

CSF Mixta-LPP Index 45



Politique d'investissement

Le groupe de placement CSF Mixta-LPP Index 45 investit à l'échelle mondiale indirectement via des fonds indexés dans des valeurs à taux fixe ou variable (en partie protégées contre l'inflation), dans des actions ainsi que dans des biens immobiliers suisses. Les placements sont effectués dans six classes différentes conformément au benchmark (réplication physique). La part investie en actions peut varier entre 40% et 50%. La part couverte de l'engagement en monnaies étrangères se situe à 70% minimum. En plus d'une large diversification (plusieurs classes d'actifs investissent dans plusieurs milliers de titres individuels), le groupe de placement se caractérise par des frais de gestion (p. ex. frais de recherche ou de transaction) faibles.

Le groupe de placement remplit les prescriptions de l'Ordonnance sur la prévoyance professionnelle vieillissante, survivants et invalidité (OPP 2) et de l'Ordonnance sur les fondations de placement (OFF), dans la mesure où elles s'appliquent.

Repères

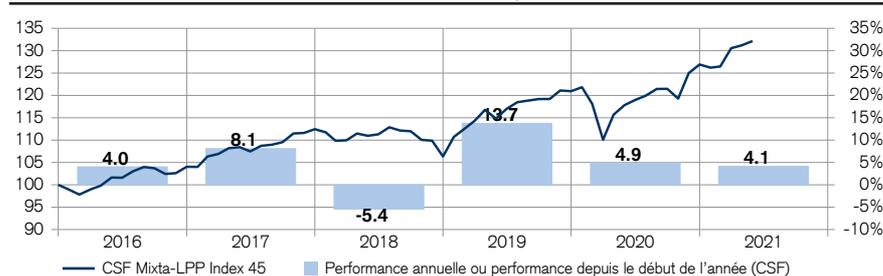
Gestionnaire	Mehmet Besler
Gestionnaire depuis	01.08.2016
Gestionnaire basé à	Zurich
Devises	CHF
Fin de l'exercice fiscal	30 juin
Date de lancement	01.10.2009
Prime forfaitaire en % p.a.	0.78
Taux de charges d'exploitation TER KGAST (au 30.06.2020) en % p.a.	0.90
Supplément d'émission (reste dans la fortune de placement) en %	0.16
Déduction rachat (reste dans la fortune de placement) en %	0.05
Souscription / Rachat	Quotidien
Indice de référence (BM)	CB CSA Mixta-BVG Index 45
N° de valeur	10382676
Code ISIN	CH0103826761
Code Bloomberg	CSAMI45 SW
Code Reuters	10382676X.CHE
Utilisation du revenu	Capitalisation
Valeur liquidative total (en mio.)	1'178.61
Prix d'émission	1'809.57
Prix de rachat	1'805.78
TNA du fonds cible (en mio.)	1'275.68

3) Taux de charges d'exploitation TER KGAST: cette donnée correspond aux frais totaux sur encours (TER KAST) au dernier exercice bouclé et n'offre aucune garantie pour une valeur équivalente à l'avenir.

Statistiques

	1 an	5 ans	10 ans
Volatilité annualisée en %	5.84	6.35	5.80
Tracking Error (Ex post)	0.23	0.28	0.22
Tracking Error (Ex ante)	0.14	-	-
Perte maximum en % ²⁾	-1.81	-9.63	-9.63
Ratio de Sharpe	2.08	0.94	1.02
Beta	0.99	0.98	0.98

Performance nette en CHF (base de 100) et performance annuelle¹⁾

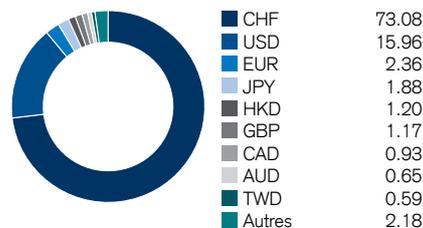


Performance nette en % calculée en CHF¹⁾

	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	3 ans p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.
CSF	0.73	4.50	4.13	12.17	19.09	30.04	68.77	5.99	5.39	5.37
Indice de référence	0.71	4.60	4.34	13.03	21.37	34.51	80.12	6.66	6.11	6.06

¹⁾ Le gestionnaire de portefeuille cherche à atteindre un rendement équivalent à la performance du benchmark moins les coûts de gestion

Monnaies en % (après couverture)



Composition de l'indice de référence en %

SBI AAA-BBB ESG (TR)	25.00
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)	18.00
MSCI AC World ex Switzerland ESG Leaders (NR)	23.00
MSCI World ex Switzerland Small Cap ESG Leaders (NR)	4.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

Types de placements en %

Valeurs nominales	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Obligations CHF	24.52	25.00	-0.48
Obligations en monnaies étrangères couvertes en CHF	15.82	16.00	-0.18
Obligations indexées sur l'inflation couvertes en CHF	8.93	9.00	-0.07
Parts en valeurs nominales	49.27	50.00	
Valeurs réelles	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Actions suisses	18.69	18.00	0.69
Actions européennes	4.98	4.89	0.09
Actions États Unis	15.45	15.09	0.36
Actions Canada	0.95	0.92	0.03
Actions Japon	1.87	1.83	0.04
Actions Pacifique sauf Japon	0.99	0.97	0.02
Actions marchés émergents	2.97	3.30	-0.33
Valeurs immobilières Suisse	4.83	5.00	-0.17
Parts en valeurs réelles	50.73	50.00	

Duration et rendement

Duration modifiée en années ⁴⁾	8.76
---	------

4) Duration calculée sur les obligations.

Positions principales

Société	en % des capitaux
Nestle SA	3.71
Roche Holding AG	2.56
Novartis AG	2.27
Microsoft Corp	1.30
UBS Swiss Mixed Sima	0.82
Cie Financiere Richemont	0.67
Zurich Insurance Group	0.66
ABB	0.65
UBS Group AG	0.60
Alphabet -C-	0.52
Total	13.74

1) Les performances historiques et les scénarios de marché financier ne constituent pas des indicateurs fiables de résultats courants ou futurs. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais d'émission et de rachat de parts de fonds.

2) Perte totale maximale au cours de la période d'observation, indépendamment de l'intervalle partielle reprises. La clause de non-responsabilité figurant à la fin de ce document s'applique également à cette page.

CSF Mixta-LPP Index 45

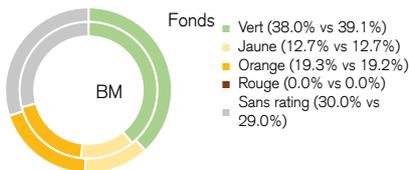
Notation ESG vs indice de référence ⁵⁾

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

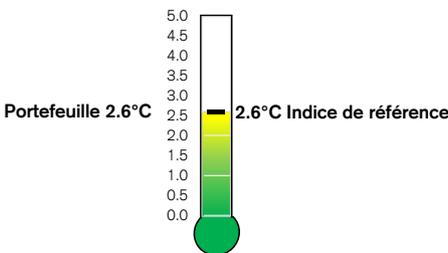
Ventilation ESG ⁸⁾

	Notes
Note générale	7.3
Environnement	5.8
Changement climatique	6.8
Opportunités env.	5.4
Capital naturel	5.7
Pollution et déchets	5.3
Social	5.7
Capital humain	5.1
Responsabilité en matière de produit	5.3
Opportunités sociales	5.3
Opposition des parties prenantes	6.3
Gouvernance	5.8
Comportement de l'entreprise	0.0
Gouvernance d'entreprise	0.0

Flag des controverses ESG ⁹⁾



Score ESG climat ¹¹⁾



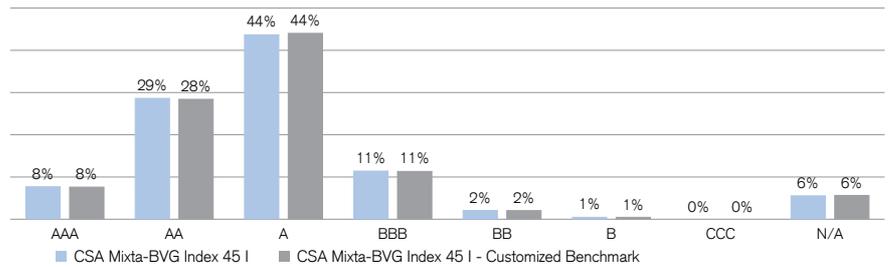
Aperçu du portefeuille ⁶⁾

Ce produit n'investit pas dans des entreprises actives dans le développement ou la production d'agents de guerre chimique, biologique ou nucléaire, de mines anti-personnel et de bombes à sous-munitions selon la liste d'exclusion publiée par l'Association suisse pour des investissements responsables (SVVK-ASIR).

Caractéristiques ESG appliquées ⁷⁾

- Indice de référence ESG
- Critères d'exclusion
- Intégration de critères ESG
- Vote par procuration
- Engagement

Notation ESG en % vs indice de référence ¹⁰⁾

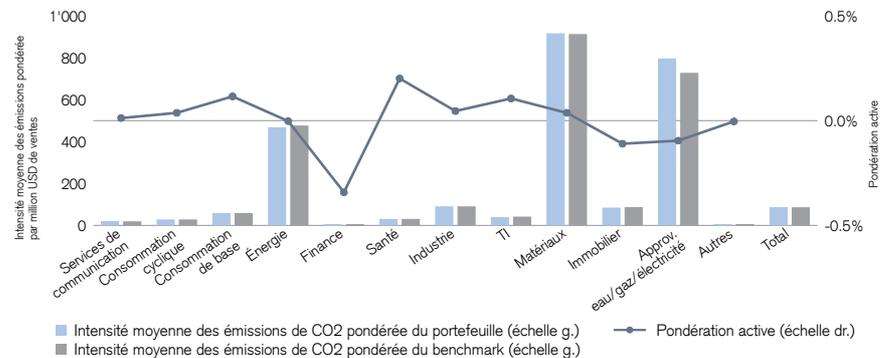


10 principaux actifs

Nom des actifs	Pondération	Notation ESG	Flag cont.	E	S	G
Nestle	3.7%	AA	■	■	■	■
Roche Holding AG	2.6%	A	■	■	■	■
Novartis AG	2.3%	A	■	■	■	■
Microsoft Corporation	1.3%	AAA	■	■	■	■
UBS AG	0.8%	AA	■	■	■	■
Compagnie Financiere Richemont SA	0.7%	AA	■	■	■	■
Zurich Insurance Group Ltd	0.7%	AA	■	■	■	■
ABB Ltd	0.7%	AA	■	■	■	■
UBS Group AG	0.6%	AA	■	■	■	■
Alphabet Inc.	0.5%	BBB	■	■	■	■

Intensité des émissions de carbone ¹²⁾

Tonnes d'émissions en équivalent de CO2 par mio. de \$ de revenus
 Portefeuille: **86.0** / Indice de référence: **85.4**



Légende

5) Les notations ESG, fournies par MSCI ESG, se déclinent sur une échelle allant de AAA (notation la plus élevée) à CCC (notation la plus basse). La notation est fonction de l'exposition de l'entreprise concernée aux risques de durabilité spécifiques au secteur et de sa capacité à atténuer ces risques comparativement aux autres acteurs du secteur. La note globale du portefeuille est attribuée sur une base sectorielle relative. En revanche, pour les critères environnementaux (E), sociaux (S) et de gouvernance (G) individuels, il s'agit de notes absolues. La note globale ne peut donc pas être considérée comme une moyenne des notes E, S et G individuelles.

6) Pour plus d'informations sur les exclusions basées sur des normes qui sont appliquées, veuillez consulter: www.svkk-asir.ch © En l'absence de futures sur indice d'actions appropriés et/ou liquides sur des indices ESG, le compartiment/fonds peut utiliser des futures sur indice d'actions qui se réfèrent à des indices traditionnels (non ESG) pour réduire les différents risques, pour accroître l'efficacité de la gestion du portefeuille et comme moyen d'augmenter ou de diminuer l'exposition au marché.

7) Pour de plus amples informations sur la méthodologie suivie pour évaluer les caractéristiques ESG des investissements, veuillez consulter msci.com/our-solutions/esg-investing/

8) La note «Overall ESG Quality» (note globale Qualité ESG) ne correspond pas directement aux notes «Pillar» (notation par piliers) pour les critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de l'entreprise. Les notes «Pillar» sont déterminées sur une base absolue, alors que la note «Overall ESG Quality» est ajustée de manière à refléter l'exposition au risque de durabilité au niveau d'un secteur donné. Dans la mesure où les notations «Pillar» sont des notes absolues et que les notations Overall sont des notes relatives, ces dernières ne peuvent être calculées en faisant la moyenne des premières. Les thèmes ESG présentent une ventilation des notations E, S et G individuelles. Toutes les notations et leurs composantes sont déclinées sur une échelle de 0 à 10 (fournie par MSCI), où 0 correspond à «très faible» et 10 à «très élevé».

9) ESG Controversies Flag est conçu pour fournir une évaluation à jour et cohérente des controverses ESG impliquant des sociétés cotées en bourse et des émetteurs obligataires. Un cas de controverse est en général un événement ponctuel tel qu'une marée noire ou un accident, ou bien une allégation, par exemple de problèmes de sécurité sur un site de production. La couleur, du rouge au vert, indique le degré d'implication dans des controverses, allant de très élevé (rouge) à très faible (vert). La couleur grise indique qu'aucune donnée n'est disponible.

10) La notation ESG représente la ventilation de la notation ESG en pourcentage en termes absolus ou par rapport à un indice de référence.

11) Le score climatique du portefeuille représente la trajectoire du réchauffement climatique du portefeuille comparée à celle de l'indice de référence (si disponible) et la met en perspective avec d'importantes températures cibles. L'objectif central est de maintenir l'augmentation de la température moyenne mondiale à un niveau nettement inférieur à 2°C par rapport aux seuils préindustriels et de poursuivre les efforts pour limiter la hausse des températures à 1,5°C par rapport aux seuils préindustriels. La trajectoire de réchauffement climatique du portefeuille tient compte de la trajectoire de réchauffement climatique pondérée de toutes les positions du portefeuille. L'intensité carbone actuelle et future (scope 1 et 2) joue un rôle central dans ce calcul, de même que les revenus actuels et les prévisions de revenus verts.

12) L'intensité carbone compare l'intensité moyenne pondérée des émissions par million de dollars de chiffre d'affaires (ventilées par secteur GICS) entre le portefeuille et l'indice de référence. Elle présente également les pondérations actives du secteur GICS.

Contact

CREDIT SUISSE FONDATION DE PLACEMENT
Postfach 800, 8070 Zürich
Téléphone 044 333 48 48, Fax 044 333 59 67
csa.info@credit-suisse.com

Les informations fournies constituent un support marketing. Elles ne doivent pas être interprétées comme un conseil financier ou autre fondé sur la situation personnelle du destinataire ni comme le résultat d'une analyse indépendante et objective. Les informations fournies dans le présent document ne sont pas juridiquement contraignantes et ne constituent ni une offre ni une incitation visant à la conclusion de quelque transaction financière que ce soit.

Les informations fournies dans le présent document ont été élaborées par Credit Suisse Group AG et/ou ses filiales (ci-après CS) avec le plus grand soin et en toute bonne foi.

Les informations et les opinions exprimées dans le présent document reflètent celles du Credit Suisse au moment de la rédaction et sont sujettes à modification à tout moment sans préavis. Elles proviennent de sources considérées comme fiables.

Le CS ne fournit aucune garantie quant au contenu et à l'exhaustivité de ces informations et décline toute responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de l'utilisation de ces informations. Sauf mention contraire, les chiffres n'ont pas été vérifiés. Les informations fournies dans le présent document sont réservées au seul usage de son destinataire.

Il est interdit d'envoyer, d'introduire ou de distribuer ces informations ou une copie de celles-ci aux Etats-Unis ou de les remettre à une personne US (au sens de la Regulation S de l'US Securities Act de 1933, dans sa version amendée).

La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit du CS est interdite.

La composition d'indices de référence sur mesure et les explications complémentaires relatives aux indices de référence rattachés peuvent être obtenues auprès de la direction du fonds ou du représentant en Suisse.

Credit Suisse Fondation de placement, Zürich, est l'émetteur et le gestionnaire des produits CSF. Credit Suisse (Suisse) SA, Zürich, en est la banque dépositaire. Les statuts, le règlement et les directives de placement ainsi que le dernier rapport annuel et factsheet peuvent être obtenus gratuitement auprès de Credit Suisse Fondation de placement. Seules les institutions de prévoyance domiciliées en Suisse et exonérées d'impôts sont autorisées à investir directement dans des produits CSF.

Le Total Expense Ratio (TER) correspond à la somme des commissions et des frais qui sont imputés au fur et à mesure à l'actif moyen du fonds (charges d'exploitation). La valeur (ex ante) est exprimée en pourcentage de l'actif du fonds et anticipe la moyenne des douze prochains mois dans des conditions inchangées.

Copyright © 2021 Credit Suisse Group AG et/ou ses filiales. Tous droits réservés.