

Aperçu des conditions au 2.12.2020

Groupes/classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation	Méthode de dé-compte	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 _{CAFP} *		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
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-BVG Basic	1 486 149	CSFBVGB SW	1,16	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Défensiv	788 833	CSFBVGD SW	1,21 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG	287 570	CSFMBVG SW	1,38 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Maxi	888 066	CSFBVGM SW	1,49 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Equity 75	38 261 482	CSBE75B SW	1,54 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Index 25	11 520 271	CSFM25 SW	0,89	Ecart	0,22	0,04	12h00	oui		x			x	2	3
CSF Mixta-BVG Index 35	11 520 273	CSFM35 SW	0,90 ⁸⁾	Ecart	0,19	0,04	12h00	oui		x			x	2	3
CSF Mixta-BVG Index 45	10 382 676	CSFM45 SW	0,90 ⁸⁾	Ecart	0,16	0,05	12h00	oui		x			x	2	3
CSF Mixta-BVG Index 75	38 261 472	CSFB75B SW	0,98 ⁸⁾	Ecart	0,12	0,07	12h00	oui		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-BVG Basic I	1 503 660	CSFBVGL SW	0,51	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Basic L2	24 869 342	CSFM2L SW	0,48	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	25	x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Basic L3	23 113 558	CSBVGL3 SW	0,47	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	50	x		x		1	2
CSF Mixta-BVG I	2 733 319	CSFBVGI SW	0,56 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG 15 E ⁷⁾	45 868 145	CSMB15E SW	0,51 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG 15 Plus E ⁷⁾	43 663 719	CSFM15E SW	0,59 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG 15 Plus I	46 329 594	CSFM15I SW	0,67 ⁸⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x		x		1	2
CSF Mixta-BVG Index 45 I	11 269 573	CSFB45I SW	0,52 ⁸⁾	Ecart	0,16	0,05	12h00	oui		x			x	2	3
CSF BVG 25-45 Dynamic I	30 725 295	CSB254I SW	0,73	Ecart	0,09	0,02	12h00	oui		x			x	2	3
<i>Portefeuilles à taux fixe</i>															
CSF Money Market CHF	287 500	CSFGMCH SW	0,09	VNI	0,00	0,00	11h00	non		x		x		1	1
CSF Low-Risk Strategy CHF E ⁷⁾	43 663 477	CSFLRCESW	0,16	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	oui		x		x		1	2
CSF Swiss Bonds CHF	287 565	CSFOBSW SW	0,25	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Short Term Bonds CHF	2 070 709	CSFOSTC SW	0,21	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Foreign Bonds CHF	287 571	CSFOBAU SW	0,20	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Mid Yield Bonds CHF	1 082 332	CSFOBY SW	0,25	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Inflation Linked Bonds CHF	1 764 678	CSFILBC SW	0,31	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF International Bonds	287 566	CSFOBAF SW	0,30	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Global Bonds Hedged	10 399 033	CSFOFRM SW	0,43	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Global Bonds Hedged L	11 269 640	CSFOFHI SW	0,36	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	10	x		x		1	2
CSF Global Corporate Bonds Hedged	13 953 439	CSFGCHA SW	0,54	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Equity Linked Bonds	287 572	CSFELBP SW	0,65 ⁸⁾	SSP	0,45	0,45	16h30	non			x	x		1	3
<i>Portefeuilles d'actions (gestion active)</i>															
CSF Equity Switzerland	287 567	CSFAKTS SW	0,72	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non		x		x		1	2
CSF Equity Switzerland L	4 541 793	CSFAKTI SW	0,61	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	15h30	non	10	x		x		1	2
CSF Equity Small & Mid Cap Switzerland	1 039 194	CSFSMCS SW	0,85	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	14h30	non		x		x		1	2
CSF Equity Small & Mid Cap Switzerland L	3 181 053	CSFSMCI SW	0,65	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	14h30	non	10	x		x		1	2
CSF Fund Selection Equity Switzerland	10 733 071	CSFESWZ SW	0,87	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non		x		x		2	3
CSF Fund Selection Equity Switzerland L	10 734 846	CSFESWI SW	0,77	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non	10	x		x		2	3
CSF Fund Selection Equity Europe	287 502	CSFAKEU SW	1,56	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non		x		x		2	3
CSF Fund Selection Equity Europe L	1 957 973	CSFKEUI SW	1,46	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non	10	x		x		2	3
CSF Fund Selection Equity USA	12 701 578	CSSEUSA SW	0,91	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non		x		x		2	3
CSF Fund Selection Equity Dragon Countries	135 404	CSFAKDR SW	1,58 ⁸⁾	SSP	0,15	0,26	10h00	non		x		x		1	3
CSF Fund Selection Equity Emerging Markets	1 062 835	CSFAKEM SW	1,62	VNI ⁴⁾	0,00	0,00	10h00	non		x		x		2	3

Aperçu des conditions au 2.12.2020

Groupes/classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation	Méthode de dé-compte	Ecart/facteur swing**		Possibilité d'achat/de vente	Fractions	Souscription minimale	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		
Portefeuilles d'actions (gestion passive)															
CSF Swiss Index	887 912	CSASWIX SW	0,36	Ecart	0,02	0,02	13h00	non		x	x	x	1	2	
CSF Swiss Index L	1 870 547	CSASWII SW	0,25	Ecart	0,02	0,02	13h00	non	5	x	x	x	1	2	
CSF Nippon Index	349 351	CSANIX SW	0,52	Ecart	0,03	0,03	15h00	non		x		x	2	3	
CSF Nippon Index L	1 870 546	CSANII SW	0,41	Ecart	0,03	0,03	15h00	non	5	x		x	2	3	
Portefeuilles hypothécaires /immobiliers															
CSF Hypotheken Schweiz	287 573	CSAHYPO SW	0,43	Ecart	0,25	0,25	seulement rachats	oui		x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland	1 312 300	CSAIMM2 SW	0,53 ²⁾	Ecart	6)	0,40	seulement rachats ⁵⁾	oui		x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland M ¹⁾	39 836 446	CSRESWM SW	0,15 ²⁾	Ecart	6)	0,40	seulement rachats ⁵⁾	oui	800	x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland Residential	2 522 609	CSRESDN SW	0,55 ²⁾	Ecart	6)	0,40	seulement rachats ⁵⁾	oui		x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland Commercial	11 354 362	CSARESC SW	0,52 ²⁾	Ecart	6)	0,40	seulement rachats ⁵⁾	oui		x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Germany	23 547 751	CSAREGESW	0,79 ²⁾	Ecart	1,00	1,00	trimestriel ³⁾	oui		x	x	x	3)	3)	
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments	3 108 145	CSARESA SW	1,23	SSP	0,20	0,20	14h00	non		x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments L	3 109 433	CSARESI SW	1,13	SSP	0,20	0,20	14h00	non	10	x	x	x	1	2	
CSF Real Estate Switzerland Pooled Investments M	20 025 324	CSARESM SW	0,58	SSP	0,20	0,20	14h00	non	20	x	x	x	1	2	
Portefeuilles de valeurs alternatives															
CSF Insurance Linked Strategies	1 603 633	CSAIDLX SW	1,16	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui		x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies L	10 157 421	CSAIDXI SW	0,96	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	10	x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies L2	14 690 467	CSAILL2 SW	0,75	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	25	x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies L3	32 772 314	CSAILL3 SW	0,65	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	50	x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies Fixed A	37 362 632	CSAILSA SW	1,51	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui		x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L	37 362 637	CSAILFL SW	1,29	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	10	x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L2	37 362 640	CSAIFL2 SW	1,10	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	25	x	x	x	3)	3)	
CSF Insurance Linked Strategies Fixed L3	37 362 648	CSAIFL3 SW	0,99	VNI	0,00	0,00	mens./trimestr. ³⁾⁹⁾	oui	50	x	x	x	3)	3)	
CSF Energie-Infrastruktur Schweiz A	35 328 126	---	2,19	Ecart	0,00	3,00	seulement rachats ³⁾	oui	1		x	x	3)	3)	
CSF Energie-Infrastruktur Schweiz L	22 656 688	---	1,68	Ecart	0,00	3,00	seulement rachats ³⁾	oui	5		x	x	3)	3)	
CSF Energie-Infrastruktur Schweiz M ¹⁾	35 328 307	---	0,06	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	1,81	n/a	n/a	n/a	fermé	non		x	x	x			

Méthodes 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_{CAFP}. 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 ainsi que des placements collectifs de Credit Suisse Funds AG et d'autres prestataires autorisés en Suisse.

- 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).
- 3) Selon le chiffre 6 du prospectus.
- 4) S'agissant des fonds sous-jacents, les calculs sont effectués selon les principes du SSP.
- 5) Selon le chiffre 5 du prospectus.
- 6) Le montant du supplément d'émission sera fixé à chaque ouverture et publié à l'avance.
- 7) 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. 1LPP.
- 8) La valeur TER_{CAFP} indiquée contient des frais supplémentaires de banques dépositaires externes.
- 9) Fermé temporairement en raison de l'incertitude de l'évaluation.

Aperçu des conditions au 2.12.2020

Groupes/classes de placement	N° de valeur	Code Bloomberg	Taux de charges d'exploitation	Méthode de dé-compte	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
			TER _{CAFP} *		Report	Déport	Limite journalière	en mio. CHF	Placem. collectifs***	Placem. directs	de la transaction	Du jour suivant	transaction + nb. de jours	transaction+ nb. de jours	
Portefeuilles mixtes															
CSF 2 Mixta-BVG 25	887 902	CSFBV25 SW	0,47 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 25 E ⁵⁾	43 665 396	CS2M25E SW	0,43 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 25 Plus	11 217 285	CSFMIXA SW	0,65 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 25 Plus E ⁵⁾	43 663 749	CSFMIXE SW	0,56 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 35	887 904	CSFBV35 SW	0,52 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 35 E ⁵⁾	43 665 406	CS2M35E SW	0,43 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 45	887 909	CSFBV45 SW	0,59 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 45 E ⁵⁾	43 665 413	CS2M45E SW	0,45 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 45 L3	23 113 662	CSFBVL3 SW	0,41 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui	50	x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG 75 E ⁵⁾	43 665 420	CS2M75E SW	0,55 ⁴⁾	VNI	0,00	0,00	12h00	oui		x	x	x	1	2	
CSF 2 Mixta-BVG Index 25 E ⁵⁾	43 665 425	CS2I25E SW	0,20	Ecart	0,23	0,04	12h00	oui		x	x	x	2	3	
CSF 2 Mixta-BVG Index 35 E ⁵⁾	43 665 431	CS2I35E SW	0,20	Ecart	0,20	0,04	12h00	oui		x	x	x	2	3	
CSF 2 Mixta-BVG Index 45 E ⁵⁾	43 668 934	CBC245E SW	0,20	Ecart	0,18	0,05	12h00	oui		x	x	x	2	3	
CSF 2 Mixta-BVG Index 75 E ⁵⁾	43 668 938	CS2I75E SW	0,22	Ecart	0,12	0,05	12h00	oui		x	x	x	2	3	
Portefeuilles Immobiliers															
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global A	32 336 250	CSFMREA SW	2,37 ³⁾⁴⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui		x	x	x	2)	2)	
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global L	32 336 252	CSFMREL SW	2,23 ³⁾⁴⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui	10	x	x	x	2)	2)	
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global M ⁵⁾	32 336 258	CSFMREM SW	1,61 ³⁾⁴⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui	20	x	x	x	2)	2)	
CSF 2 Multi-Manager Real Estate Global S ⁵⁾	32 336 245	CSFMRES SW	2,15 ³⁾⁴⁾	Ecart	0,00	2,00	trimestriel ²⁾	oui		x	x	x	2)	2)	
Portefeuilles d'actions (gestion passive)															
CSF 2 World Index	1 915 891	CSFWORL SW	0,54 ⁴⁾	Ecart	0,10	0,04	15h00	non		x	x	x	2	3	
CSF 2 World Index L	1 916 740	CSFWORI SW	0,44 ⁴⁾	Ecart	0,10	0,04	15h00	non	5	x	x	x	2	3	
Portefeuilles de valeurs alternatives															
CSF 2 Private Equity	1 137 822	CSFPREQ SW	6,29 ¹⁾	Ecart	1,00	5,00	trimestriel ⁷⁾	non		x	x	x	7)	7)	

Méthodes dedécompte

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_{CAFP}.

** 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 des placements collectifs de Credit Suisse Funds AG et d'autres prestataires autorisés en Suisse.

1) TER_{CAFP} au 30.6.2019: au moment de la publication, le TER définitif au 30.6.2020 n'était pas encore disponible. Il sera présenté dans la fact sheet dès qu'il sera disponible (au plus tard le 31.12.2020).

2) Selon le chiffre 6 du prospectus.

3) La valeur prend en compte les TER des fonds cibles utilisés conformément aux comptes annuels vérifiés ou 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_{CAFP} indiquée contient des frais supplémentaires de banques dépositaires externes.

5) Les classes «E» sont réservées aux institutions de prévoyance (fondations 1e) qui, conformément à l'art. 1e OPP 2, assurent exclusivement la partie du salaire supérieure à une fois et demie le montant maximal fixé à l'art. 8, al. 1LPP.

6) Cette classe «S» est limitée aux investisseurs qui ont pris un engagement de versement de capital en vue du lancement du groupe de placement, sous réserve et à hauteur de l'ensemble de l'engagement de versement de capital pris à l'époque.

7) Selon le chiffre 5 du prospectus.

8) 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.