

CSA Mixta-BVG Basic I

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).

Kennzahlen

Investment Manager

Christoph Christen, Roger Düggelein

Investment Manager seit 31.12.2007, 31.12.2011

Standort Investment Manager Zürich, Zürich

Währung CHF

Ende des Geschäftsjahres 30. Juni

Erstmission 28.10.2002

Betriebsaufwandquote TER KGAST 0.51

(per 30.06.2020) in % p.a.

Zeichnung / Rücknahme Täglich

Benchmark (BM) CB CSA Mixta-BVG Basic I

Valoren-Nr. 1503660

ISIN CH0015036608

Bloomberg Ticker CSA BVGL SW

Reuters 1503660X.CHE

Ertragsverwendung Thesaurierung

Anspruchsklassenvermögen (in Mio.) 264.29

Ausgabepreis 1'462.37

Rücknahmepreis 1'462.37

Anlagegruppenvermögen (in Mio.) 1'228.79

Statistische Kennzahlen

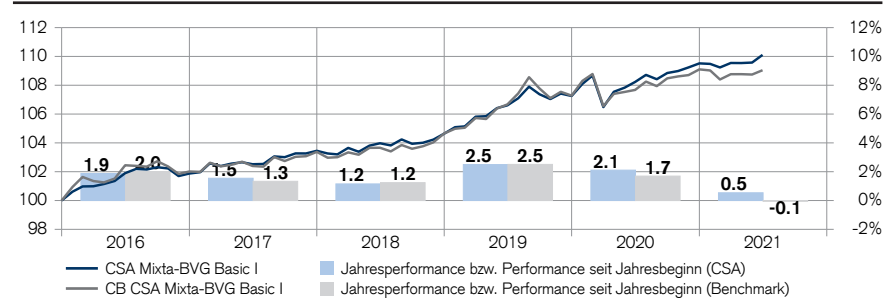
| | 1 Jahr | 5 Jahre | 10 Jahre |
|--------------------------------------|--------|---------|----------|
| Annualisierte Volatilität in % | 0.88 | 1.47 | 1.20 |
| Information Ratio | 0.97 | 0.43 | 0.60 |
| Tracking Error (Ex post) | 0.48 | 0.53 | 0.51 |
| Tracking Error (Ex ante) | 1.74 | - | - |
| Maximaler Verlust in % ²⁾ | -0.28 | -2.02 | -2.02 |
| Sharpe Ratio | 2.82 | 1.55 | 2.36 |
| Beta | 0.71 | 0.86 | 0.84 |
| Alpha | 0.09 | 0.05 | 0.05 |

Laufzeit und Rendite

Modified Duration in Jahren³⁾ 4.23

³⁾ Duration berechnet auf Obligationen, Hypotheken und Geldmarkt.

Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance¹⁾



Netto-Performance in % berechnet in CHF¹⁾

| | 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 | 0.49 | 0.51 | 0.54 | 1.73 | 5.90 | 8.05 | 24.14 | 1.93 | 1.56 | 2.18 |
| Benchmark | 0.28 | 0.25 | -0.05 | 1.27 | 5.19 | 6.44 | 26.12 | 1.70 | 1.25 | 2.35 |

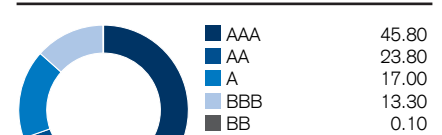
Währungen in % (nach Absicherung)



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 |

Kredit-Ratings (Festverzinsliche) in %⁴⁾



⁴⁾ Kredit-Ratings berechnet auf Obligationen und Geldmarkt.

Grösste Positionen

| Position | Fälligkeit | in % d. Vermög. |
|--|------------|-----------------|
| CSA Real Estate CH | | 24.70 |
| Switzerland Treasury Bill | 19.08.21 | 15.80 |
| Switzerland Treasury Bill | 15.07.21 | 13.20 |
| CS 1a Immo PK | | 2.10 |
| Schweiz | 08.04.28 | 0.50 |
| CS RE Fd Intl | | 0.50 |
| Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute | 27.04.27 | 0.40 |
| Schweiz | 06.01.49 | 0.40 |
| SF Commercial Properties Fund | | 0.40 |
| Schweiz | 08.03.36 | 0.40 |
| Total | | 58.40 |

Anlagekategorien in %

| Nominalwerte | CSA | Benchmark | Im Vergleich zum Benchmark |
|------------------------------|--------------|--------------|----------------------------|
| Zahlungsmittel/ -äquivalente | 3.27 | 5.00 | -1.73 |
| Hypotheken Schweiz | 29.69 | 30.00 | -0.31 |
| Obligationen CHF | 38.55 | 38.00 | 0.55 |
| Total Nominalwerte | 71.51 | 73.00 | |
| Sachwerte | CSA | Benchmark | Im Vergleich zum Benchmark |
| Immobilien Schweiz | 28.49 | 27.00 | 1.49 |
| Total Sachwerte | 28.49 | 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 Fondsanteilen 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, Telefax 044 333 59 67

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.

Diese Informationen wurden von der Credit Suisse Group AG und/oder 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 gibt keine Gewähr hinsichtlich des Inhalts und der Vollständigkeit der Informationen und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung der Informationen ergeben. Ist nichts anderes vermerkt, 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.

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

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 12 Monate berechnet. Die TER ex ante wird als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens der Anlagegruppe ausgedrückt und projiziert unter sonst gleichen Bedingungen den Betriebsaufwand für die folgenden zwölf Monate.

Copyright © 2021 Credit Suisse Group AG und / oder mit ihr verbundenen Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.