

CSA Mixta-BVG

Anlagepolitik

Das Anlageziel der Anlagegruppe ist die Erzielung eines angemessenen Ertrages in CHF unter Nutzung der Möglichkeiten der internationalen Diversifikation. Die Anlagegruppe investiert weltweit in fest- und variabelverzinsliche Werte, in Aktien sowie in indirekte Immobilienanlagen. Dabei wird der Anteil an Aktienanlagen zwischen 25% und 45% des Nettovermögens betragen. Der nicht abgesicherte Teil des Fremdwährungsengagements darf 30% des Nettovermögens nicht überschreiten.

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 16.07.1974

Pauschalgebühr in % p.a. 1.30

Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2018) in % p.a. 2) 1.40

Zeichnung / Rücknahme Täglich

Benchmark (BM) CB CSA Mixta-BVG

Valoren-Nr. 287570

ISIN CH0002875703

Bloomberg Ticker CSAMBVG SW

Reuters 287570X.CHE

Ertragsverwendung Thesaurierung

Anspruchsklassenvermögen (in Mio.) 1'748.39

Ausgabepreis 1'736.14

Rücknahmepreis 1'736.14

Anlagegruppenvermögen (in Mio.) 1'823.45

2) Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Angabe entspricht der Total Expense Ratio (TER KGAST) im zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahr und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

Laufzeit und Rendite

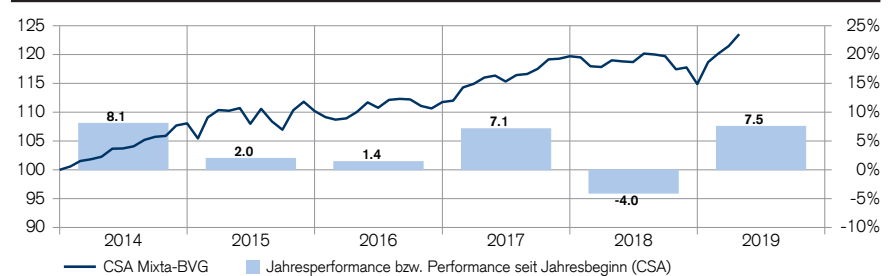
Modified Duration in Jahren 3) 6.25

3) Duration berechnet auf Obligationen und Geldmarkt.

Statistische Kennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	5.42	4.54	4.27
Information Ratio	0.00	0.00	0.00
Tracking Error (Ex post)	1.79	1.28	1.22
Tracking Error (Ex ante)	-	-	-
Maximaler Verlust in %	-4.40	-4.40	-7.05
Sharpe Ratio	0.82	0.98	1.07
Beta	1.07	1.00	1.01
Alpha	-0.04	-0.03	-0.03

Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance 1)



Netto-Performance in CHF 1)

	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	1.70	4.08	7.54	3.82	12.28	20.79	53.06	3.93	3.85	4.35
Benchmark	1.76	3.11	6.44	3.98	13.43	23.02	63.22	4.29	4.23	5.02

Benchmarkzusammensetzung in %

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit	5.00
SBI AAA-BBB (TR)	46.00
JPM GBI Global Traded	5.00
SPI (TR)	18.00
MSCI AC World ex Switzerland (TR)	17.00
CB CSA Real Estate Switzerland (TR)	6.00
CB German Monthly Open Ended Funds (OFIX) all (TR) (CHF-Hgd)	3.00

Veränderung taktische Allokation

Aktien USA+1%

Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Zahlungsmittel/- äquivalente	3.37	5.00	-1.63
Hypotheken Schweiz	3.43	-	3.43
Obligationen CHF	36.20	46.00	-9.80
Obligationen Ausland FW	4.34	5.00	-0.66
Total Nominalwerte	47.34	56.00	

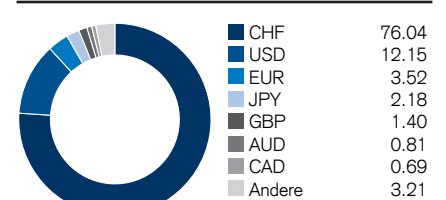
Sachwerte

Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Aktien Schweiz	17.88	18.00	-0.12
Aktien Europa	3.42	2.99	0.43
Aktien USA	9.97	9.40	0.57
Aktien Kanada	0.61	0.55	0.06
Aktien Japan	1.37	1.36	0.01
Aktien Pazifik ex Japan	0.80	0.69	0.11
Aktien Emerging Markets	2.18	2.01	0.17
Immobilien Schweiz	10.67	6.00	4.67
Immobilien Ausland	5.76	3.00	2.76
Total Sachwerte	52.66	44.00	

Grösste Positionen

Position	in % d. Vermög.
CSIMF Bond CHF	28.83
CSA Fund Selection Eq CH	7.89
CSA Real Estate CH	6.52
CSA Obl Mid Yield CHF	5.34
Credit Suisse US Index Blue Equity Fund	5.26
CSA Eq. Switzerland	4.70
CSIF CH Large Cap Index Blue	3.50
CS RE Fd Intl	3.45
CSA Hypotheken CH	3.43
CSA Fund Selection Eq EUR	2.82
Total	71.74

Währungen in % (nach Absicherung)



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

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 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 gibt keine Gewähr hinsichtlich des Inhalts und der Vollständigkeit der Informationen und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung der Informationen ergeben. Ist nichts anderes vermerkt, 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.

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

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 Total Expense Ratio (TER) bezeichnet die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem durchschnittlichen Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand). Der Wert (ex ante) wird in einem Prozentsatz des Fondsvermögens ausgedrückt und antizipiert den Durchschnitt der kommenden zwölf Monate bei gleich bleibenden Voraussetzungen.

Copyright © 2019 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundenen Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.