

Aperçu des conditions au 29.1.2019

Groupes/classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation	Méthode de décompte	Ecart/facteur swing**		Possibilité d'achat / de vente	Frac- tions	Souscrip- tion	Structure du portefeuille		Evaluation au cours de clôture		Publication des cours	Date de valeur
			TER _{CAFP} *		Report	Déport	Limite journalière		en mio. CHF	Placem. collectifs***	Placem. directs	Du jour de la transaction	Du jour suivant	Journal de la transaction + nb. de jours	Journal de la transaction + nb. de jours
Produits de placement à l'intention des investisseurs privés disposant de fonds de libre passage ou du pilier 3a															
<i>Portefeuilles mixtes</i>															
CSF Mixta-LPP Basic	1 486 149	CSABVGB SW	1,15	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Défensif	788 833	CSABVGD SW	1,24	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP	287 570	CSAMBVG SW	1,40	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Maxi	888 066	CSABVGM SW	1,51	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Equity 75 ¹³⁾	38 261 482	CSBE75B SW	1,57 ^{5) 11)}	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Index 25	11 520 271	CSAMI25 SW	0,89	Ecart	0,23	0,04	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
CSF Mixta-LPP Index 35	11 520 273	CSAMI35 SW	0,90	Ecart	0,20	0,04	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
CSF Mixta-LPP Index 45	10 382 676	CSAMI45 SW	0,90	Ecart	0,16	0,05	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
CSF Mixta-LPP Index 75 ¹³⁾	38 261 472	CSAB75B SW	0,98 ⁵⁾	Ecart	0,11	0,05	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
Produits de placement à l'intention des caisses de pension suisses au bénéfice de privilèges fiscaux															
<i>Portefeuilles mixtes</i>															
CSF Mixta-LPP Basic I	1 503 660	CSABVGL SW	0,50	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Basic L2	24 869 342	CSAMBL2 SW	0,48	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	25	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Basic L3	23 113 558	CSBVGL3 SW	0,45	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	50	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP I	2 733 319	CSABVGI SW	0,57	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	x	x	x	x	1	2	
CSF Mixta-LPP Index 45 I	11 269 573	CSAB45I SW	0,52	Ecart	0,16	0,05	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
CSF LPP 25-45 Dynamic I	30 725 295	CSB254I SW	0,70	Ecart	0,09	0,02	12h00	oui	x	x	x	x	2	3	
<i>Portefeuilles à taux fixe</i>															
CSF Money Market CHF	287 500	CSAGMCH SW	0,09	VNI	0,00	0,00	13h30	non	x	x	x	x	1	1	
CSF Swiss Bonds CHF	287 565	CSAOWSW SW	0,25	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Short Term Bonds CHF	2 070 709	CSAOSTC SW	0,20	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Foreign Bonds CHF	287 571	CSAOWBAU SW	0,20	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Mid Yield Bonds CHF	1 082 332	CSAOWBY SW	0,25	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Inflation Linked Bonds CHF	1 764 678	CSAILBC SW	0,30	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF International Bonds	287 566	CSAOWBAF SW	0,30	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Global Bonds Hedged	10 399 033	CSAOWFRM SW	0,43	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Global Bonds Hedged L	11 269 640	CSAOWFHI SW	0,35	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	10	x	x	x	1	2	
CSF Global Corporate Bonds Hedged	13 953 439	CSAGCHA SW	0,54	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Bonds EUR	287 501	CSAOWBEU SW	0,30	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Bonds USD	392 578	CSAOWBUS SW	0,35	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Equity Linked Bonds	287 572	CSAOWLBP SW	0,80	SSP	0,34	0,27	16h30	non	x	x	x	x	1	3	
CSF Low-Risk Bond Strategy CHF E ¹⁴⁾	43 663 477		0,15	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	oui	x	x	x	x	1	2	
<i>Portefeuilles d'actions (gestion active)</i>															
CSF Equity Switzerland	287 567	CSAAKTS SW	0,72	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Equity Switzerland L	4 541 793	CSAAKTI SW	0,61	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	10	x	x	x	1	2	
CSF Equity Small & Mid Cap Switzerland	1 039 194	CSASMCS SW	0,85	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	14h30	non	x	x	x	x	1	2	
CSF Equity Small & Mid Cap Switzerland L	3 181 053	CSASMCI SW	0,65	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	14h30	non	10	x	x	x	1	2	
CSF Fund Selection Equity Switzerland	10 733 071	CSAESWZ SW	0,89	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	x	x	x	x	2	3	
CSF Fund Selection Equity Switzerland L	10 734 846	CSAESWI SW	0,79	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	10	x	x	x	2	3	
CSF Fund Selection Equity Europe	287 502	CSAAKEU SW	1,51	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	x	x	x	x	2	3	
CSF Fund Selection Equity Europe L	1 957 973	CSAKEUI SW	1,41	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	10	x	x	x	2	3	
CSF Fund Selection Equity USA	12 701 578	CSSEUSA SW	1,10	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	x	x	x	x	2	3	
CSF Fund Selection Equity Dragon Countries	135 404	CSAAKDR SW	1,79	SSP	0,60	0,15	11h00	non	x	x	x	x	1	3	
CSF Fund Selection Equity Emerging Markets	1 062 835	CSAAKEM SW	1,79	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h30	non	x	x	x	x	2	3	

Aperçu des conditions au 29.1.2019

Groupes/classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation	Méthode de décompte	Ecart/facteur swing**		Possibilité d'achat / de vente	Frac-tions	Souscrip-tion minimale	Structure du portefeuille		Evaluation au cours de clôture		Publication des cours	Date de valeur
			TER _{CAFF} *		Report	Déport	Limite journalière		en mio. CHF	Placem. collectifs***	Placem. directs	Du jour de la transaction	Du jour suivant	Jour de la transaction + nb. de jours	Jour de la transaction + nb. de jours
Portefeuilles d'actions (gestion passive)															
CSF Swiss Index	887 912	CSASWIX SW	0,35	Ecart	0,01	0,01	13h00	non		x	x			1	2
CSF Swiss Index L	1 870 547	CSASWII SW	0,25	Ecart	0,01	0,01	13h00	non	5	x	x			1	2
CSF Euro Index	349 349	CSAEUIX SW	0,41	Ecart	0,27	0,03	13h00	non		x	x			1	2
CSF Euro Index L	1 870 549	CSAEUII SW	0,30	Ecart	0,27	0,03	13h00	non	5	x	x			1	2
CSF Nippon Index	349 351	CSANIIX SW	0,57	Ecart	0,03	0,03	15h00	non		x		x		2	3
CSF Nippon Index L	1 870 546	CSANIII SW	0,45	Ecart	0,03	0,03	15h00	non	5	x		x		2	3
Portefeuilles hypothécaires / immobiliers															
CSF Hypothèques Suisse	287 573	CSAHYPO SW	0,43	Ecart	0,25	0,25	seulement rachats	non			x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland	1 312 300	CSAIMM2 SW	0,56 ²⁾	Ecart	0,40 ⁷⁾	0,40	seulement rachats ⁶⁾	non			x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland M¹⁾	39 836 446	CSRESWM SW	0,16 ^{2) 9)}	Ecart	0,40 ⁷⁾	0,40	seulement rachats ⁶⁾	non	800		x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland Residential	2 522 609	CSRESWN SW	0,56 ²⁾	Ecart	0,40 ⁷⁾	0,40	seulement rachats ⁶⁾	non			x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland Commercial	11 354 362	CSARESC SW	0,54 ²⁾	Ecart	0,40 ⁷⁾	0,40	seulement rachats ⁶⁾	non			x	x		1	2
CSF Real Estate Germany	23 547 751	CSAREGE SW	0,85 ²⁾	Ecart	1,00	1,00	trimestriel ³⁾	oui			x	x		³⁾	³⁾
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments	3 108 145	CSARESA SW	1,24	SSP	0,20	0,20	14h00	non			x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments L	3 109 433	CSARESI SW	1,14	SSP	0,20	0,20	14h00	non	10		x	x		1	2
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments M¹⁾	20 025 324	CSARESI SW	0,60 ¹²⁾	SSP	0,20	0,20	14h00	non			x	x		1	2
Portefeuilles de valeurs alternatives															
CSF Insurance Linked Strategies	1 603 633	CSAIDLX SW	1,32	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui			x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies L	10 157 421	CSAIDXI SW	1,12	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	10		x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies L2	14 690 467	CSAILL2 SW	0,91	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	25		x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies L3	32 772 314	CSAILL3 SW	0,80	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	50		x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies Fixed A	37 362 632	CSAILSA SW	1,50 ⁹⁾	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui			x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L	37 362 637	CSAILFL SW	1,31 ⁹⁾	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	10		x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L2	37 362 640	CSAIFL2 SW	1,10 ⁹⁾	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	25		x	x		****	****
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L3	37 362 648	CSAIFL3 SW	0,99 ¹⁰⁾	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr.	oui	50		x	x		****	****
CSF Infrastructures énergétiques Suisse L	22 656 688	–	1,79	Ecart	0,00	3,00	seulement rachats ³⁾	oui	5		x	x		³⁾	³⁾
CSF Infrastructures énergétiques Suisse M¹⁾	35 328 307	–	0,17	Ecart	0,00	3,00	seulement rachats ³⁾	oui	200		x	x		³⁾	³⁾
Actif immobilisé avec remboursement du capital															
CSF Mezzanine	2 314 683	CSAMEZZ SW	2,61	Ecart	0,50	1,50	fermé	non			x	x		1	3

Méthodes de décompte

VNI = décompte à la valeur nette d'inventaire sans supplément d'émission ou décote de rachat.

Ecart = décompte à la valeur nette d'inventaire avec un supplément d'émission ou une décote de rachat.

SSP = Swinging Single Pricing = décompte au prix swing sur la base d'un facteur swing prélevé, en cas de constellation maître-nourricier, dans le fonds sous-jacent sur les investissements directs dans le groupe de placement.

Ce facteur est vérifié périodiquement et adapté le cas échéant.

Prix d'émission = prix de rachat = VNI plus facteur swing en cas de souscriptions nettes le jour de transaction.

Prix d'émission = prix de rachat = VNI moins facteur swing en cas de rachats nets le jour de transaction.

* Sauf indication contraire, le TER sous-jacent est le TER_{CAFF}. Par contre, il s'agit du TER_{ISA} usuel dans le segment immobilier dans le cas des groupes de placement CSF Real Estate Switzerland. Les deux concepts de taux de charges TER sont reconnus par la CHS PP.

** Ecart/facteur swing = supplément d'émission ou décote de rachat en % de la valeur nette d'inventaire. L'écart/facteur swing vise à répercuter les coûts de transaction occasionnés par les achats et les ventes sur les auteurs de ces coûts et reste dans la fortune.

*** Groupes de placement CSF et fonds de placement du Credit Suisse Funds AG et d'autres prestataires autorisés en Suisse.

**** Les chiffres à la clôture et à la date de valeur sont publiés.

¹⁾ M = classe de mandat. La commission n'est pas débitée au niveau de la classe d'actifs, mais dans le cadre du contrat d'investissement.

²⁾ Le calcul du taux de charges d'exploitation (TER_{ISA}) se base sur la fortune moyenne totale (TER_{ISA} FTP). Concernant le TER_{ISA} VNI, se référer à l'annexe page 88.

³⁾ Selon le chiffre 6 du prospectus.

⁴⁾ S'agissant des fonds sous-jacents, les calculs sont effectués selon les principes du SSP.

⁵⁾ La valeur TER_{CAFF} indiquée se rapporte à la période du 12.02.2018–30.6.2018 et a été annualisée.

⁶⁾ Selon le chiffre 5 du prospectus.

⁷⁾ Le montant du supplément d'émission sera fixé à chaque ouverture et publié à l'avance.

⁸⁾ La valeur TER_{ISA} indiquée se rapporte à la période du 01.02.2018–30.6.2018 et a été annualisée.

⁹⁾ La valeur TER_{CAFF} indiquée se rapporte à la période du 31.07.2017–30.6.2018 et a été annualisée.

¹⁰⁾ La valeur TER_{CAFF} indiquée se rapporte à la période du 31.05.2018–30.6.2018 et a été annualisée.

¹¹⁾ Le groupe de placement se trouve en phase de constitution, raison pour laquelle la valeur TER_{CAFF} indiquée est plus élevée.

¹²⁾ Le taux de charges d'exploitation correspond exclusivement aux coûts synthétiques pondérés des fonds cibles utilisés.

¹³⁾ Uniquement pour les fondations du pilier 3a.

¹⁴⁾ Les classes «E» sont réservées aux institutions de prévoyance (fondations 1e) qui, conformément à l'art. 1e OPP2, assurent exclusivement la partie de salaire supérieure à une fois et demie le montant-limite supérieur fixé à l'art. 8, al. 1 LPP.

Aperçu des conditions au 29.1.2019

Groupes / classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation TER _{CAFF} *	Méthode de décompte	Ecart/facteur swing**		Possibilité d'achat / de vente	Frac-tions	Souscription minimale	Structure du portefeuille		Evaluation au cours de clôture		Publication des cours	Date de valeur
					Report	Déport	Limite journalière	en mio. CHF	Placem. collectifs***	Placem. directs	Du jour de la transaction	Du jour suivant	Jour de la transaction + nb. de jours	Jour de la transaction + nb. de jours	
Portefeuilles mixtes															
CSF 2 Mixta-LPP 25	887 902	CSABV25 SW	0,52	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 25 E⁵⁾	43 665 396		0,45	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 25 Plus	11 217 285	CSAMIXA SW	0,62	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 35	887 904	CSABV35 SW	0,56	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 35 E⁵⁾	43 665 406		0,45	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 45	887 909	CSABV45 SW	0,59	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 45 E⁵⁾	43 665 413		0,45	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		×		×		1	2
CSF 2 Mixta-LPP 45 L3	23 113 662	CSABVL3 SW	0,41	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	50	×		×		1	2
CSA 2 Mixta-LPP Index 25 E⁵⁾	43 665 425		0,20	VNI	0,23	0,04	12h00	oui		×			×	2	3
CSA 2 Mixta-LPP Index 35 E⁵⁾	43 665 431		0,20	VNI	0,20	0,04	12h00	oui		×			×	2	3
CSA 2 Mixta-LPP Index 45 E⁵⁾	43 668 934		0,20	VNI	0,18	0,05	12h00	oui		×			×	2	3
CSA 2 Mixta-LPP Index 75 E⁵⁾	43 668 938		0,22	VNI	0,11	0,05	12h00	oui		×			×	2	3
Portefeuilles Immobiliers															
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global A	32 336 250	CSAMREA SW	2,37 ^{3) 4)}	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui		×		×		²⁾	²⁾
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global L	32 336 252	CSAMREL SW	2,24 ^{3) 4)}	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui	10	×		×		²⁾	²⁾
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global M	32 336 258	CSAMREM SW	1,62 ³⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui	20	×		×		²⁾	²⁾
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global S	32 336 245	CSAMRES SW	2,18 ³⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui		×		×		²⁾	²⁾
Portefeuilles d'actions (gestion passive)															
CSF 2 World Index	1 915 891	CSAWORL SW	0,53	Ecart	0,10	0,04	15h00	non		×		×		2	3
CSF 2 World Index L	1 916 740	CSAWORI SW	0,42	Ecart	0,10	0,04	15h00	non	5	×		×		2	3
CSF 2 US Index	349 353	CSAUSIX SW	0,41	Ecart	0,03	0,03	13h00	non		×		×		1	2
CSF 2 US Index L	1 916 281	CSAUSII SW	0,30	Ecart	0,03	0,03	13h00	non	5	×		×		1	2
Portefeuilles de valeurs alternatives															
CSF 2 Private Equity	1 137 822	CSAPREQ SW	5,11 ¹⁾	Ecart	1,00	1,00	trimestriel	non		×	×	×		****	****

Méthodes de décompte

VNI = décompte à la valeur nette d'inventaire sans supplément d'émission ou décote de rachat.

Ecart = décompte à la valeur nette d'inventaire avec un supplément d'émission ou une décote de rachat.

* Sauf indication contraire, le TER sous-jacent est le TER_{CAFF}. Dans le cas de CSF 2 Private Equity, le TER publié est le TER_{CHS}, pour lequel les coûts ont été calculés selon la Directive pour le calcul et la publication des frais applicables aux placements collectifs investis sur les marchés privés de la SECA. Les deux concepts de taux de charges d'exploitation TER sont reconnus par la CHS PP.

** Ecart = supplément d'émission ou décote de rachat en % de la valeur nette d'inventaire. L'écart vise à répercuter les coûts de transaction occasionnés par les achats et les ventes sur les auteurs de ces coûts et reste dans la fortune.

*** Groupes de placement CSF et CSF 2 ainsi que fonds de placement de Credit Suisse Funds AG et d'autres prestataires autorisés en Suisse.

**** Les chiffres à la clôture et à la date de valeur sont publiés.

¹⁾ TER_{CHS} au 30.6.2017: les coûts ont été calculés selon la Directive pour le calcul et la publication des frais applicables aux placements collectifs investis sur les marchés privés de la SECA et mis en relation avec la fortune nette pour le calcul du TER_{CHS}. Au moment de la publication, le TER définitif au 30.6.2018 n'était pas encore disponible. Il sera présenté dans la fact sheet dès qu'il sera disponible (au plus tard le 31.12.2018).

²⁾ Selon le chiffre 6 du prospectus.

³⁾ Le groupe de placement ainsi que certains fonds cibles se trouvent en phase de constitution, raison pour laquelle la valeur TER_{CAFF} indiquée est plus élevée. La valeur prend en compte les TER des fonds cibles utilisés conformément aux comptes annuels vérifiés ou aux documents de référence des fonds. Les frais totaux sur encours (TER) des fonds cibles utilisés sont indiqués conformément à la définition de la INREV (European Association for Investors in Non-Listed Real Estate Vehicles) ou d'autres concepts de taux de charges TER spécifiques à certains pays.

⁴⁾ La valeur TER_{CAFF} indiquée se rapporte à la période du 3.7.2017-30.6.2018 et a été annualisée.

⁵⁾ Les classes «E» sont réservées aux institutions de prévoyance (fondations 1e) qui, conformément à l'art. 1e OPP2, assurent exclusivement la partie de salaire supérieure à une fois et demie le montant-limite supérieur fixé à l'art. 8, al. 1 LPP.