

CSF Mixta-LPP Equity 75

(quota azionaria superata ai sensi dell'OPP 2)

Politica d'investimento

L'obiettivo del gruppo d'investimento è conseguire un rendimento allettante in CHF sfruttando le possibilità della diversificazione internazionale. A causa dell'elevata componente azionaria, che a seconda della situazione di mercato oscilla tra il 65% e l'85% del patrimonio netto, l'orizzonte temporale d'investimento dovrebbe essere di almeno 10 anni. Il gruppo d'investimento colloca inoltre il capitale in tutto il mondo in titoli a tasso fisso e variabile e in investimenti immobiliari indiretti. La parte non coperta dell'impegno in valuta estera non può superare il 30% del patrimonio netto.

Il gruppo d'investimento presenta una quota azionaria media del 75% e supera pertanto il limite per gli investimenti in azioni ai sensi dell'art. 55 OPP 2. A causa della maggiore quota azionaria questo prodotto comporta un rischio più elevato rispetto a soluzioni di previdenza con una componente azionaria massima del 50%. Rimangono soddisfatte, ove applicabili, tutte le altre prescrizioni d'investimento 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	12.02.2018, 12.02.2018
Domicilio del gestore	Zurigo, Zurigo
Valuta base	CHF
Chiusura d'esercizio	30 giugno
Data di lancio	12.02.2018
Commissione forfettaria in % p.a.	1.40
TER ex ante in %	1.50
Sottoscrizioni / Riscatti	Giornalieri
Benchmark (BM)	CB CSA Mixta-BVG Equity 75
Numero di valore	38261482
Codice ISIN	CH0382614821
Codice Bloomberg	CSBE75B.SW
Codice Reuters	38261482X.CHE
Utilizzo dei ricavi	Capitalizzazione
Prezzo d'emissione	1'018.96
Prezzo di riscatto	1'018.96
TNA del fondo strategico (in mio.)	19.70

2) Quota delle spese di esercizio TER KGAST: il dato corrisponde al total expense ratio (TER KGAST) nell'ultimo esercizio annuale e non fornisce alcuna garanzia per l'ottenimento di un valore simile nel futuro.

Duration e rendimento

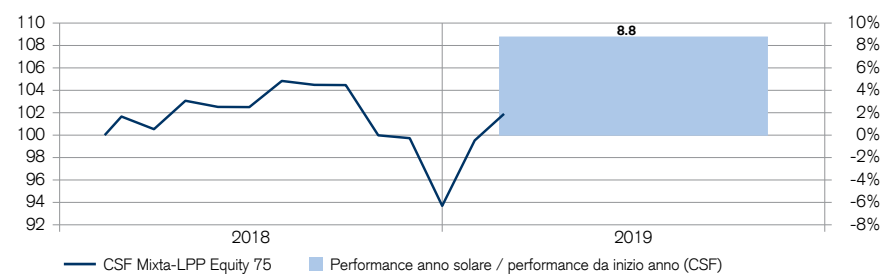
Modified duration in anni ³⁾	5.22
-----------------------------------------	------

3) Duration calcolato sulle obbligazioni e sul mercato monetario.

Indici statistici

	1 anno	3 anni	5 anni
Volatilità annualizzata in %	11.08	-	-
Information ratio	-2.29	-	-
Tracking Error (Ex post)	0.81	-	-
Tracking Error (Ex ante)	-	-	-
Massima perdita in %	-10.63	-	-
Sharpe ratio	0.02	-	-
Beta	1.04	-	-
Alpha	-0.16	-	-

Performance netta in CHF (base 100) e performance annua ¹⁾



Performance netta in CHF - in % ¹⁾

	1 mese	3 mesi	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	3 anni % p.a.	5 anni % p.a.	10 anni % p.a.	ITD
CSF	2.38	2.17	8.76	0.23	-	-	-	-	-	1.90
Benchmark	2.53	2.82	8.90	2.11	-	-	-	-	-	3.86

Ripartizione del indice di riferimento in %

CGBI CHF 3M Euro Dep.	5.00
SBI AAA-BBB (TR)	10.00
CB CSA Equity Switzerland (TR)	30.00
CB CSA Equity World ex Switzerland (NR) (partially CHF-Hgd)	45.00
CB CSA Real Estate Switzerland (TR)	10.00

Cambiamento dell'allocazione tattica

Reddito fisso	CH-0.7%
Azioni	CH-0.6%, USA+0.5%, EMU-0.5%, Emerging Markets-0.7%
Altri	Real Estate CH+1%

Categorie d'investimento in %

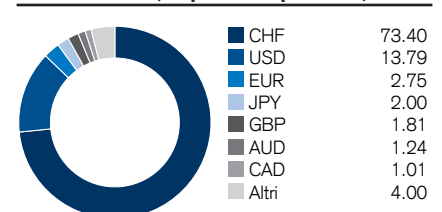
Valori nominali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Attività liquide e strumenti assimilati	4.32	5.00	-0.68
Obbligazioni CHF	10.20	10.00	0.20
Obbligazioni estero VE	0.68	-	0.68
Totale valori nominali	15.20	15.00	

Valori reali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Azioni Svizzera	29.47	30.00	-0.53
Azioni Europa	8.06	8.37	-0.31
Azioni USA	26.61	26.38	0.23
Azioni Canada	1.58	1.53	0.05
Azioni Giappone	3.79	3.83	-0.04
Azioni Pacifico tranne Giappone	2.07	1.93	0.14
Azioni mercati emergenti	2.85	2.96	-0.11
Immobili Svizzera	9.76	10.00	-0.24
Immobili Estero	0.61	-	0.61
Totale valori reali	84.80	85.00	

Posizioni principali

Principali posizioni	in % del totale
CSIF CH Large Cap Index Blue	13.68
Credit Suisse Small & Mid Cap EQ CHF	11.41
Credit Suisse US Index Equity Fund	7.75
CSIMF Money Market	7.60
CSA Fund Selection Eq EUR	6.70
CSIMF Swiss Real Estate Securities	6.64
CSIMF Bond CHF	6.30
CSIF US Index Blue	5.72
CS Eq. Fd Swiss Small Cap	3.13
CSA Obl Mid Yield CHF	2.92
Totale	71.85

Valute in % (dopo la copertura)



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

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 circa il contenuto e la completezza delle informazioni e declina qualsiasi responsabilità per eventuali perdite connesse all'uso delle stesse. Salvo indicazioni contrarie, tutti i dati non sono certificati. Le informazioni fornite nel presente documento sono a 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.

La Credit Suisse Fondazione d'investimento, Zurigo, è l'emittente e il gestore dei prodotti CSF. Credit Suisse (Svizzera) SA, Zurigo, è la banca depositaria. Gli statuti, il regolamento e le direttive d'investimento, come pure gli ultimi rendiconti annuali e fact sheets, possono essere ottenuti gratuitamente presso la Credit Suisse Fondazione d'investimento. Unicamente le istituzioni di previdenza domiciliate in Svizzera e non soggette all'imposizione fiscale possono investire direttamente nei prodotti CSF.

Il Total Expense Ratio (TER) esprime la somma delle commissioni e dei costi addebitati correntemente al patrimonio del fondo (spese di esercizio). Il valore (ex ante) viene espresso in forma percentuale del patrimonio del fondo e anticipa la media dei dodici mesi successivi, sempre che le condizioni restino invariate.

Copyright © 2019 Credit Suisse Group AG e/o delle sue affiliate. Tutti i diritti riservati.