

SAGESSE RETRAITE SANTE

OBJET : circularisation valorisée de vos opérations de marché.

Madame, Monsieur,

Nous vous prions de bien vouloir trouver ci-joint la liste de vos opérations portant sur des instruments financiers en cours et valorisées au 30/06/2025.

La valorisation de ces opérations est fournie à titre d'information. Elle est réalisée à partir de sources considérées comme étant fiables, sur la base des dernières opérations connues, à des conditions de marché.

La valorisation d'une opération ne correspond pas au prix auquel une transaction identique pourrait être conclue dans la mesure où elle ne reflète pas les autres facteurs déterminés pour une cotation, tels que les coûts de couverture, le risque de crédit, la liquidité du marché ou tout autre paramètre déterminant la cotation au moment de la traiter.

Malgré toutes les précautions prises pour la réaliser, cette valorisation peut être incomplète, inexacte et varier en fonction des conditions de marché ; elle ne doit pas être considérée comme une offre, une sollicitation ou une recommandation de vente ou d'achat.

Un changement dans les paramètres peut avoir un impact sur la valorisation et les performances constatées dans le passé ne peuvent présumer de celles à venir. Les méthodes de valorisation utilisées peuvent être sujettes à des changements sans information préalable.

Conformément à la réglementation EMIR, nous devons rapprocher le stock d'opérations dérivées parmi l'ensemble des opérations conclues entre nous.

À cet effet, si vous avez opté pour une réconciliation effectuée sur la base du portefeuille envoyé par CIC MARKET SOLUTIONS, le présent document de circularisation est utilisé pour effectuer ce rapprochement.

Dans l'hypothèse où vous constateriez une erreur, une omission ou une anomalie dans les données contenues dans ce document (les « Données de Portefeuilles »), nous vous remercions de bien vouloir nous en faire part dans les plus brefs délais, en contactant l'équipe « Pôle Service Clientèle » à l'une des adresses ci-dessous :

adresse mail : PSC@CIC.FR

adresse postale : Crédit Industriel et Commercial
CIC MARKET SOLUTIONS - SDM Pôle Service Clientèle
6 avenue de Provence
75009 PARIS

En l'absence de retour de votre part, les « Données de Portefeuilles » relatives aux opérations dérivées seront considérées comme acceptées par vous.

Nous vous prions d'agréer, Madame, Monsieur, nos salutations distinguées.

document informatique ne requérant pas
de signature de la part de l'émetteur

SAGESSE RETRAITE SANTE

Instrument : CAP/FLOOR											
Opération	Date Opération	Date Valeur	Date Maturité	Description Opération	Devise	Nominal	Prix Exercice	Index	Valeur de Marché EUR		
830207P	02/04/2025	30/09/2026	30/09/2028	Achat FLOOR Plain Vanilla	EUR	12 500 000,00	0,00	EUR3M 3M	5 409,37		
542051P	25/01/2022	31/01/2022	30/09/2026	Achat CAP Plain Vanilla	EUR	12 500 000,00	1,00	EUR3M 3M	93 437,36		
Total EUR									98 846,73		

Instrument : COLLAR											
Opération	Date Opération	Date Valeur	Date Maturité	Description Opération	Devise	Nominal	Prix Exercice	CAP Index	Prix Exercice	FLOOR Index	Valeur de Marché EUR
830224P	02/04/2025	30/09/2026	30/09/2028	Achat COLLAR Plain Vanilla	EUR	12 500 000,00	3,00	EUR3M 3M	1,85	EUR3M 3M	- 46 096,24
Total EUR										- 46 096,24	

Instrument : SWAP DE TAUX											
Opération	Date Opération	Date Valeur	Date Maturité	Description Opération	Devise	Nominal	Taux payeur	Taux receveur	Valeur de Marché EUR		
713263P	07/12/2023	01/11/2023	01/11/2027	Swap Payeur Taux Fixe	EUR	7 658 468,00	2,699	EUR3M 3M	- 131 764,39		
Total EUR									- 131 764,39		

NB : cet état est donné dans le sens Client