

CSA Mixta-BVG Basic I

(nach BVV 2 – Immobilienquote kann überschritten werden)*

Anlagepolitik

Das Anlageziel der Anlagegruppe ist die Erzielung eines der Risikostruktur entsprechenden Ertrages in CHF. Zu diesem Zweck investiert die Anlagegruppe über kollektive Anlagen in fest- und variabel verzinsliche Geldmarktanlagen, Obligationen und Schuldverschreibungen, sowie in Schweizer Hypotheken und Immobilien. Der Anteil an Immobilien und Hypotheken beträgt mindestens 45% des Anlagegruppenvermögens. Fremdwährungsanlagen werden möglichst umfassend gegen Schweizer Franken abgesichert.

Die Anlagegruppe erfüllt soweit anwendbar die Anlagevorschriften aus der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) und der Verordnung über die Anlagestiftungen (ASV).

* Mit Bezug auf Art. 29 Abs. 1 Bst. e ASV und die Anlagerichtlinien der Credit Suisse Anlagestiftung kann ab dem 1.12.2022 die Kategorienbegrenzung für Immobilien nach BVV 2 überschritten werden.

Kennzahlen

Investment Manager

Christoph Christen, Roger Düggelein

Investment Manager seit 31.12.2007, 31.12.2011

Standort Investment Manager Zürich, Zürich

Währung CHF

Mindestinvestition (Anspruch) 1

Ende des Geschäftsjahres 30. Juni

Erstmission 28.10.2002

Betriebsaufwandquote TER KGAST 0.49

(per 30.06.2023) in % p.a.

Zeichnung / Rücknahme Täglich

Benchmark (BM) CB CSA Mixta-BVG Basic I

Valoren-Nr. 1503660

ISIN CH0015036608

Bloomberg Ticker CSABVGL SW

Reuters 1503660X.CHE

Ertragsverwendung Thesaurierung

Anspruchsklassenvermögen (in Mio.) 163.33

Ausgabepreis 1'472.27

Rücknahmepreis 1'472.27

Anlagegruppenvermögen (in Mio.) 827.63

Statistische Kennzahlen

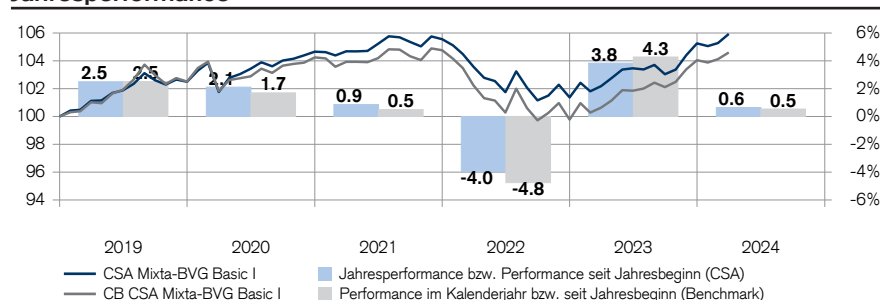
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Annualisierte Volatilität in %	1.61	2.16	1.66
Information Ratio	-0.48	0.42	-0.01
Tracking Error (Ex post)	0.56	0.55	0.60
Tracking Error (Ex ante)	0.27	-	-
Maximaler Verlust in % ²⁾	-0.65	-4.35	-4.35
Sharpe Ratio	1.23	0.46	0.92
Beta	1.21	0.88	0.82
Alpha	-0.06	0.03	0.03
Erholungsphase (in Monaten)	2	18	18

Laufzeit und Rendite*

Bruttoportefeuillerendite in %	1.28
Modified Duration in Jahren ²⁾	7.79

*Berechnet auf Obligationen.

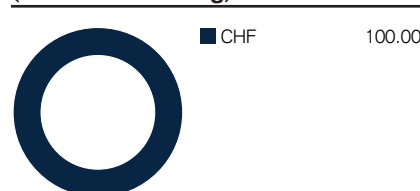
Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance ¹⁾



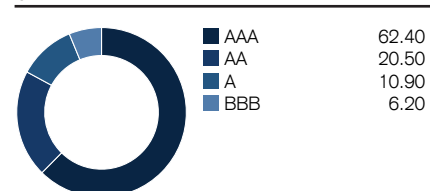
Netto-Performance in % berechnet in CHF ¹⁾

	1 Monat	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.
CSA	0.62	0.64	0.64	3.68	1.19	4.76	15.58	0.40	0.93	1.46
Benchmark	0.46	0.54	0.54	3.94	0.65	3.54	15.62	0.22	0.70	1.46

Währungen in % (nach Absicherung)



Kredit-Ratings (Festverzinsliche) in % ³⁾



³⁾ Kredit-Ratings berechnet auf Obligationen und Geldmarkt.

Benchmarkzusammensetzung in %

FTSE 3-Month Swiss Franc Eurodeposit	5.00
SBI Domestic AAA-A 1-3Y (TR)	30.00
SBI Domestic AAA-BBB (TR)	38.00
KGAST Immo-Index Schweiz	27.00

Grösste Positionen

Position	Fälligkeit	in % d. Vermög.
CSA Real Estate CH		28.92
CSA Hypotheken CH		26.47
Swiss Mortgage Fund		2.44
Pfandbrief Schweiz Hypo	09.04.32	0.63
Schweiz	27.06.32	0.54
Schweiz. Eidg.	06.01.49	0.53
Schweiz. Eidg.	08.03.36	0.53
Pfandbriefzentrale	17.06.26	0.51
Schweiz. Eidg.	08.04.28	0.51
SF Commercial Properties Fund		0.49
Total		61.57

Anlagekategorien in %

Nominalwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Zahlungsmittel/ -äquivalente	2.04	5.00	-2.96
Hypotheken Schweiz	28.42	30.00	-1.58
Obligationen CHF	39.38	38.00	1.38
Total Nominalwerte	69.84	73.00	
Sachwerte	CSA	Benchmark	Im Vergleich zum Benchmark
Immobilien Schweiz	30.16	27.00	3.16
Total Sachwerte	30.16	27.00	

¹⁾ Historische Performanceangaben und Finanzmarktszenarien sind keine verlässlichen Indikatoren für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Bei den Performanceangaben sind die bei Ausgabe und Rücknahme von Ansprüchen der Anlagegruppe 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

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.

Mit der Anlage sind Risiken verbunden, namentlich die Risiken von Wert- und Ertragsschwankungen sowie zahlreiche weitere, auch nicht vorhersehbare Risiken. Diese Informationen wurden von der Credit Suisse AG, Teil des UBS-Konzerns, und/oder den 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 übernimmt keine Gewähr für den Inhalt und die Vollständigkeit der Informationen und lehnt, soweit gesetzlich möglich, jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung der Informationen ergeben könnten. Wenn nichts Anderes angegeben ist, 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 TER KGAST-Kennzahl drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten aus, die laufend dem Vermögen der Anlagegruppe belastet werden (Betriebsaufwand). Sie wird als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens der Anlagegruppe dargestellt. Die TER KGAST wird am Ende eines jeden Geschäftsjahres für die vergangenen zwölf Monate berechnet (ausgenommen ist das erste Geschäftsjahr, für welches zu Beginn ein projizierter TER (TER ex ante) angegeben wird).

Die Zusammensetzung von Customised Benchmarks sowie ergänzende Erläuterungen zu verknüpften Benchmarks sind bei der Geschäftsführung der Anlagestiftung bzw. beim Vertreter in der Schweiz erhältlich.

Die zugrunde liegenden Indizes sind eingetragene Marken und wurden zur Nutzung lizenziert. Die Indizes werden ausschliesslich von den Lizenzgebern zusammengestellt und berechnet, und die Lizenzgeber übernehmen hierfür keinerlei Haftung. Die auf den Indizes basierenden Produkte werden von den Lizenzgebern in keiner Weise gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben.

Copyright © 2024 CREDIT SUISSE. Alle Rechte vorbehalten.