

CSF Mixta-LPP Index 75

(quota azionaria superata ai sensi dell'OPP 2)

Politica d'investimento

Il gruppo d'investimento CSF 2 Mixta-LPP Index 75 investe indirettamente, tramite fondi d'investimento indicizzati, in azioni di tutto il mondo, nonché in titoli a tasso fisso e variabile (in parte protetti dall'inflazione). Nell'ambito delle azioni estere si fa ricorso anche a indici strategici che nella loro ponderazione deviano deliberatamente dalla capitalizzazione di mercato per cogliere i factor premium (p. es. value, quality) o ridurre il rischio di investimento (p. es. minimum volatility). La quota azionaria varia tra il 68% e l'82%. La parte dell'impegno in moneta estera con copertura ammonta almeno al 75%. Oltre all'ampia diversificazione (diverse categorie d'investimento che, a loro volta, investono in svariate migliaia di titoli singoli), il gruppo d'investimento si distingue per le basse spese amministrative (p. es. spese per ricerca e analisi finanziaria o costi di transazione).

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

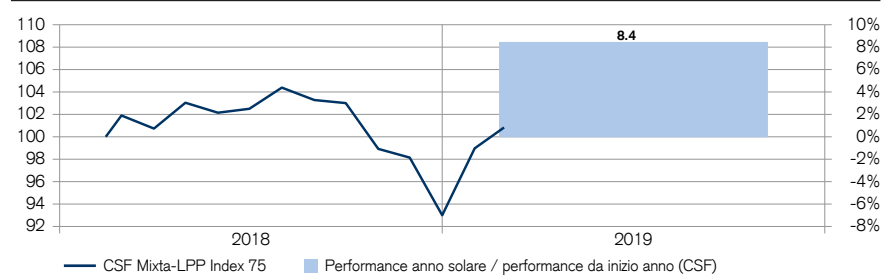
Responsabile di investimento	Mehmet Besler
Responsabile di investimento da allora	13.02.2018
Domicilio del gestore	Zurigo
Valuta base	CHF
Chiusura d'esercizio	30 giugno
Data di lancio	13.02.2018
Commissione forfettaria in % p.a.	0.78
TER ex ante in %	0.99
Issue fee (rimane nel patrimonio investito) in %	0.11
Redemption fee (rimane nel patrimonio investito) in %	0.05
Sottoscrizioni / Riscatti	Giornalieri
Benchmark (BM)	CB CSA Mixta-BVG Index 75
Numero di valore	38261472
Codice ISIN	CH0382614722
Codice Bloomberg	CSAB75B SW
Codice Reuters	38261472X.CHE
Utilizzo dei ricavi	Capitalizzazione
Prezzo d'emissione	1'009.42
Prezzo di riscatto	1'007.81
TNA del fondo strategico (in mio.)	52.44

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.

Indici statistici

	1 anno	3 anni	5 anni
Volatilità annualizzata in %	10.47	-	-
Tracking Error (Ex post)	0.23	-	-
Tracking Error (Ex ante)	-	-	-
Massima perdita in %	-10.91	-	-
Sharpe ratio	-0.10	-	-
Beta	1.01	-	-
Periodo di ripresa (in mesi)	-	-	-

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	5 anni	10 anni	ITD
							% p.a.	% p.a.	% p.a.	
CSF	1.88	2.74	8.42	-1.05	-	-	-	-	-	0.83
Benchmark	2.01	3.08	8.62	-0.12	-	-	-	-	-	1.93

¹⁾ Il Portfolio Manager mira a conseguire un obiettivo di rendimento in funzione della performance del benchmark, dedotti i costi di gestione.

Ripartizione del indice di riferimento 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 ex Switzerland (NR) (Hedged into CHF)	16.00
MSCI EM (NR)	6.00
MSCI World Factor Mix A-Series (NR)	16.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

¹⁾Dall'1.5.2019 la composizione del benchmark subirà un adeguamento. L'indice MSCI World Factor Mix A-Series (NR) sarà sostituito dall'indice MSCI World Diversified Factor Mix (NR). La ponderazione dell'indice resta invariata.

Duration e rendimento

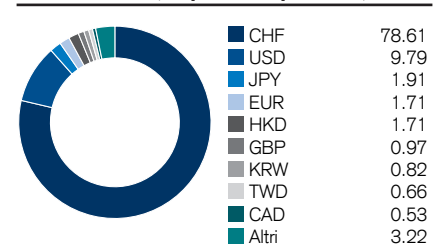
Modified duration in anni ³⁾	8.05
---	------

3) Duration calcolato sulle obbligazioni.

Posizioni principali

Principali posizioni	Scadenza	in % del totale
Nestle SA		1.39
Swisscom		1.32
SGS		1.16
Roche Holding AG		1.13
Sonova Holding		1.10
Lindt & Sprüngli		1.03
Novartis AG		1.01
PSP Swiss Property		1.01
Swiss Re		0.99
Zurich Insurance Group		0.99
Totale		11.13

Valute in % (dopo la copertura)



Categorie d'investimento in %

Valori nominali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Obbligazioni CHF	7.99	8.00	-0.01
Obbligazioni in valuta estera con copertura in CHF	7.99	8.00	-0.01
Obbligazioni indicizzate all'inflazione con copertura in CHF	3.99	4.00	-0.01
Totale valori nominali	19.97	20.00	

Valori reali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Azioni Svizzera	37.68	37.68	0.00
Azioni Europa	6.54	6.26	0.28
Azioni USA	18.59	19.32	-0.73
Azioni Canada	1.12	1.12	0.00
Azioni Giappone	3.26	2.94	0.32
Azioni Pacifico tranne Giappone	1.78	1.68	0.10
Azioni mercati emergenti	5.88	6.00	-0.12
Immobili Svizzera	4.97	5.00	-0.03
Totale valori reali	79.82	80.00	

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.