

Dies ist eine Marketingmitteilung.
Bitte lesen Sie den Prospekt bzw. die Produktinformation zum Fonds sowie das KIID/KID sorgfältig durch, bevor Sie Ihre endgültige Anlageentscheidung treffen.

31. August 2022

Deutschland

Risikoprofil (SRRI) ¹⁾

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund

ein Subfonds des CS Investment Funds 4 - Klasse EBH GBP

Anlagepolitik

Der Credit Suisse (Lux) Cat Bond Fund ist ein aktiv verwalteter OGAW-Fonds, der in ein diversifiziertes Portfolio von Katastrophenanleihen («Cat Bonds») anlegt. Cat Bonds sind Finanzwerte, die das Versicherungsrisiko auf die Kapitalmärkte übertragen. Der in solche Wertpapiere investierte Anleger erhält einen Coupon, der aus einer variablen Geldmarktkomponente und einer Versicherungsprämie besteht. Die Prämie entschädigt den Anleger für das Risiko eines Teil- oder Totalverlusts des Kapitals infolge aussergewöhnlicher vordefinierter Ereignisse wie z. B. einem Erdbeben oder einem Hurrikan. Der Fonds strebt eine geringe Korrelation mit traditionellen Anlageklassen wie Obligationen und Aktien an. Die Long-only-Strategie des Fonds besteht bereits seit Februar 2016. Derivative Finanzinstrumente werden ausschliesslich zu Absicherungszwecken eingesetzt. Der Fonds investiert nicht in Instrumente, die an Lebensversicherungen gekoppelt sind.

Die Wertentwicklung vom 16.2.2016 bis 18.1.2021 ergibt sich aus der historischen Wertentwicklung von Lombard Odier Funds – Cat Bonds, einem OGAW, der per 18.1.2021 mit dem Fonds zusammengelegt wurde (die «Zusammenlegung»). Es ist keine wesentliche Änderung der Anlagepolitik infolge der Zusammenlegung erfolgt.

Fondsdaten

Fondsmanager	Marc Brogli, Gregor Gawron
Fondsmanager seit	18.01.2021
Standort Fondsmanager	Zürich
Fondsleitung	Credit Suisse Fund Management S.A.
Fondsdomizil	Luxemburg
Fondswährung	USD
OGAW-V-fähig	Ja
Ende des Geschäftsjahres	30. November
Fondsvermögen (in Mio.)	66,83
Emissionsdatum	18.01.2021
Managementgebühr p.a. ²⁾	0,80%
Laufende Kosten ²⁾	1,23%
Zeichnung / Rücknahme	Wöchentlich
Benchmark (BM)	No Benchmark
Swinging single pricing (SSP) ⁵⁾	Ja
Anlageklasse	Tranche EBH (thesaurierend)
Währung der Anteilklasse	GBP
ISIN	LU2250179483
Bloomberg Ticker	CRLCBEG LX
WKN	A2QJH8
Nettoinventarwert	11,21

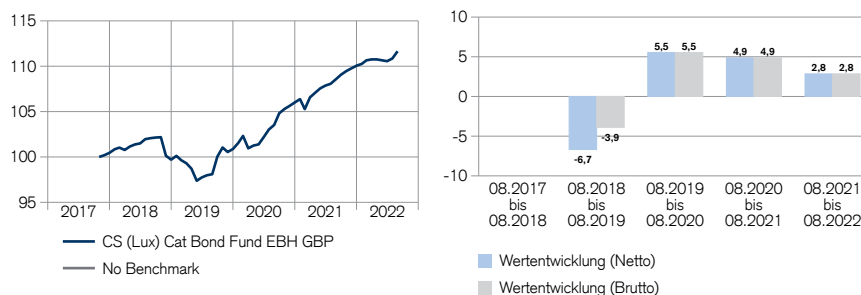
Retail-Verkaufsregistrierung:

Australien, Deutschland, Frankreich, Großbritannien, Liechtenstein, Luxemburg, Niederlande, Österreich, Schweiz, Singapur, Spanien

⁵⁾ Weitere Einzelheiten sind dem entsprechenden Abschnitt «Nettovermögenswert» im Fondsprospekt zu entnehmen.

Bruttowertentwicklung in GBP (zurückgesetzt auf Basis 100) und Wertentwicklung in %

Die historische Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Rendite. Weder die simulierte noch die historische Wertentwicklung ist ein zuverlässiger Indikator für aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung.



Bruttowertentwicklung: Wertentwicklung unter Berücksichtigung der auf Fondsebene anfallenden Kosten.

Nettowertentwicklung: Neben den auf Fondsebene anfallenden Kosten wird auch der maximale Ausgabeaufschlag in Höhe von 3,00% berücksichtigt. Depotführungsgebühren sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und würden sich bei Berücksichtigung negativ auf die Wertentwicklung auswirken.

Bruttowertentwicklung in GBP unter Berücksichtigung interner Kosten

	1 Monat	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	3 Jahre % p.a.	5 Jahre % p.a.	ITD
Fonds	0,72	0,90	1,45	2,84	13,81	-	4,40	-	12,10

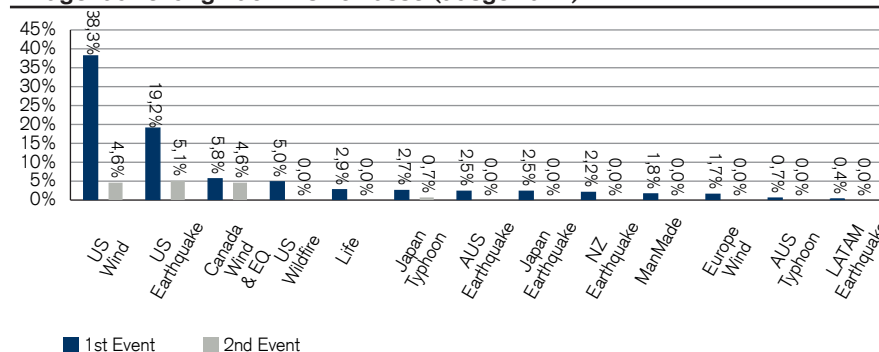
Kennzahlen

Rendite auf Verfall in %	9,90
Anzahl Positionen ³⁾	69
Grösste Position in % des NAV	4,6
95%-Quantil (VaR)	-7,29%
99%-Quantil (VaR)	-41,99%
Erwarteter Jahresverlust	2,64%

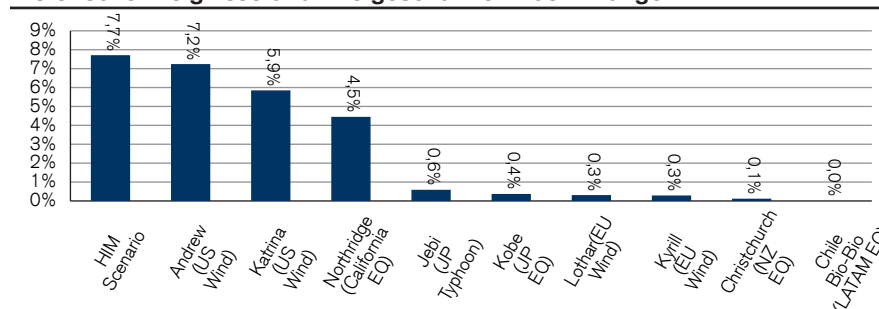
Fondsstatistik

	1 Jahr	3 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	0,82	2,01
Maximaler Verlust in %	-0,18	-1,33
Sharpe Ratio	2,41	1,90
Erholungsphase (in Monaten)	1	4

Anlagenaufteilung nach Risikoklasse (ausgewählt) ⁴⁾



Historische Ereignisse und ihre geschätzten Auswirkungen ⁴⁾



¹⁾ Das Rendite-Risiko-Profil des Fonds zeigt die Wertschwankungen, die eine Anlage im Fonds in den letzten fünf Jahren verzeichnet hätte, wobei simulierte Performancedaten verwendet wurden, wenn keine historische Daten vorlagen. Die Risikoeinstufung des Fonds kann sich zukünftig ändern. Bitte beachten Sie, dass mögliche höhere Gewinne in der Regel auch mögliche höhere Verluste bedeuten. Die tiefste Risikokategorie bedeutet nicht, dass der Fonds risikofrei ist.

²⁾ Wenn die Währung eines Finanzprodukts und/oder dessen Kosten von Ihrer Referenzwährung abweichen, können die Rendite und die Kosten aufgrund von Währungsschwankungen steigen oder sinken.

³⁾ Positionen mit aktivem Engagement in neue versicherte Ereignisse.

⁴⁾ Dies ist eine indikative Asset Allocation, die sich im Laufe der Zeit ändern kann. Die Verluste stellen Näherungswerte dar und dienen somit nur der Anschaulichkeit. 2 Tatsächliche Verluste können erheblich von oben genannten Zahlen abweichen.

Mögliche Risiken

Das Risiko- und Ertragsprofil des Fonds widerspiegelt nicht das Risiko unter zukünftigen Bedingungen, die von der Situation in der Vergangenheit abweichen. Dies gilt auch für folgende Ereignisse, die zwar selten auftreten, jedoch große Auswirkungen haben können.

- **Kreditrisiko:** Emittenten von vom Fonds gehaltenen Vermögenswerten zahlen unter Umständen keine Zinsen oder zahlen bei Fälligkeit Kapital nicht zurück. Die Anlagen des Fonds haben in der Regel ein geringes Kreditrisiko.
- **Liquiditätsrisiko:** Vermögenswerte können nicht zwangsläufig innerhalb eines angemessenen Zeitrahmens zu begrenzten Kosten verkauft werden. Die Anlagen des Fonds könnten eine eingeschränkte Liquidität aufweisen. Der Fonds wird dieses Risiko durch diverse Massnahmen abzuschwächen versuchen.
- **Gegenparteiisiko:** Der Konkurs oder die Insolvenz der Derivat-Gegenparteien des Fonds können zu einem Zahlungs- oder Lieferausfall führen. Der Subfonds wird dieses Risiko durch Entgegennahme von Finanzinstrumenten, die als Garantien gegeben werden, abzuschwächen versuchen.
- **Ereignisrisiko:** Sollte ein Trigger-Ereignis eintreten, wird das bedingte Kapital in Eigenkapital umgewandelt oder abgeschrieben, was zu einem erheblichen Wertverlust führen kann.
- **Operationelles Risiko:** Fehlerhafte Prozesse, technische Fehler oder Katastrophen können zu Verlusten führen.
- **Politische und rechtliche Risiken:** Anlagen unterliegen Änderungen von Vorschriften und Standards, die in einem bestimmten Land gelten. Dies umfasst Einschränkungen der Währungskonvertibilität, die Erhebung von Steuern oder Transaktionskontrollen, Beschränkungen bei Eigentumsrechten oder andere rechtliche Risiken.
- **Nachhaltigkeitsrisiken:** Nachhaltigkeitsrisiken umfassen ökologische, soziale oder Governance-bezogene Ereignisse oder Bedingungen, die sich in Abhängigkeit vom jeweiligen Sektor-, Branchen- und Unternehmensengagement in erheblichem Masse nachteilig auf die Rendite auswirken können.

Risikozahlen wie «erwarteter Verlust», «95%-Perzentil (jährlicher VaR)» und «99%-Perzentil (jährlicher VaR)» beruhen auf tatsächlichen Portfoliodaten. Diese Zahlen werden mithilfe des Katastrophenrisikomodells von Applied Insurance Research modelliert und unterliegen daher Modellierungsunsicherheiten und Änderungen der Risikoübernahme im Laufe der Zeit. Das Risikomodell verwendet Monte-Carlo-Simulationen zur Simulation von 10'000 Ereignisjahren und schätzt die potenziellen Auswirkungen von Katastrophenereignissen auf das Portfolio in all diesen Jahren ein. Als Ergebnis erhält man die sogenannte «Überschreitungskurve», aus der CSILS (wie unten beschrieben) die dargestellten Risikozahlen ableitet. Andere Risikoanalysezahlen, darunter das «Exposure nach Höhe der Branchenschäden» und die «Auswirkungen eines historischen Ereignisses», werden von diesem Modell und den CSILS-Annahmen abgeleitet. Die Werte in der Abbildung «Anlagenaufteilung nach Risikoklasse» repräsentieren das auf ein Konfidenzintervall von 99,8 % kalibrierte «extreme Ergebnis» (d. h., es schliesst höchst unwahrscheinliche Ergebnisse mit einer Wahrscheinlichkeit von unter 0,2 % aus). Im Allgemeinen unterliegen diese Risikoanalysezahlen auch Modellierungsunsicherheiten und Änderungen der Risikoübernahme im Laufe der Zeit.

Sämtliche Angebotsunterlagen einschliesslich der vollständigen Risikohinweise sind kostenlos bei einem Credit Suisse Kundenberater oder gegebenenfalls über FundSearch (credit-suisse.com/fundsearch) erhältlich.

Datenquellen ab 31. August 2022: Credit Suisse, sofern nicht anders angegeben.

Wichtige Hinweise

Dieses Material stellt Marketingmaterial der Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundener Unternehmen (nachfolgend «CS» genannt) dar.

Dieses Material stellt weder ein Angebot oder eine Aufforderung zur Emission oder zum Verkauf noch einen Bestandteil eines Angebots oder einer Aufforderung zur Zeichnung oder zum Kauf von Wertpapieren oder anderen Finanzinstrumenten oder zum Abschluss einer anderen Finanztransaktion dar. Ebenso wenig stellt es eine Aufforderung oder Empfehlung zur Partizipation an einem Produkt, einem Angebot oder einer Anlage dar.

Diese Marketingmitteilung stellt kein rechtsverbindliches Dokument und keine gesetzlich vorgeschriebene Produktinformation dar.

Dieses Material stellt in keiner Weise ein Anlageresearch oder eine Anlageberatung dar und darf nicht für Anlageentscheidungen herangezogen werden. Es berücksichtigt weder Ihre persönlichen Umstände noch stellt es eine persönliche Empfehlung dar, und die enthaltenen Informationen sind nicht ausreichend für eine Anlageentscheidung.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen repräsentieren die Sicht der CS zum Zeitpunkt der Erstellung und können sich jederzeit und ohne Mitteilung ändern. Sie stammen aus Quellen, die für zuverlässig erachtet werden.

Die CS gibt keine Gewähr hinsichtlich des Inhalts und der Vollständigkeit der Informationen und lehnt, sofern rechtlich möglich, jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung der Informationen ergeben. Ist nichts anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Die Informationen in diesem Dokument dienen der ausschliesslichen Nutzung durch den Empfänger.

Die Angaben in diesem Material können sich nach dem Datum der Veröffentlichung dieses Materials ohne Ankündigung ändern, und die CS ist nicht verpflichtet, die Angaben zu aktualisieren.

Dieses Material kann Angaben enthalten, die lizenziert und/oder durch geistige Eigentumsrechte der Lizenzinhaber und Schutzrechtsinhaber geschützt sind. Nichts in diesem Material ist dahingehend auszulegen, dass die Lizenzinhaber oder Schutzrechtsinhaber eine Haftung übernehmen. Das unerlaubte Kopieren von Informationen der Lizenzinhaber oder Schutzrechtsinhaber ist strengstens untersagt.

Sämtliche Angebotsunterlagen, das heisst der Prospekt oder Platzierungsprospekt, das Key Investor Information Document (KIID), das Key Information Document (KID), die Vertragsbedingungen der Fonds sowie die Jahres- und Halbjahresberichte («die vollständigen Angebotsunterlagen») sind, soweit verfügbar, kostenlos bei der/den unten aufgeführten juristischen Person/-en in einer der jeweils unten genannten Sprachen und gegebenenfalls über FundSearch (amfunds.credit-suisse.com/global/de) erhältlich.

Angaben zu Ihren örtlichen Vertriebsstellen, Vertretungen, Informationsstellen, gegebenenfalls Zahlstellen sowie zu Ihren örtlichen Ansprechpartnern für das/die Anlageprodukt(e) sind unten aufgeführt.

Die einzigen rechtsverbindlichen Bedingungen der in diesem Material beschriebenen Anlageprodukte, einschliesslich der Risikoerwägungen, Ziele, Gebühren und Auslagen, sind im Verkaufsprospekt, dem Platzierungsprospekt, den Zeichnungsdokumenten, dem Fondsvertrag und/oder anderen für den Fonds massgeblichen Dokumenten festgelegt.

Die vollständige Darstellung der Eigenschaften von in diesem Material genannten Produkten sowie die vollständige Darstellung der mit den jeweiligen Produkten verbundenen Chancen, Risiken und Kosten entnehmen Sie bitte den jeweils zugrunde liegenden Wertpapierprospekten, Verkaufsprospekten oder sonstigen weiterführenden Produktunterlagen, welche wir Ihnen auf Nachfrage jederzeit gerne zur Verfügung stellen.

Bei der in dieser Marketingmitteilung beworbenen Anlage handelt es sich um den Erwerb von Fondsaktien oder -anteilen und nicht um den Erwerb von zugrunde liegenden Vermögenswerten. Die zugrunde liegenden Vermögenswerte sind ausschliessliches Eigentum des Fonds.

Dieses Material darf nicht an Dritte weitergegeben oder verbreitet und vervielfältigt werden. Jegliche Weitergabe, Verbreitung oder Vervielfältigung ist unzulässig und kann einen Verstoß gegen den Securities Act der Vereinigten Staaten von 1933 in seiner jeweiligen Fassung (der «Securities Act») bedeuten. Die hierin genannten Wertpapiere wurden oder werden nach dem Securities Act oder den Wertpapiergesetzen von US-Bundesstaaten nicht registriert, und mit gewissen Ausnahmen dürfen sie weder in den Vereinigten Staaten noch für Rechnung oder zugunsten von US-Personen angeboten, verpfändet, verkauft oder anderweitig übertragen werden.

Zudem können im Hinblick auf das Investment Interessenkonflikte bestehen.

In Zusammenhang mit der Erbringung von Dienstleistungen bezahlt die Credit Suisse AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen unter Umständen Dritten oder erhält von Dritten als Teil ihres Entgelts oder in anderer Weise eine einmalige oder wiederkehrende Vergütung (z.B. Ausgabeaufschläge, Platzierungsprovisionen oder Vertriebsfolgeprovisionen).

Potenzielle Anleger sollten (mit ihren Steuer-, Rechts- und Finanzberatern) selbstständig und sorgfältig die in den verfügbaren Materialien beschriebenen spezifischen Risiken und die geltenden rechtlichen, regulatorischen, kreditspezifischen, steuerlichen und buchhalterischen Konsequenzen prüfen, bevor sie eine Anlageentscheidung treffen.

Der Manager des alternativen Investmentfonds bzw. die (OGAW-)Verwaltungsgesellschaft kann beschliessen, lokale Vereinbarungen zur Vermarktung von Fondsaktien bzw. -anteilen zu kündigen, einschließlich Registrierungen zu widerrufen oder den Versand von Mitteilungen an die lokale Aufsichtsbehörde einzustellen. Eine deutsch- und englischsprachige Zusammenfassung der Anlegerrechte betreffend Anlagen in im Europäischen Wirtschaftsraum (EWR) domizilierten Investmentfonds, welche von Credit Suisse Asset Management verwaltet oder finanziert werden, ist erhältlich unter www.credit-suisse.com/am/regulatory-information.

Im Zusammenhang mit Anlegerrechten können auch lokale Gesetze anwendbar sein.

Copyright © 2022 Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.

Deutschland: Zahlstelle: Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., 5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg

Informationsstelle, Vertriebsstelle, falls dieses Dokument vertrieben wird durch: Credit Suisse (Deutschland) AG, Taunustor 1, D-60310 Frankfurt am Main

* Rechtseinheit, von der die vollständigen Angebotsunterlagen, die wesentlichen Informationen für den Anleger (Key Investor Information Document, KIID), die Fondsreglemente sowie die Jahres- und Halbjahresberichte der Fonds, soweit einschlägig, kostenlos bezogen werden können.