

An die Anleger der Credit Suisse Anlagestiftung
CSA Insurance Linked Strategies / CSA Insurance
Linked Strategies Fixed

3. November 2022

Deponentenschreiben

Bildung neuer Side Pocket Anlagegruppen – CSA ILS Side Pocket 2 / CSA ILS Fixed Side Pocket 2

Sehr geehrte Damen und Herren

Ende September 2022 hat Hurrikan Ian zu schweren Schäden in den USA geführt. Der Wirbelsturm ist am 28. September 2022 an der Westküste Floridas in der Nähe von Cape Coral und Fort Myers als Hurrikan der Kategorie 4 zum ersten Mal auf US-Festland getroffen. Mit Windgeschwindigkeiten von bis zu 240 km/h, Sturmfluten und heftigen Niederschlägen hat Hurrikan Ian zu schweren Sachschäden in den betroffenen Gebieten geführt. Der Wirbelsturm bewegte sich weiter durch den Bundesstaat Florida in Richtung Nordosten zum Atlantischen Ozean, wo dieser am 30. September 2022 in South Carolina in der Nähe von Georgetown als Hurrikan der Kategorie 1 ein zweites Mal aufs Festland getroffen ist. Die Unsicherheit bezüglich der Summe an versicherten Schäden ist nach wie vor sehr hoch. Auch einige Positionen in den Anlagegruppen CSA ILS und CSA ILS Fixed werden möglicherweise von diesen Schäden betroffen sein.

Aufgrund dieser aktuell bestehenden Unsicherheit ist der Marktwert einiger Positionen in den Anlagegruppen CSA ILS / CSA ILS Fixed nicht mehr eindeutig bestimmbar (Bewertungsunsicherheit). Die Geschäftsführung hat daher gemeinsam mit dem Portfolio Manager des Zielfonds und im Einvernehmen mit der OAK BV beschlossen zwei neue Side Pocket Anlagegruppen zu bilden, um die betroffenen Positionen auszulagern.

Geschätztes Volumen der Side Pocket:

ca. 23% des Anlagevolumens der
CSA ILS / CSA ILS Fixed

Abschlussdatum Umtausch:

30. September 2022

Buchungsdatum:

voraussichtlich zweite Hälfte November 2022

Für jeden Investor, der am 30. September 2022 Ansprüche der Anlagegruppen CSA ILS / CSA ILS Fixed hielt, wird im Verhältnis zur Grösse der gebildeten Side Pocket ein Teil der Ansprüche an der CSA ILS / CSA ILS Fixed automatisch in Ansprüche an der CSA ILS / CSA ILS Fixed Side Pocket 2 umgetauscht.

Entsprechend wird ca. 23% Ihres Anlagevolumens der CSA ILS / CSA ILS Fixed in Ansprüche an der neuen Side Pocket Anlagegruppe CSA ILS / CSA ILS Fixed Side Pocket 2 umgetauscht. Über den erfolgten Umtausch werden Sie mittels Abrechnung informiert.

Die Ausgabe von Ansprüchen an den Side Pocket Anlagegruppen erfolgt in verschiedenen Klassen:

- **CSA ILS Side Pocket 2, Klassen A, L, L2 und L3:**
Diese Klassen umfassen Investoren, die weiterhin Ansprüche an der CSA ILS in der jeweiligen Klasse halten. Bei (Teil-) Auflösungen der Side Pocket erfolgt eine Rückführung in die Anlagegruppe CSA ILS (Klasse analog zu bestehender Anlage).
- **CSA ILS Side Pocket 2, Klasse FR:**
Diese Klasse umfasst Investoren, die zum Zeitpunkt der Bildung der Side Pocket Anlagegruppe ihre gesamten Ansprüche an der CSA ILS zur Rückgabe angemeldet haben. Bei (Teil-) Auflösungen der Side Pocket erfolgt die Auszahlung der Ansprüche in bar.
- **CSA ILS Fixed Side Pocket 2, Klassen A und L4:**
Diese Klassen umfassen Investoren, die weiterhin Ansprüche an der CSA ILS Fixed in der jeweiligen Klasse halten. Bei (Teil-) Auflösungen der Side Pocket erfolgt eine Rückführung in die Anlagegruppe CSA ILS Fixed (Klasse analog zu bestehender Anlage).
- **CSA ILS Fixed Side Pocket 2, Klasse FR:**
Diese Klasse umfasst Investoren, die zum Zeitpunkt der Bildung der Side Pocket Anlagegruppe ihre gesamten Ansprüche an der CSA ILS Fixed zur Rückgabe angemeldet haben. Bei (Teil-) Auflösungen der Side Pocket erfolgt die Auszahlung der Ansprüche in bar.

Bitte beachten Sie, dass bereits angemeldete Rückgaben aufgrund dieses Ereignisses allenfalls gekürzt werden müssen. Betroffene Anleger werden zeitnah separat informiert.

Die Ansprüche an Side Pocket Anlagegruppen können nicht zur Rückgabe angemeldet werden. Sobald sich die Bewertungsunsicherheit der zugrunde liegenden Instrumente innerhalb der Side Pocket Anlagegruppen reduziert, werden die Side Pocket Anlagegruppen schrittweise oder auf einmal aufgelöst. Sobald eine (Teil-) Auflösung möglich ist, werden wir Sie selbstverständlich informieren.

Für Rückfragen steht Ihnen Ihr Relationship Manager oder die Geschäftsführung der CSA (csa.info@credit-suisse.com) gerne zur Verfügung.

Freundliche Grüsse

CREDIT SUISSE ANLAGESTIFTUNG