

CSA Mixta-BVG Index 45

Anlagepolitik

Die Anlagegruppe CSA Mixta-BVG Index 45 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 40% und 50%. Der abgesicherte Teil des Fremdwährungsengagements liegt mindestens bei 70%. Neben der breiten Diversifikation – verschiedene Anlageklassen, welche wiederum in mehr als 8000 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

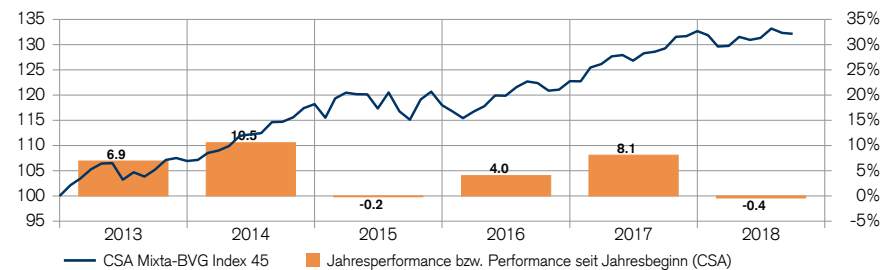
Investment Manager	Mehmet Besler
Investment Manager seit	01.08.2016
Standort Investment Manager	Zürich
Währung	CHF
Ende des Geschäftsjahres	30. Juni
Erstmission	01.10.2009
Pauschalgebühr in % p.a.	0.78
Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2018) in % p.a. ²⁾	0.90
Ausgabeaufschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in %	0.16
Rücknahmeabschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in %	0.05
Zeichnung / Rücknahme	Täglich
Benchmark (BM)	CB CSA Mixta-BVG Index 45
Valoren-Nr.	10382676
ISIN	CH0103826761
Bloomberg Ticker	CSAMI45 SW
Reuters	10382676X.CHE
Ertragsverwendung	Thesaurierung
Anspruchsklassenvermögen (in Mio.)	848.13
Ausgabepreis	1'533.46
Rücknahmepreis	1'530.24
Anlagegruppenvermögen (in Mio.)	934.97

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.

Statistische Kennzahlen

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	3.49	4.07	4.59
Tracking Error (Ex post)	0.06	0.06	0.09
Tracking Error (Ex ante)	0.39	-	-
Maximaler Verlust in %	-2.31	-4.35	-4.48
Sharpe Ratio	0.63	1.13	0.99
Beta	1.00	1.00	0.99
Erholungsphase (in Monaten)	5	5	2

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	3 Jahre % p.a.	5 Jahre % p.a.	10 Jahre % p.a.	Seit Lancierung
CSA	-0.13	0.62	-0.40	2.23	14.80	25.61	4.70	4.66	-	53.10
Benchmark	-0.09	0.81	0.15	2.97	17.42	30.43	5.49	5.45	-	60.63

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

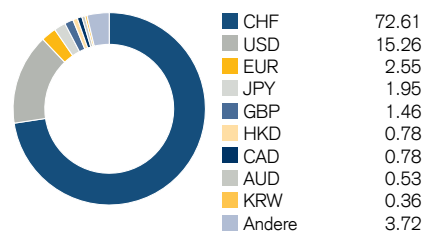
Benchmarkzusammensetzung in %

SBI AAA-BBB (TR)	25.00
Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	10.00
Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	15.00
SPI (TR)	18.00
MSCI AC World ex Switzerland IMI (NR)	27.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

Grösste Positionen

Position	in % d. Vermög.
Nestlé	3.44
Novartis AG	2.81
Roche	2.32
UBS Swiss Mixed Sima	0.90
UBS Group AG	0.80
Zurich Insurance	0.63
Apple	0.59
ABB Ltd	0.57
Compagnie Financiere	0.56
CS Group	0.47
Total	13.09

Währungen in % (nach Absicherung)



Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Obligationen CHF	24.71	25.00	-0.29
Obligationen Fremdwährung abgesichert in CHF	9.88	10.00	-0.12
Inflationsindexierte Obligationen abgesichert in CHF	14.82	15.00	-0.18
Total Nominalwerte	49.41	50.00	

Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Aktien Schweiz	18.18	18.00	0.18
Aktien Europa	4.49	4.42	0.07
Aktien USA	16.88	16.58	0.30
Aktien Kanada	0.78	0.77	0.01
Aktien Japan	1.95	1.92	0.03
Aktien Pazifik ex Japan	0.91	0.90	0.01
Aktien Emerging Markets	2.45	2.41	0.04
Immobilien Schweiz	4.95	5.00	-0.05
Total Sachwerte	50.59	50.00	

Laufzeit und Rendite

Modified Duration in Jahren ³⁾	8.87
---	------

³⁾ Duration berechnet auf Obligationen.

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 © 2018 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundenen Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.