

CSF Mixta-LPP Basic

Politique d'investissement

L'objectif du groupe de placement est l'obtention d'un revenu correspondant à la structure de risque en francs suisses. Le groupe de placement investit donc principalement, par le biais de placements collectifs, dans des placements en papiers monétaires à rémunération fixe ou variable, des obligations et des titres de créance, ainsi que dans des hypothèques et des biens immobiliers suisses. La part de l'immobilier et des hypothèques représente au minimum 45% de la fortune du groupe de placement. Les placements en monnaies étrangères sont couverts le plus largement possible par rapport au franc suisse.

Le groupe de placement remplit les prescriptions de l'Ordonnance sur la prévoyance professionnelle vieillesse, survivants et invalidité (OPP 2) et de l'Ordonnance sur les fondations de placement (OFP), dans la mesure où elles s'appliquent.

Repères

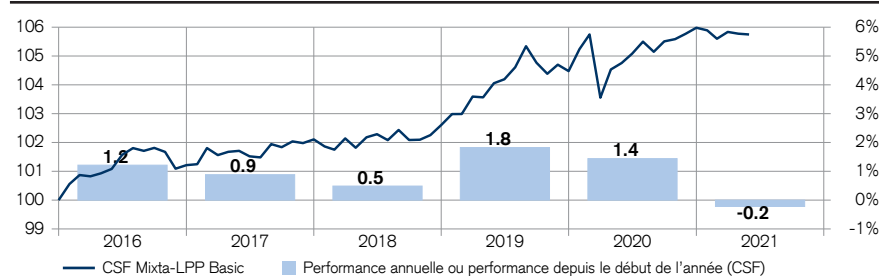
Gestionnaire	Christoph Christen, Roger Duggelin
Gestionnaire depuis	31.12.2007, 31.12.2011
Gestionnaire basé à	Zurich, Zurich
Devise	CHF
Fin de l'exercice fiscal	30 juin
Date de lancement	15.11.2002
Prime forfaitaire en % p.a.	1.10
Taux de charges d'exploitation TER KGAST (au 30.06.2020) en % p.a. ³⁾	1.16
Souscription / Rachat	Quotidien
Indice de référence (BM)	CB CSA Mixta-BVG Basic
N° de valeur	1486149
Code ISIN	CH0014861493
Code Bloomberg	CSABVGB SW
Code Reuters	1486149X.CHE
Utilisation du revenu	Capitalisation
Valeur liquidative total (en mio.)	653.48
Prix d'émission	1'434.76
Prix de rachat	1'434.76
TNA du fonds cible (en mio.)	1'235.42

3) Taux de charges d'exploitation TER KGAST: cette donnée correspond aux frais totaux sur encours (TER KAST) au dernier exercice bouclé et n'offre aucune garantie pour une valeur équivalente à l'avenir.

Statistiques

	1 an	5 ans	10 ans
Volatilité annualisée en %	0.83	1.48	1.20
Ratio d'information	-0.36	-0.88	-0.90
Tracking Error (Ex post)	0.49	0.52	0.53
Tracking Error (Ex ante)	1.69	-	-
Perte maximum en % ²⁾	-0.36	-2.07	-2.07
Ratio de Sharpe	2.03	1.11	1.81
Beta	0.67	0.86	0.83
Alpha	0.04	-0.01	-0.01

Performance nette en CHF (base de 100) et performance annuelle ¹⁾



Performance nette en % calculée en CHF ¹⁾

	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	3 ans p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.
CSF	-0.03	0.14	-0.22	0.94	3.49	4.62	16.10	1.15	0.91	1.50
Indice de référence	-0.02	0.32	-0.33	1.12	4.91	7.11	26.30	1.61	1.38	2.36

Monnaies en % (après couverture)



Composition de l'indice de référence en %

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

Duration et rendement

Duration modifiée en années ⁴⁾	4.33
---	------

4) Duration calculée sur les obligations, les hypothèques et du marché monétaire.

Positions principales

Société	Echéance	en % des capitaux
CSA Real Estate CH		24.44
Switzerland Treasury Bill	19.08.21	15.69
Switzerland Treasury Bill	15.07.21	13.04
CS 1a Immo PK		1.83
Suisse	08.04.28	0.48
Pfandbriefbank	27.04.27	0.45
Schweizerischer Hypothekarinstitute		
CS RE Fd Intl		0.45
Suisse	06.01.49	0.41
Suisse	08.03.36	0.39
Suisse	27.05.30	0.38
Total		57.56

Types de placements en %

Valeurs nominales	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Liquidités/équivalents de liquidités	3.18	5.00	-1.82
Hypothèques suisses	29.46	30.00	-0.54
Obligations CHF	39.49	38.00	1.49
Parts en valeurs nominales	72.13	73.00	
Valeurs réelles	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Valeurs immobiliers Suisse	27.87	27.00	0.87
Parts en valeurs réelles	27.87	27.00	

1) Les performances historiques et les scénarios de marché financier ne constituent pas des indicateurs fiables de résultats courants ou futurs. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais d'émission et de rachat de parts de fonds.

2) Perte totale maximale au cours de la période d'observation, indépendamment de l'intervalle partielle reprises. La clause de non-responsabilité figurant à la fin de ce document s'applique également à cette page.

Contact

CREDIT SUISSE FONDATION DE PLACEMENT
Postfach 800, 8070 Zürich
Téléphone 044 333 48 48, Fax 044 333 59 67
csa.info@credit-suisse.com

Les informations fournies constituent un support marketing. Elles ne doivent pas être interprétées comme un conseil financier ou autre fondé sur la situation personnelle du destinataire ni comme le résultat d'une analyse indépendante et objective. Les informations fournies dans le présent document ne sont pas juridiquement contraignantes et ne constituent ni une offre ni une incitation visant à la conclusion de quelque transaction financière que ce soit.

Les informations fournies dans le présent document ont été élaborées par Credit Suisse Group AG et/ou ses filiales (ci-après CS) avec le plus grand soin et en toute bonne foi.

Les informations et les opinions exprimées dans le présent document reflètent celles du Credit Suisse au moment de la rédaction et sont sujettes à modification à tout moment sans préavis. Elles proviennent de sources considérées comme fiables.

Le CS ne fournit aucune garantie quant au contenu et à l'exhaustivité de ces informations et décline toute responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de l'utilisation de ces informations. Sauf mention contraire, les chiffres n'ont pas été vérifiés. Les informations fournies dans le présent document sont réservées au seul usage de son destinataire.

Il est interdit d'envoyer, d'introduire ou de distribuer ces informations ou une copie de celles-ci aux Etats-Unis ou de les remettre à une personne US (au sens de la Regulation S de l'US Securities Act de 1933, dans sa version amendée).

La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit du CS est interdite.

La composition d'indices de référence sur mesure et les explications complémentaires relatives aux indices de référence rattachés peuvent être obtenues auprès de la direction du fonds ou du représentant en Suisse.

Credit Suisse Fondation de placement, Zürich, est l'émetteur et le gestionnaire des produits CSF. Credit Suisse (Suisse) SA, Zürich, en est la banque dépositaire. Les statuts, le règlement et les directives de placement ainsi que le dernier rapport annuel et factsheet peuvent être obtenus gratuitement auprès de Credit Suisse Fondation de placement. Seules les institutions de prévoyance domiciliées en Suisse et exonérées d'impôts sont autorisées à investir directement dans des produits CSF.

Le Total Expense Ratio (TER) correspond à la somme des commissions et des frais qui sont imputés au fur et à mesure à l'actif moyen du fonds (charges d'exploitation). La valeur (ex ante) est exprimée en pourcentage de l'actif du fonds et anticipe la moyenne des douze prochains mois dans des conditions inchangées.

Copyright © 2021 Credit Suisse Group AG et/ou ses filiales. Tous droits réservés.