

## CSA Mixta-BVG Index 35

### Anlagepolitik

Die Anlagegruppe CSA Mixta-BVG Index 35 investiert indirekt über indexierte Anlagefonds weltweit in fest- und variabelverzinsliche Werte (z.T. inflationsgeschützt), in Aktien sowie in Schweizer Immobilien. Dabei werden die Investitionen in sechs unterschiedlichen Anlageklassen gemäss Benchmark getätigt (physische Replikation). Der Anteil von Aktienanlagen beträgt zwischen 30% und 40%. Der abgesicherte Teil des Fremdwährungsengagements liegt mindestens bei 76%. Neben der breiten Diversifikation – verschiedene Anlageklassen, welche wiederum in mehrere tausend Einzeltitel investieren – zeichnet sich die Anlagegruppe durch geringe Verwaltungskosten (z.B. Kosten für Research oder Transaktionskosten) aus.

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

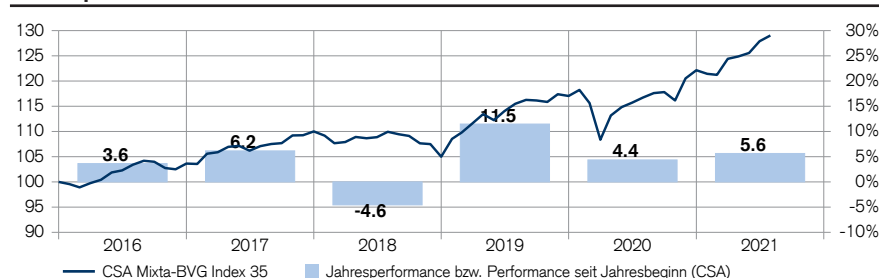
<b>Investment Manager</b>	Mehmet Besler
<b>Investment Manager seit</b>	01.08.2016
<b>Standort Investment Manager</b>	Zürich
<b>Währung</b>	CHF
<b>Ende des Geschäftsjahres</b>	30. Juni
<b>Erstmission</b>	29.09.2010
<b>Pauschalgebühr in % p.a.</b>	0.68
<b>Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2020) in % p.a.<sup>3)</sup></b>	0.90
<b>Ausgabeaufschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in %</b>	0.19
<b>Rücknahmeaufschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in %</b>	0.04
<b>Zeichnung / Rücknahme</b>	Täglich
<b>Benchmark (BM)</b>	CB CSA Mixta-BVG Index 35
<b>Valoren-Nr.</b>	11520273
<b>ISIN</b>	CH0115202738
<b>Bloomberg Ticker</b>	CSABI35 SW
<b>Reuters</b>	11520273X.CHE
<b>Ertragsverwendung</b>	Thesaurierung
<b>Ausgabepreis</b>	1'621.43
<b>Rücknahmepreis</b>	1'617.71
<b>Anlagegruppenvermögen (in Mio.)</b>	427.02

3) Aufgrund einer Senkung der Pauschalgebühr per 1.7.2021 kann mit einer (Ziel-) TER KGAST per 30.6.2022 von rund 0,80 % p.a. gerechnet werden. Wegen der retrospektiven Berechnungsmethode der TER KGAST Kennzahl wird die tiefere Gesamtkostenbelastung frühestens im September 2022 im CSA Anlage-Factsheet ersichtlich sein.

### Statistische Kennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	4.86	5.40	4.78
Tracking Error (Ex post)	0.21	0.19	0.24
Tracking Error (Ex ante)	0.06	-	-
Maximaler Verlust in % <sup>2)</sup>	-1.41	-8.35	-8.35
Sharpe Ratio	2.22	0.95	1.19
Beta	0.98	0.98	0.98

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

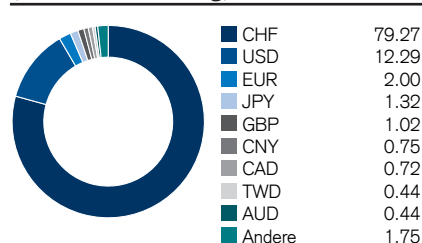


### Netto-Performance in % berechnet in CHF<sup>1)</sup>

	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	0.89	3.33	5.64	10.54	17.37	24.77	64.59	5.48	4.52	5.10
Benchmark	0.94	3.49	6.02	11.44	19.65	29.12	76.44	6.16	5.24	5.84

<sup>1)</sup>Der Portfolio Manager strebt eine Zielrendite der Benchmark-Performance minus Kosten für das Management an

### Währungen in % (nach Absicherung)



### Benchmarkzusammensetzung in %

SBI AAA-BBB ESG (TR)	35.00
Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability(TR) (CHF-H)	16.00
Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	9.00
SPI ESG (TR)	14.00
MSCI AC World ex Switzerland ESG Leaders (NR)	18.00
MSCI World ex Switzerland Small Cap ESG Leaders (NR)	3.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

### Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Obligationen CHF	34.78	35.00	-0.22
Obligationen Fremdwährung abgesichert in CHF	15.84	16.00	-0.16
Inflationsindexierte Obligationen abgesichert in CHF	8.86	9.00	-0.14
Other	0.01	0.00	0.01
<b>Total Nominalwerte</b>	<b>59.49</b>	<b>60.00</b>	
Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Aktien Schweiz	14.43	14.00	0.43
Aktien Europa	3.78	3.70	0.08
Aktien USA	12.35	12.05	0.30
Aktien Kanada	0.73	0.73	0.00
Aktien Japan	1.40	1.38	0.02
Aktien Pazifik ex Japan	0.73	0.73	0.00
Aktien Emerging Markets	2.15	2.41	-0.26
Immobilien Schweiz	4.94	5.00	-0.06
Other	0.01	0.00	0.01
<b>Total Sachwerte</b>	<b>40.52</b>	<b>40.00</b>	

### Laufzeit und Rendite

Modified Duration in Jahren<sup>4)</sup> 8.80

4) Duration berechnet auf Obligationen.

### Grösste Positionen

Position	Fälligkeit	in % d. Vermög.
Nestle SA		2.76
Roche Holdings		2.05
Novartis AG		1.72
UBS Sima		0.85
Schweiz. Eidg.	08.04.28	0.55
Compagnie Financiere Richemont		0.50
Microsoft Corp		0.50
ABB Ltd		0.49
Zürich Insurance Group AG		0.46
<b>Total</b>		<b>9.89</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.

# CSA Mixta-BVG Index 35

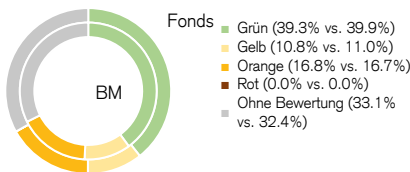
## ESG-Rating ggü. Benchmark <sup>5)</sup>

	ESG	E	S	G
Fonds	AA	BBB	A	A
BM	AA	BBB	A	A

## ESG-Aufschlüsselung <sup>8)</sup>

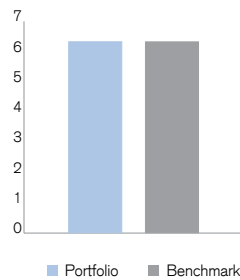
	Wert
<b>Gesamtwert</b>	<b>7.3</b>
<b>Environment</b>	<b>5.7</b>
Klimawandel	6.4
Umw.-Gelegenheiten	5.4
Natürliches Kapital	5.8
Verschmutzung & Abfall	5.4
<b>Soziales</b>	<b>5.8</b>
Humankapital	5.3
Produkthaftung	5.4
Soziale Gelegenheiten	5.1
Stakeholder-Einwände	6.4
<b>Governance</b>	<b>5.9</b>
Unternehmensverhalten	0.0
Corporate Governance	0.0

## ESG-Kontroversen-Flag <sup>9)</sup>



## Low Carbon Transition Score <sup>11)</sup>

Portfolio: **6.3** / Benchmark: **6.3**



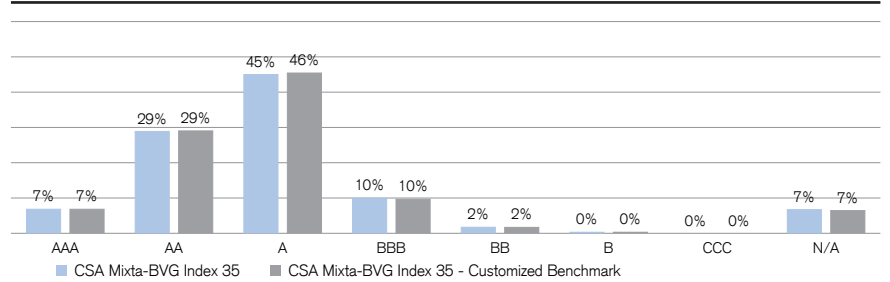
## Portfolioübersicht <sup>6)</sup>

Dieses Produkt investiert nicht in Unternehmen, die an der Entwicklung oder Produktion von nuklearen, biologischen und chemischen Kampfstoffen, Antipersonenminen und Streubomben gemäss der Ausschlussliste des Schweizerischen Verbandes für verantwortungsvolle Investitionen (SVVK-ASIR) beteiligt sind.

## Angewendete ESG-Merkmale <sup>7)</sup>

- ESG-Benchmark
- Ausschchlusskriterien
- ESG-Integration
- Stimmrechtsvertretung
- Engagement

## ESG-Rating in Prozent ggü. Benchmark <sup>10)</sup>



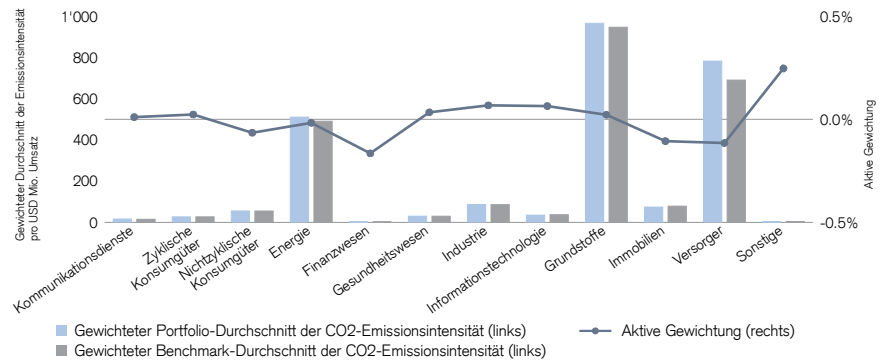
## Top-10-Positionen

Name der Position	Gewichtung	ESG-Rating	Kontr.-Flag	E	S	G
Nestle	2.8%	AA	■	■	■	■
Roche Holding AG	2.1%	A	■	■	■	■
Novartis AG	1.7%	A	■	■	■	■
Microsoft Corporation	1.1%	AAA	■	■	■	■
UBS Sima	0.9%	AA	■	■	■	■
Switzerland	0.6%	AA	■	■	■	■
Compagnie Financiere Richemont SA	0.5%	AA	■	■	■	■
ABB Ltd	0.5%	AA	■	■	■	■
Zurich Insurance Group Ltd	0.5%	AA	■	■	■	■
Alphabet Inc.	0.4%	BBB	■	■	■	■

## Kohlenstoffemissionsintensität <sup>12)</sup>

Emissionen in Tonnen CO<sub>2</sub>-Äquivalent pro USD Mio. Ertrag

Portfolio: **78.1** / Benchmark: **76.5**



## Legende

- 5) Das ESG-Rating, das von MSCI ESG erteilt wird, wird auf einer Skala von AAA (höchstes Rating) bis CCC (niedrigstes Rating) gemessen. Das Rating hängt davon ab, wie stark ein Unternehmen branchenspezifischen Nachhaltigkeitsrisiken ausgesetzt ist und inwieweit es im Vergleich zu den Mitbewerbern in der Lage ist, diese Risiken zu mindern. Das Gesamtportfoliorating wird relativ auf Branchenbasis gemessen, die Einzelratings E, S und G dagegen auf absoluter Basis. Daher ist das Gesamtrating nicht als Durchschnitt der Einzelratings E, S und G zu betrachten.
- 6) Weitere Informationen zu den angewendeten normenbasierten Ausschlusskriterien finden Sie unter: [www.svk-asir.ch](http://www.svk-asir.ch) © Sind keine geeigneten und/oder liquiden Aktienindex-Futures auf ESG-Indizes verfügbar, kann der Subfonds/Fonds Aktienindex-Futures mit Bezug zu traditionellen Indizes (d. h. Nicht-ESG-Indizes) verwenden, um verschiedene Risiken zu mindern, ein effizientes Portfoliomanagement sicherzustellen und das Marktengagement aufzubauen oder zu reduzieren.
- 7) Weitere Informationen über die Methoden zur Bewertung der ESG-Merkmale von Anlagen finden Sie unter [www.msci.com/our-solutions/esg-investing/](http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/)
- 8) Der ESG-Gesamtqualitätsscore deckt sich nicht direkt mit den angegebenen zu Grunde liegenden Scores für die Säulen Environmental, Social und Governance (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung). Die Scores für diese Säulen werden auf absoluter Basis ermittelt, während der ESG-Gesamtqualitätsscore so angepasst wird, dass er das branchenspezifische Exposure gegenüber Nachhaltigkeitsrisiken widerspiegelt. Da die Säulenscores absolut und die Gesamtscores relativ sind, ergeben sich Letztere nicht aus dem Durchschnitt der Ersteren. ESG-Themen repräsentieren eine Aufschlüsselung der Einzelscores E, S und G. Alle Scores und ihre Komponenten werden auf einer Skala von 0 bis 10 (von MSCI vorgegeben) ermittelt, wobei 0 sehr schlecht und 10 sehr gut ist.
- 9) Das ESG-Kontroversen-Flag dient dazu, eine zeitnahe und konsistente Beurteilung über ESG-Kontroversen abzugeben, in die börsennotierte Unternehmen und Anleihenemittenten verwickelt sind. Eine Kontroverse ist typischerweise ein einmaliges Ereignis wie eine Ölpest, ein Betriebsunfall oder Anschuldigungen zu Sicherheitsproblemen in einem Produktionsbetrieb. ESG-Kontroversen-Flags werden durch die Farben Grün, Gelb, Orange und Rot dargestellt, wobei Rot einen Hinweis auf eine oder mehrere sehr schwere Kontroversen gibt, während Grün auf keine grösseren Kontroversen hindeutet. Die Farbe Grau bedeutet, dass keine Daten verfügbar sind.
- 10) ESG-Ratings bilden die MSCI-ESG-Rating-Aufteilung in Prozent absolut oder gegenüber einem Benchmark ab. GRESB-Ratings für Immobilien werden nicht berücksichtigt.
- 11) Der Low Carbon Transition Score basiert auf einer multidimensionalen Beurteilung der Risiken und Chancen und berücksichtigt sowohl Hauptrisiken als auch sekundäre Risiken, die ein Unternehmen betreffen. Die Skala reicht von 0 bis 10 (wobei 10 für potenziell führend steht), ist branchenunabhängig und stellt eine absolute Beurteilung der Position eines Unternehmens bezüglich der Umstellung dar. Auf Portfolioebene werden individuelle Wertungen zusammengefasst und mit dem Benchmark (falls vorhanden) verglichen.
- 12) Die Kohlenstoffintensität vergleicht den gewichteten Durchschnitt der Emissionsintensität pro USD Mio. Umsatz (aufgegliedert nach GICS-Sektoren) des Portfolios und des Benchmarks. Sie zeigt ausserdem die aktiven GICS-Sektorgewichtungen.

## 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.