CREDIT SUISSE (DEUTSCHLAND) AG

Taunustor 1
60310 Frankfurt am Main
Deutschland

News

Credit Suisse legt innovativen Multi-Faktor-Indexfonds auf

Frankfurt am Main 27. September 2018 – **Credit Suisse Asset Management, ein globaler Vorreiter im Bereich der Indexreplikation, hat mit dem CSIF (Lux) Equity EURO STOXX Multi Premia einen UCITS-konformen Indexfonds im Multi-Faktor-Segment lanciert. Index Solutions, ein spezialisierter Bereich des Credit Suisse Asset Management, repliziert den EURO STOXX® Multi Premia® Index, der sieben verschiedene Renditequellen kombiniert. Die Methodologie wurde von Finreon, einem Spin-Off der Universität St. Gallen, Schweiz (HSG), entwickelt.**

«Die transparente Konstruktion und die finanzwissenschaftliche Basis des EURO STOXX® Multi Premia® Index bedeuten, dass der darauf basierende Indexfonds die Vorteile des passiven und des aktiven Anlegens vereint. Dieser Fonds repliziert als erster den neuen Index, und das in gewohnt effizienter und präziser Manier. Wir sind stolz, diesen neuen Ansatz mit unserem Fonds für Investoren zugänglich zu machen», sagt Dr. Valerio Schmitz-Esser, Leiter Index Solutions bei Credit Suisse Asset Management.

Die kombinierten Faktoren lassen sich drei Gruppen zuordnen: Prozyklische Faktoren (Momentum, Residual Momentum), antizyklische Faktoren (Value, Size, Reversal) und defensive Faktoren (Low Risk, Quality). Die unterschiedlichen Renditen der einzelnen Faktoren können in verschiedenen Marktphasen ein hohes Diversifikationspotenzial mit sich bringen, woraus sich Chancen für eine Überrendite ergeben.

«Bereits seit über 8 Jahren arbeiten wir sehr erfolgreich mit der Credit Suisse zusammen. Wir freuen uns sehr, dieser Zusammenarbeit nun einen weiteren Meilenstein hinzuzufügen. Der EURO STOXX® Multi Premia® Index erlaubt eine breit diversifizierte Partizipation an der Marktentwicklung sowie an zusätzlichen sieben, wissenschaftlich bewährten Renditequellen und eignet sich dadurch als idealer Ersatz für eine Kernanlage in europäische Aktien», sagt Dr. Ralf Seiz, CEO und Gründer von Finreon.

Der EURO STOXX® Multi Premia® Index kombiniert sieben EURO STOXX® Single Premia® Indizes, die jeweils die 100 besten Titel gemäß ihren jeweils angestrebten Eigenschaften beinhalten. Somit umfasst das Portfolio des EURO STOXX® Multi Premia® Index etwa 300 Titel.

«Durch den Aufbau dieses innovativen, forschungsbasierten Indexes wird die Lücke zwischen Wissenschaft und Praxis geschlossen. Es war schon immer unser Ansatz, mit Kunden, Universitäten und erstklassigen Dritten zusammenzuarbeiten, um ein intelligentes Investment-Ökosystem zu schaffen», meint Inderpal Gujral, Head of Product von STOXX.

Credit Suisse Index Solutions verwaltet seit 2011 Indexfonds auf alternativ gewichtete Indizes mit einem Volumen von EUR 9,5 Mrd. (Stand 31. August 2018) und ist ein Pionier in der Replikation von nicht marktgewichteten Indizes. Das verwaltete Vermögen in Indexfonds und indexierten Mandaten belief sich per Ende August 2018 insgesamt auf EUR 110,8 Mrd. Die Produktpalette umfasst Aktien, Anleihen und gemischte Portfolios. Die Umsetzung erfolgt ausschließlich durch physische Replikation.

Übersicht über den CSIF Multi-Faktor-Indexfonds

Der Fonds im Überblick

Fondsname	CSIF (Lux) Equity EURO STOXX Multi Premia
Fondsdomizil	Luxemburg
Rechtliche Struktur	UCITS-konformer Fonds nach Luxemburger Recht
Investmentmanager	Index Solutions Team, Zürich
Fondswährung	EUR
Benchmark	EURO STOXX® Multi Premia® Index
Emissionsdatum	28.08.2018
Anteilklassen	FB: für Privatanleger, thesaurierend QB: für qualifizierte Anleger, thesaurierend DB: für Mandate, thesaurierend
Liquidität	Täglich
Annahmeschluss	14:00 Uhr (MEZ)
Fondsregistrierung	Luxemburg
Abwicklungszyklus	T+2

Verfügbare Anteilklassen:

Anlegertyp	Anteilklasse	ISIN	Laufende Kosten in %	Laufende Kosten in % im Lancierungsjahr*	Ausschüttung
Privatanleger	EUR FB	LU1865131772	0,45	0,30	thesaurierend
Qualifizierte Anleger	EUR QB	LU1865131426	0,35	0,20	thesaurierend
Mandate	EUR DB	LU1865131343	0,18	0,10	thesaurierend

* Kommt nur bis zum 27.08.2019 zur Anwendung

Credit Suisse AG
Die Credit Suisse AG ist einer der weltweit führenden Finanzdienstleister und gehört zur Unternehmensgruppe der Credit Suisse (nachfolgend «die Credit Suisse»). Unsere Strategie baut auf den Kernstärken der Credit Suisse auf: unserer Positionierung als eines der führenden Institute in der Vermögensverwaltung, unseren ausgeprägten Kompetenzen im Investment Banking und unserer starken Präsenz in unserem Heimmarkt Schweiz. Wir verfolgen bei der Vermögensverwaltung einen ausgewogenen Ansatz mit dem Ziel, sowohl von der grossen Vermögensbasis in den reifen Märkten als auch vom erheblichen Vermögenszuwachs in der Region Asien-Pazifik und anderen Schwellenmärkten zu profitieren, während wir gleichzeitig die wichtigsten entwickelten Märkte mit Schwerpunkt auf der Schweiz bedienen. Die Credit Suisse beschäftigt etwa 46 370 Mitarbeitende. Die Namenaktien (CSGN) der Credit Suisse Group AG, der Muttergesellschaft der Credit Suisse AG, sind in der Schweiz sowie, in Form von American Depositary Shares (CS), in New York kotiert. Weitere Informationen über die Credit Suisse finden Sie unter www.credit-suisse.com.

Credit Suisse Asset Management
Credit Suisse Asset Management ist Teil des Unternehmensbereichs Asset Management der Unternehmensgruppe der Credit Suisse (nachfolgend «die Credit Suisse»). Das Asset Management der Credit Suisse ist im Rahmen der Division International Wealth Management der Credit Suisse tätig und verwaltet weltweit Vermögen von über CHF 391 Mrd. (per 31.03.2018). Gestützt auf eine erstklassige institutionelle Governance sowie auf die Stabilität und das Chancenspektrum der weltweiten Marktpräsenz der Credit Suisse, bietet das Asset Management aktive und passive Lösungen für traditionelle und alternative Anlagen sowie ein herausragendes Produkt-Know-how in der Schweiz, EMEA, APAC und Amerika.

Wichtige Hinweise
Bei diesem Dokument handelt es sich um Marketingmaterial, das ausschließlich zu Werbezwecken verbreitet wird. Es darf nicht als unabhängige Wertpapieranalyse gelesen werden. Es stellt weder ein Angebot, noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Bankdienstleistungen dar und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung. Insbesondere ist dem Empfänger empfohlen, gegebenenfalls unter Einschaltung eines Beraters, die Informationen in Bezug auf die Vereinbarkeit mit seinen eigenen Verhältnissen, auf juristische, regulatorische, steuerliche, u.a. Konsequenzen zu prüfen.

Copyright © 2018 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.