langfristigen Anlagehorizont ausgelegt. Es handelt sich um ein offenes Produkt. Der Anleger kann die Anlage wöchentlich verkaufen. Auf Stufe des Produkts wird keine Rücknahmegebühr oder Vertragsstrafe fällig.

Wie kann ich mich beschweren?

Wenn Sie eine Beschwerde über das Produkt, den Hersteller des Produkts oder die Person, die Ihnen das Produkt empfohlen oder verkauft hat, haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Kundenberater oder kontaktieren Sie uns www.ubs.com/ame-regulatorydisclosures.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Dieses Basisinformationsblatt enthält nicht alle Informationen zu diesem Produkt. Weitere Informationen über den Twelve Capital UCITS ICAV, der Fondsprospekt und der aktuelle Jahres- und Halbjahresbericht sowie die aktuellen Produktpreise können kostenlos bezogen werden in englischer Sprache von UBS Asset Management (Europe) S.A., den zuständigen Vertriebsstellen oder online unter www.ubs.com/ame-funds. Dort finden Sie ebenfalls Informationen zur vergangenen Wertentwicklung aus den vergangenen 7 Jahren.

Monatlich aktualisierte Berechnungen früherer Performance-Szenarien finden Sie unter www.fundinfo.com.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stellen keine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf des Produkts dar und ersetzen keine individuelle Beratung durch die Bank oder den Berater des Anlegers. Die neueste Version dieses Basisinformationsblatts ist erhältlich unter:

www.ubs.com/ame-funds.

Die Depotstelle dieses Produkts ist: UBS Europe SE, Ireland Branch, Dublin