

Aux investisseurs de Credit Suisse Fondation de placement CSF Insurance Linked Strategies / CSF Insurance Linked Strategies Fixed

3 novembre 2022

**Lettre aux déposants**  
**Constitution des nouveaux groupes de placement side pocket –**  
**CSF ILS Side Pocket 2 / CSF ILS Fixed Side Pocket 2**

Madame, Monsieur,

Fin septembre 2022, l'ouragan Ian a causé des graves dégâts aux États-Unis. Le cyclone est passé en catégorie 4 avant de frapper le continent américain sur la côte ouest de la Floride le 28 septembre 2022, près de Cape Coral et de Fort Myers. Avec des vents pouvant atteindre 240 km/h, des ondes de tempête et des pluies violentes, l'ouragan Ian a causé de graves dégâts matériels dans les zones touchées. L'ouragan a continué à traverser l'État de Floride vers le nord-est de l'océan Atlantique, où il a de nouveau frappé la terre ferme le 30 septembre 2022 en Caroline du Sud, près de Georgetown, après être repassé en catégorie 1. L'incertitude reste très élevée quant au montant des dommages assurés. Certaines positions dans le groupe de placement CSF ILS et CSF ILS Fixed pourraient également être concernées par ces dommages.

En raison de cette incertitude actuelle la valeur de marché de quelques positions des groupes de placement CSF ILS et CSF ILS Fixed n'est plus clairement déterminable (incertitude d'évaluation). La gérance a donc décidé, en concertation avec le gestionnaire de portefeuille du fonds cible et en accord avec la CHS PP, de créer deux nouveaux groupes de placement side pocket afin d'y transférer les positions concernées.

<b>Volume estimé du side pocket:</b>	environ 23% du volume de placement de CSF ILS / CSF ILS Fixed
<b>Date de clôture de l'échange:</b>	30 septembre 2022
<b>Date comptable:</b>	attendue deuxième moitié novembre 2022

Pour chaque investisseur ayant détenu des droits des groupes de placement CSF ILS / CSF ILS Fixed au 30 septembre 2022, une partie des droits CSF ILS / CSF ILS Fixed proportionnelle à la taille de la side pocket formée est automatiquement échangée contre des droits CSF ILS / CSF ILS Fixed Side Pocket 2. En conséquence, environ 23% de votre volume de placement de CSF ILS / CSF ILS Fixed sont échangés contre des droits du nouveau groupe de placement side pocket CSF ILS / CSF ILS Fixed Side Pocket 2. Vous serez informé de l'échange effectué au moyen d'un décompte.

L'émission de droits des groupes de placement side pocket s'effectue en tranches différentes :

- **CSF ILS Side Pocket 2, classes A, L, L2 et L3:**  
Ces classes englobent les investisseurs qui continuent de détenir des droits dans le groupe de placement CSF ILS dans la classe respective. Une dissolution (partielle) de la side pocket entraîne un rapatriement dans le groupe de placement CSF ILS (classe analogue à la classe existante).
- **CSF ILS Side Pocket 2, classe FR:**  
Cette classe englobe les investisseurs qui ont demandé la restitution de l'ensemble de leurs droits de CSF ILS lors de la constitution du groupe de placement side pocket. En cas de dissolution (partielle) de la side pocket, les droits sont payés en espèces.
- **CSF ILS Fixed Side Pocket 2, classes A et L4:**  
Ces classes englobent les investisseurs qui continuent de détenir des droits dans le groupe de placement CSF ILS Fixed dans la classe respective. Une dissolution (partielle) de la side pocket entraîne un rapatriement dans le groupe de placement CSF ILS Fixed (classe analogue à la classe existante).
- **CSF ILS Fixed Side Pocket 2, classe FR:**  
Cette classe englobe les investisseurs qui ont demandé la restitution de l'ensemble de leurs droits de CSF ILS Fixed lors de la constitution du groupe de placement side pocket. En cas de dissolution (partielle) de la side pocket, les droits sont payés en espèces.

Veuillez noter que les rachats déjà demandés devront éventuellement être réduits en raison de cet événement. Les investisseurs concernés seront informés séparément en temps voulu.

Les droits dans les groupes de placement side pocket ne peuvent être demandés au rachat. Dès que l'incertitude d'évaluation des instruments sous-jacents diminue au sein de la side pocket, les groupes de placement side pocket seront liquidés par étapes ou une seule fois. Nous vous informerons naturellement dès qu'une nouvelle liquidation (partielle) sera possible.

Pour toute question, veuillez contacter votre Relationship Manager ou la gérance de CSF ([csa.info@credit-suisse.com](mailto:csa.info@credit-suisse.com)).

Veuillez agréer, Madame, Monsieur, nos salutations distinguées.

CREDIT SUISSE FONDATION DE PLACEMENT