

NOTICE D'INFORMATION

Cat Bond « Hexagon II Reinsurance DAC »

Emetteur	Hexagon II Reinsurance DAC, un véhicule de titrisation de droit Irlandais
Cédantes	Collectivement MMA IARD SA, MAAF ASSURANCES SA et GMF ASSURANCES pour leur compte propre, et au nom ou pour le compte d'autres entités au sein du groupe Covéa
Catégorie de titre	Titres assurantiels, Billets à taux variable et à capital à risque, relevant de l'article 144A du US Securities Act, vendus exclusivement à des investisseurs institutionnels qualifiés / acheteurs qualifiés dans les juridictions autorisées aux États-Unis et hors des États Unis
Date d'émission	5 novembre 2019
Période de couverture des risques	Du 1 ^{er} Janvier 2020 au 31 Décembre 2023
Date de remboursement programmée	17 janvier 2024
Période d'extension	Extension possible à intervalles de 3 mois pour 36 mois
Date de remboursement final avec extension	15 janvier 2027
Type de couverture	Pertes définitives par événement
Risques couverts	Tempête de vent et autres événements
Zones couvertes	France (à l'exclusion des Départements, Régions et Collectivités d'Outre Mer), Monaco et Andorre
Nantissement	Billets émis par la banque européenne pour la reconstruction et le développement initialement, fonds monétaires ou liquidités si certains événements se produisent
Structure des coupons	Somme du rendement des investissements admis et de la marge d'intérêts ou d'extension
Teneurs de livres	Willis Re Securities, Natixis
Listing	Bermuda Stock Exchange
DÉTAILS DES OBLIGATIONS	CLASSE UNIQUE
Montant original du principal	120 000 000 EUR
Marge initiale de taux d'intérêt	5,15 %
Niveau de franchise initiale du réassureur	300 000 000 EUR
Niveau du plafond initial du réassureur	600 000 000 EUR
Probabilité initiale modélisée de franchise	5,90 %
Probabilité initiale modélisée de perte	3,65 %
Probabilité initiale modélisée de plafond	2,40 %
ISIN	XS2066695433