

CSA Mixta-BVG Index 75

(nach BVV 2 – Aktienquote überschritten)

Anlagepolitik

Die Anlagegruppe CSA Mixta-BVG Index 75 investiert indirekt über indexierte Anlagefonds weltweit in Aktien, in Schweizer Immobilien sowie in fest- und variabelverzinsliche Obligationen (z.T. inflationsgeschützt). Im Aktienbereich werden auch Strategiefonds eingesetzt, welche in ihrer Gewichtung bewusst von der Marktkapitalisierung abweichen, um Faktorprämien abzuschöpfen (bsp. Value, Quality) oder das Anlagerisiko zu reduzieren (bsp. Minimum Volatility). Der Anteil von Aktienanlagen beträgt zwischen 68% und 82%. Der abgesicherte Teil des Fremdwährungengagements liegt mindestens bei 75%. 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 weist einen durchschnittlichen Aktienanteil von 75% aus und überschreitet damit die nach Art. 55 BVV 2 vorgegebene Kategorienbegrenzung für Aktien. Aufgrund des erhöhten Aktienanteils beinhaltet dieses Produkt ein höheres Risiko als Vorsorgelösungen mit einem max. Aktienanteil von 50%. Alle andern Anlagevorschriften aus der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) und der Verordnung über die Anlagestiftungen (ASV) bleiben soweit anwendbar erfüllt.

Kennzahlen

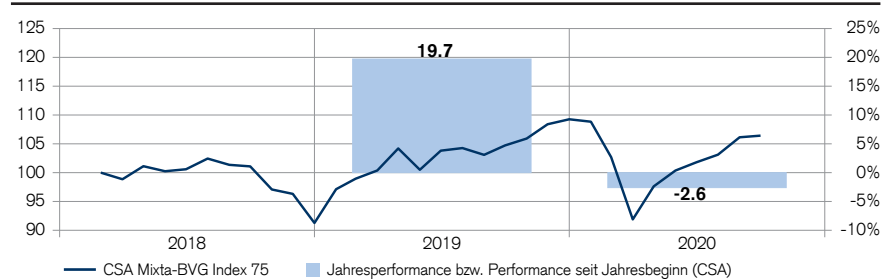
Investment Manager	Mehmet Besler
Investment Manager seit	13.02.2018
Standort Investment Manager	Zürich
Währung	CHF
Ende des Geschäftsjahres	30. Juni
Erstmission	13.02.2018
Pauschalgebühr in % p.a.	0.78
Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2020) in % p.a. 3)	0.98
Ausgabeaufschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in % 5)	0.13
Rücknahmeabschlag (verbleibt im Anlagevermögen) in % 5)	0.05
Zeichnung / Rücknahme	Täglich
Benchmark (BM)	CB CSA Mixta-BVG Index 75
Valoren-Nr.	38261472
ISIN	CH0382614722
Bloomberg Ticker	CSAB75B SW
Reuters	38261472X.CHE
Ertragsverwendung	Thesaurierung
Ausgabepreis	1'085.84
Rücknahmepreis	1'083.89
Anlagegruppenvermögen (in Mio.)	188.97

3) 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
Annualisierte Volatilität in %	15.63	-
Tracking Error (Ex post)	0.53	-
Tracking Error (Ex ante)	-	-
Maximaler Verlust in % 2)	-15.90	-
Sharpe Ratio	0.15	-
Beta	0.98	-

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

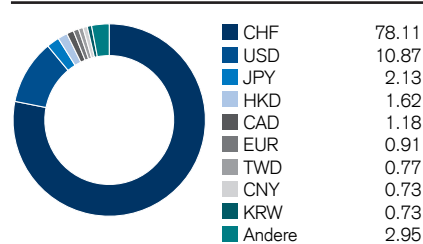


Netto-Performance in % berechnet in CHF 1)

	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	0.27	4.55	-2.60	1.62	-	-	-	-	-	8.44
Benchmark	0.21	5.02	-1.98	2.49	-	-	-	-	-	11.26

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

Währungen in % (nach Absicherung)



Benchmarkzusammensetzung in %

SBI AAA-BBB (TR)	8.00
Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	4.00
Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	8.00
SPI Multi Premia CHF (TR)	37.00
MSCI World Diversified Factor Mix (NR)	16.00
MSCI EM (NR)	6.00
MSCI World ex Switzerland (NR) (Hedged into CHF)	16.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Obligationen CHF	7.92	8.00	-0.08
Obligationen Fremdwährung abgesichert in CHF	7.80	8.00	-0.20
Inflationsindexierte Obligationen abgesichert in CHF	3.99	4.00	-0.01
Total Nominalwerte	19.71	20.00	
Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Aktien Schweiz	38.08	37.40	0.68
Aktien Europa	5.31	6.24	-0.93
Aktien USA	19.96	19.91	0.05
Aktien Kanada	1.64	1.10	0.54
Aktien Japan	3.33	3.35	-0.02
Aktien Pazifik ex Japan	1.19	1.23	-0.04
Aktien Emerging Markets	5.71	5.77	-0.06
Immobilien Schweiz	5.07	5.00	0.07
Total Sachwerte	80.29	80.00	

Laufzeit und Rendite

Modified Duration in Jahren 4) 8.51

4) Duration berechnet auf Obligationen.

Grösste Positionen

Position	Fälligkeit	in % d. Vermög.
Geberit		1.78
Kühne & Nagel		1.70
Givaudan		1.58
Swisscom		1.58
EMS Chemie		1.40
Sunrise Communications Group		1.18
Roche Holding AG		1.04
Tecan Group AG.		0.99
Logitech		0.97
UBS Swiss Mixed Sima		0.91
Total		13.12

5) Ab dem 1. Oktober 2020 beträgt der Ausgabeaufschlag 0.12% und der Rücknahmeabschlag 0.07%.

1) 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.

2) Maximaler Gesamtverlust innerhalb des Betrachtungszeitraumes, unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen. 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.

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 © 2020 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundenen Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.