

## CSF Mixta-LPP Basic

### Politica d'investimento

L'obiettivo del gruppo d'investimento è ottenere rendimenti adeguati alla struttura di rischio in CHF. A questo scopo, il gruppo investe in strumenti collettivi a reddito fisso e variabile del mercato monetario, obbligazioni e titoli di debito nonché ipoteche e immobili svizzeri. In immobili e ipoteche è collocato almeno il 45% del patrimonio del gruppo d'investimento. Gli investimenti in monete estere sono coperti per quanto possibile in franchi svizzeri.

Il gruppo d'investimento soddisfa le disposizioni applicabili dell'Ordinanza sulla previdenza professionale per la vecchiaia, i superstiti e l'invalidità (OPP 2) e dell'Ordinanza sulle fondazioni d'investimento (OFond).

### Cifre salienti

#### Responsabile di investimento

Christoph Christen, Roger Düggelein

#### Responsabile di investimento da allora

31.12.2007, 31.12.2011

**Domicilio del gestore** Zurigo, Zurigo

**Valuta base** CHF

**Chiusura d'esercizio** 30 giugno

**Data di lancio** 15.11.2002

**Commissione forfettaria in % p.a.** 1.10

**Quota delle spese di esercizio TER KGAST (dal 30.06.2020) in % p.a.** 1.16

**Sottoscrizioni / Riscatti** Giornalieri

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

**Numero di valore** 1486149

**Codice ISIN** CH0014861493

**Codice Bloomberg** CSABVGB SW

**Codice Reuters** 1486149X.CHE

**Utilizzo dei ricavi** Capitalizzazione

**Quota totale (in mio.)** 656.33

**Prezzo d'emissione** 1'447.59

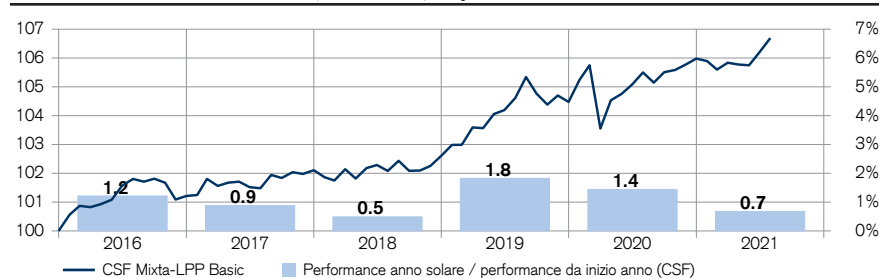
**Prezzo di riscatto** 1'447.59

**TNA del fondo strategico (in mio.)** 1'218.03

### Indici statistici

	1 anno	5 anni	10 anni
Volatilità annualizzata 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	-	-
Massima perdita 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

### Performance netta in CHF (base 100) e performance annua <sup>1)</sup>



### Performance netta in % calcolata in CHF <sup>1)</sup>

	1 mese	3 mesi	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	3 anni p.a.	5 anni p.a.	10 anni p.a.
CSF	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

### Valute in % (dopo la copertura)



### Ripartizione del indice di riferimento in %

Indice di riferimento	Percentuale
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 e rendimento

Modified duration in anni <sup>3)</sup> 4.29

<sup>3)</sup> Duration calcolato sulle obbligazioni, ipoteche e mercato monetario.

### Posizioni principali

Principali posizioni	Scadenza	in % del totale
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
Svizzera	08.04.28	0.49
CS RE Fd Intl		0.45
Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute		0.45
Svizzera	06.01.49	0.43
Svizzera	08.03.36	0.40
SF Commercial Properties Fund		0.39
<b>Totale</b>		<b>60.33</b>

### Categorie d'investimento in %

Valori nominali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Attività liquide e strumenti assimilati	2.08	5.00	-2.92
Ipoteche svizzere	30.14	30.00	0.14
Obbligazioni CHF	39.11	38.00	1.11
<b>Totale valori nominali</b>	<b>71.33</b>	<b>73.00</b>	
Valori reali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Immobili Svizzera	28.67	27.00	1.67
<b>Totale valori reali</b>	<b>28.67</b>	<b>27.00</b>	

<sup>1)</sup> I dati storici sulla performance e gli scenari dei mercati finanziari non sono indicatori affidabili per i rendimenti attuali o futuri. I dati sulla performance non tengono conto di commissioni e costi sostenuti al momento dell'emissione e del riscatto delle quote del fondo.

<sup>2)</sup> Perdita totale massimo nell'arco del periodo di osservazione, a prescindere da una serie di rimbalzi parziale intermedia.

Il disclaimer riportato alla fine del presente documento si applica anche a questa pagina.

## Contatto

**CREDIT SUISSE FONDAZIONE D'INVESTIMENTO**  
Postfach 800, 8070 Zürich  
Telefonò 044 333 48 48, Fax 044 333 59 67  
csa.info@credit-suisse.com

Le informazioni fornite nel presente documento costituiscono materiale di marketing. Non si tratta di una consulenza d'investimento o di altro tipo basata su una considerazione della situazione personale del destinatario né del risultato o dell'obiettivo di una ricerca indipendente. Le informazioni fornite nel presente documento non sono giuridicamente vincolanti e non costituiscono né un'offerta né un invito a effettuare alcun tipo di operazione finanziaria.

Le informazioni fornite nel presente documento sono state allestite da Credit Suisse Group AG e/o delle sue affiliate (denominati di seguito "CS") con la massima cura e secondo scienza e coscienza. Le informazioni e le opinioni contenute nel presente documento sono quelle di CS al momento della redazione e possono cambiare in qualsiasi momento senza preavviso. Esse sono state ricavate da fonti ritenute attendibili.

CS non fornisce alcuna garanzia per quanto riguarda il contenuto e la completezza delle informazioni e, ove giuridicamente possibile, non si assume alcuna responsabilità per i danni che potrebbero derivare dall'utilizzo delle informazioni. Se non viene indicato il contrario, tutte le cifre non vengono verificate.

Le informazioni contenute in questo documento sono ad uso esclusivo del destinatario. Né le presenti informazioni né eventuali copie delle stesse possono essere inviate, consegnate o distribuite negli Stati Uniti o a US Person (ai sensi della Regulation S dello US Securities Act del 1933, e successive modifiche). Il presente documento non può essere riprodotto, né totalmente né parzialmente, senza l'autorizzazione scritta di CS.

Credit Suisse Fondazione d'investimento, Zurigo, è l'emittente e il gestore dei prodotti CSF. Banca depositaria è Credit Suisse (Svizzera) SA, Zurigo. Lo statuto, i regolamenti, le direttive d'investimento, il più recente rapporto annuale e i fact sheet sono disponibili gratuitamente presso Credit Suisse Fondazione d'investimento. Solo gli istituti di previdenza domiciliati in Svizzera che non sono soggetti a imposta sono consentiti come investitori diretti.

L'indicatore TER KGAST esprime la totalità delle commissioni e spese che vengono addebitate correntemente al patrimonio del gruppo d'investimento (costi operativi). Viene rappresentato come percentuale del patrimonio netto medio del gruppo d'investimento. Il TER KGAST si calcola alla fine di ciascun anno finanziario, per i dodici mesi precedenti.

Il TER ex ante viene espresso in percentuale del patrimonio medio del gruppo d'investimento e rappresenta, a parità di condizioni, una proiezione dei costi operativi per i successivi dodici mesi.

La composizione dei customized benchmark nonché le spiegazioni complementari sui benchmark correlati sono ottenibili presso l'amministrazione della Fondazione d'investimento o presso il rappresentante in Svizzera.

Copyright © 2021 Credit Suisse Group AG e/o delle sue affiliate. Tutti i diritti riservati.