

## CSA Mixta-BVG Basic

### Anlagepolitik

Das Anlageziel der Anlagegruppe ist die Erzielung eines der Risikostruktur entsprechenden Ertrages in CHF. Zu diesem Zweck investiert die Anlagegruppe über kollektive Anlagen in fest- und variabel verzinsliche Geldmarktanlagen, Obligationen und Schuldverschreibungen, sowie in Schweizer Hypotheken und Immobilien. Der Anteil an Immobilien und Hypotheken beträgt mindestens 45% des Anlagegruppenvermögens. Fremdwährungsanlagen werden möglichst umfassend gegen Schweizer Franken abgesichert.

Die Anlagegruppe erfüllt soweit anwendbar die Anlagevorschriften aus der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) und der Verordnung über die Anlagestiftungen (ASV).

### Kennzahlen

#### Investment Manager

Christoph Christen, Roger Düggelein

**Investment Manager seit** 31.12.2007, 31.12.2011

**Standort Investment Manager** Zürich, Zürich

**Währung** CHF

**Ende des Geschäftsjahres** 30. Juni

**Erstmission** 15.11.2002

**Pauschalgebühr in % p.a.** 1.10

**Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2020) in % p.a.** 1.16

**Zeichnung / Rücknahme** Täglich

**Benchmark (BM)** CB CSA Mixta-BVG Basic

**Valoren-Nr.** 1486149

**ISIN** CH0014861493

**Bloomberg Ticker** CSABVGB SW

**Reuters** 1486149X.CHE

**Ertragsverwendung** Thesaurierung

**Anspruchsklassenvermögen (in Mio.)** 656.33

**Ausgabepreis** 1'447.59

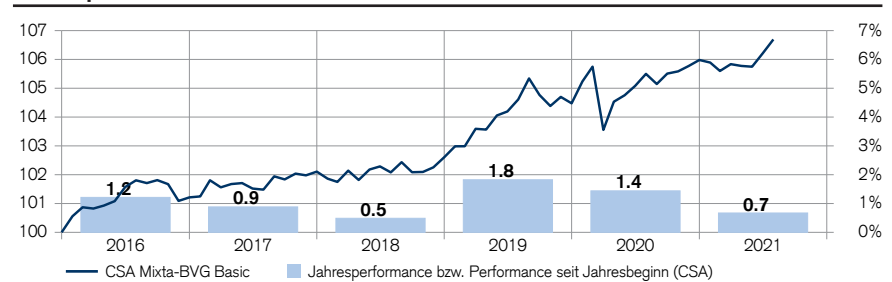
**Rücknahmepreis** 1'447.59

**Anlagegruppenvermögen (in Mio.)** 1'218.03

### Statistische Kennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	0.90	1.48	1.20
Information Ratio	-0.44	-0.90	-1.35
Tracking Error (Ex post)	0.49	0.49	0.61
Tracking Error (Ex ante)	2.07	-	-
Maximaler Verlust in % <sup>2)</sup>	-0.36	-2.07	-2.07
Sharpe Ratio	2.10	1.13	1.82
Beta	0.71	0.84	0.76
Alpha	0.03	-0.01	-0.01

### Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance <sup>1)</sup>



### Netto-Performance in % berechnet in CHF <sup>1)</sup>

	1 Monat	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.
CSA	0.46	0.87	0.67	1.13	4.52	4.80	16.12	1.48	0.94	1.50
Benchmark	0.61	0.87	0.56	1.34	6.09	7.13	25.98	1.99	1.39	2.33

### Währungen in %

#### (nach Absicherung)



### Benchmarkzusammensetzung in %

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit	5.00
SBI Domestic AAA-A 1-3Y (TR)	30.00
SBI Domestic AAA-BBB (TR)	38.00
KGAST Immo-Index Schweiz	27.00

### Laufzeit und Rendite

Modified Duration in Jahren <sup>3)</sup> 4.29

<sup>3)</sup> Duration berechnet auf Obligationen, Hypotheken und Geldmarkt.

### Grösste Positionen

Position	Fälligkeit	in % d. Vermög.
CSA Real Estate CH		24.96
Switzerland Treasury Bill	19.08.21	20.40
Switzerland Treasury Bill	14.10.21	10.22
CS 1a Immo PK		2.14
Schweiz	08.04.28	0.49
CS RE Fd Intl		0.45
Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute	27.04.27	0.45
Schweiz	06.01.49	0.43
Schweiz	08.03.36	0.40
SF Commercial Properties Fund		0.39
<b>Total</b>		<b>60.33</b>

### Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Zahlungsmittel/- äquivalente	2.08	5.00	-2.92
Hypotheken Schweiz	30.14	30.00	0.14
Obligationen CHF	39.11	38.00	1.11
<b>Total Nominalwerte</b>	<b>71.33</b>	<b>73.00</b>	
Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Immobilien Schweiz	28.67	27.00	1.67
<b>Total Sachwerte</b>	<b>28.67</b>	<b>27.00</b>	

<sup>1)</sup> Historische Performanceangaben und Finanzmarktszenarien sind keine verlässlichen Indikatoren für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Bei den Performanceangaben sind die bei Ausgabe und Rücknahme von Fondsanteilen erhobenen Gebühren und Kosten nicht berücksichtigt.

<sup>2)</sup> Maximaler Gesamtverlust innerhalb des Betrachtungszeitraumes, unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen. Der Disclaimer am Schluss dieses Dokuments gilt auch für diese Seite.

## Kontakt

### CREDIT SUISSE ANLAGESTIFTUNG

Postfach 800, 8070 Zürich

Telefon 044 333 48 48, Telefax 044 333 59 67

[csa.info@credit-suisse.com](mailto:csa.info@credit-suisse.com)

Die bereitgestellten Informationen dienen Werbezwecken. Sie stellen keine Anlageberatung dar, basieren nicht auf andere Weise auf einer Berücksichtigung der persönlichen Umstände des Empfängers und sind auch nicht das Ergebnis einer objektiven oder unabhängigen Finanzanalyse. Die bereitgestellten Informationen sind nicht rechtsverbindlich und stellen weder ein Angebot noch eine Aufforderung zum Abschluss einer Finanztransaktion dar.

Diese Informationen wurden von der Credit Suisse Group AG und/oder den mit ihr verbundenen Unternehmen (nachfolgend CS) mit grösster Sorgfalt und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt. 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 übernimmt keine Gewähr für den Inhalt und die Vollständigkeit der Informationen und lehnt, soweit gesetzlich möglich, jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung der Informationen ergeben könnten. Wenn nichts Anderes angegeben ist, sind alle Zahlen ungeprüft.

Die Informationen in diesem Dokument dienen der ausschliesslichen Nutzung durch den Empfänger. Weder die vorliegenden Informationen noch Kopien davon dürfen in die Vereinigten Staaten von Amerika versandt, dorthin mitgenommen oder in den Vereinigten Staaten von Amerika verteilt oder an US-Personen (im Sinne von Regulation S des US Securities Act von 1933 in dessen jeweils gültiger Fassung) abgegeben werden. Ohne schriftliche Genehmigung der CS dürfen diese Informationen weder auszugsweise noch vollständig vervielfältigt werden.

Emittent und Verwalter der CSA-Produkte ist die Credit Suisse Anlagestiftung, Zürich. Depotbank ist die Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich. Statuten, Reglement und Anlagerichtlinien sowie der jeweils aktuelle Jahresbericht bzw. die Factsheets können bei der Credit Suisse Anlagestiftung kostenlos bezogen werden. Als direkte Anleger sind nur in der Schweiz domizilierte steuerbefreite Vorsorgeeinrichtungen zugelassen.

Die TER KGAST-Kennzahl drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten aus, die laufend dem Vermögen der Anlagegruppe belastet werden (Betriebsaufwand). Sie wird als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens der Anlagegruppe dargestellt. Die TER KGAST wird am Ende eines jeden Geschäftsjahres für die vergangenen 12 Monate berechnet.

Die TER ex ante wird als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens der Anlagegruppe ausgedrückt und projiziert unter sonst gleichen Bedingungen den Betriebsaufwand für die folgenden zwölf Monate.

Die Zusammensetzung von Customised Benchmarks sowie ergänzende Erläuterungen zu verknüpften Benchmarks sind bei der Geschäftsführung der Anlagestiftung bzw. beim Vertreter in der Schweiz erhältlich.

Copyright © 2021 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundenen Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.