

Fortune mixte CSF Mixta-LPP Index

Ajustements de l'indice de référence et des marges de fluctuation, valables à partir du 1^{er} avril 2021



CREDIT SUISSE FONDATION DE PLACEMENT

Case postale 800
CH-8070 Zurich

1^{er} mars 2021

CREDIT SUISSE 

Benchmark et marges de fluctuation – *valables jusqu'au 31.03.2021*

CSF Mixta-LPP Index 25 (11.520.271)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB (TR)	45%	42%	48%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	10%	9%	11%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	15%	13%	17%
Total valeurs nominales		70%	64%	76%
Actions Suisse	SPI (TR)	10%	8%	12%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland IMI (NR)	15%	12%	18%
Total actions		25%	20%	30%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		15%	12%	18%
Biais domestique		60%	54%	66%

Benchmark et marges de fluctuation – *nouveaux dès le 01.04.2021*

CSF Mixta-LPP Index 25 (11.520.271)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB ESG (TR)	45%	42%	48%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability (TR) (CHF-H)	16%	14%	18%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	9%	8%	10%
Total valeurs nominales		70%	64%	76%
Actions Suisse	SPI ESG (TR)	10%	8%	12%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland ESG Leaders (NR)	13%	12%	18%
	MSCI World ex Switzerland Small Cap ESG Leaders (NR)	2%		
Total actions		25%	20%	30%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		15%	12%	18%
Biais domestique		60%	54%	66%
Part ESG		86%	80%	100%

Benchmark et marges de fluctuation – *valables jusqu'au 31.03.2021*

CSF Mixta-LPP Index 35 (11.520.273)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB (TR)	35%	32%	38%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	10%	9%	11%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	15%	13%	17%
Total valeurs nominales		60%	54%	66%
Actions Suisse	SPI (TR)	14%	12%	16%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland IMI (NR)	21%	18%	24%
Total actions		35%	30%	40%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		21%	18%	24%
Biais domestique		54%	48%	60%

Benchmark et marges de fluctuation – *nouveaux dès le 01.04.2021*

CSF Mixta-LPP Index 35 (11.520.273)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB ESG (TR)	35%	32%	38%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability (TR) (CHF-H)	16%	14%	18%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	9%	8%	10%
Total valeurs nominales		60%	54%	66%
Actions Suisse	SPI ESG (TR)	14%	12%	16%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland ESG Leaders (NR)	18%	18%	24%
	MSCI World ex Switzerland Small Cap ESG Leaders (NR)	3%		
Total actions		35%	30%	40%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		21%	18%	24%
Biais domestique		54%	48%	60%
Part ESG		86%	80%	100%

Benchmark et marges de fluctuation – *valables jusqu'au 31.03.2021*

CSF Mixta-LPP Index 45 (I) (10.382.676 et 11.269.573)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB (TR)	25%	22%	28%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	10%	9%	11%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	15%	13%	17%
Total valeurs nominales		50%	44%	56%
Actions Suisse	SPI (TR)	18%	16%	20%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland IMI (NR)	27%	24%	30%
Total actions		45%	40%	50%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		27%	24%	30%
Biais domestique		48%	42%	54%

Benchmark et marges de fluctuation – *nouveaux dès le 01.04.2021*

CSF Mixta-LPP Index 45 (I) (10.382.676 et 11.269.573)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB ESG (TR)	25%	22%	28%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability (TR) (CHF-H)	16%	14%	18%
Obligations ME (protégées de l'inflation) (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	9%	8%	10%
Total valeurs nominales		50%	44%	56%
Actions Suisse	SPI ESG (TR)	18%	16%	20%
Actions étrangères	MSCI AC World ex Switzerland ESG Leaders (NR) MSCI World ex Switzerland Small Cap ESG Leaders (NR)	23% 4%	24%	30%
Total actions		45%		
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		27%	24%	30%
Biais domestique		48%	42%	54%
Part ESG		86%	80%	100%

Benchmark et marges de fluctuation – *valables jusqu'au* *31.03.2021*

CSF Mixta-LPP Index 75 (38.261.482)

(selon OPP 2 – quote-part d'actions dépassée)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB (TR)	8%	7%	9%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays Global Aggr. ex CHF (TR) (CHF-H)	8%	7%	9%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	4%	3%	5%
Total valeurs nominales		20%	17%	23%
Actions suisses (stratégie)	SPI Multi Premia CHF (TR)	37%	35%	39%
Actions étrangères (stratégie)	MSCI World Diversified Factor Mix (NR)	16%	14%	18%
Actions étrangères (pays industrialisés) (avec couverture)	MSCI World ex Switzerland (NR) (Hedged into CHF)	16%	14%	18%
Actions étrangères (pays émergents)	MSCI EM (NR)	6%	5%	7%
Total actions		75%	68%	82%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		22%	19%	25%
Biais domestique		50%	46%	57%

Benchmark et marges de fluctuation – *nouveaux dès le 01.04.2021*

CSF Mixta-LPP Index 75 (38.261.482)

(selon OPP 2 – quote-part d'actions dépassée)

Catégories de placement	Indice	Benchmark	Marges de fluctuation en %	
		en %	min.	max.
Obligations CHF	SBI AAA-BBB ESG (TR)	8%	7%	9%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability (TR) (CHF-H)	8%	7%	9%
Obligations ME (avec couverture)	Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	4%	3%	5%
Total valeurs nominales		20%	17%	23%
Actions suisses (stratégie)	SPI Multi Premia CHF (TR)	37%	35%	39%
Actions étrangères (stratégie)	MSCI World ESG Leaders Minimum Volatility Index (NR)	16%	14%	18%
Actions étrangères (pays industrialisés) (avec couverture)	MSCI World ex Switzerland ESG Leaders hedged CHF (NR)	16%	14%	18%
Actions étrangères (pays émergents)	MSCI Emerging Markets ESG Leaders (NR)	6%	5%	7%
Total actions		75%	68%	82%
Immobilier suisse (fonds)	SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5%	4%	6%
Total immobilier		5%	4%	6%
Monnaies étrangères		22%	19%	25%
Biais domestique		50%	46%	57%
Part ESG (pas encore atteinte)		54%!	80%	100%