

29 mars 2024

CSF Mixta-LPP Index 75

(quote-part actions selon OPP 2 dépassée)

Fait partie du Groupe UBS



Politique d'investissement

Le groupe de placement CSF Mixta-LPP Index 75 investit à l'échelle mondiale indirectement via des fonds indexés dans des actions, des biens immobiliers suisses ainsi que des obligations à taux fixe ou variable (en partie protégées contre l'inflation). Dans le domaine des actions, des indices stratégiques, dont la pondération diffère délibérément de la capitalisation boursière, sont également utilisés pour exploiter des primes de facteurs (p. ex. Value, Quality) ou réduire le risque de placement (p. ex. Minimum Volatility). La part investie en actions varie entre 68% et 82%. Par conséquent, l'horizon de placement devrait être d'au moins dix ans. La part couverte de l'engagement en monnaies étrangères se situe à 75% minimum. En plus d'une large diversification (plusieurs classes d'actifs, qui investissent dans plusieurs milliers de titres individuels), le groupe de placement se caractérise par des frais de gestion (p. ex. frais de recherche ou de transaction) faibles.

Le groupe de placement présente une quote-part d'actions moyenne de plus de 50% et dépasse ainsi la limitation définie pour les actions conformément à l'art. 55 OPP 2. En raison de la quote-part élevée d'actions, ce produit comporte un risque plus élevé que les solutions de prévoyance avec une quote-part maximale d'actions de 50%. Toutes les autres prescriptions en matière de placements de l'Ordonnance sur la prévoyance professionnelle vieillisse, survivants et invalidité (OPP 2) et de l'Ordonnance sur les fondations de placement (OFP) sont remplies dans la mesure où elles s'appliquent.

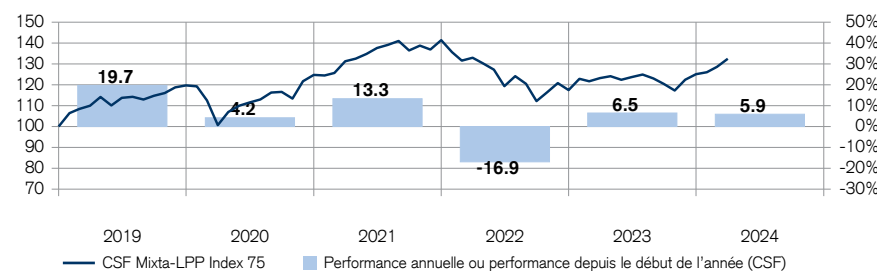
Repères

Gestionnaire	Mehmet Besler
Gestionnaire depuis	13.02.2018
Gestionnaire basé à	Zurich
Devise	CHF
Fin de l'exercice fiscal	30 juin
Date de lancement	13.02.2018
Prime forfaitaire en % p.a.	0.58
Ratio des charges d'exploitation TER KGAST (au 30.06.2023) en % p.a.	0.80
Supplément d'émission (reste dans la fortune de placement) en %	0.12
Déduction rachat (reste dans la fortune de placement) en %	0.07
Souscription / Rachat	Quotidien
Indice de référence (BM)	CB CSA Mixta-BVG Index 75
N° de valeur	38261472
Code ISIN	CH0382614722
Code Bloomberg	CSAB75B SW
Code Reuters	38261472X.CHE
Utilisation du revenu	Capitalisation
Prix d'émission	1'233.56
Prix de rachat	1'231.22
TNA du fonds cible (en mio.)	461.26

Statistiques

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité annualisée en %	7.49	10.27	11.52
Tracking Error (Ex post)	0.05	0.22	0.46
Tracking Error (Ex ante)	-	-	-
Perte maximum en % ²⁾	-6.12	-20.65	-20.65
Ratio de Sharpe	0.75	-0.01	0.33
Beta	1.00	0.99	0.98
Période de reprise (en mois)	2	-	-

Performance nette en CHF (base de 100) et performance annuelle¹⁾



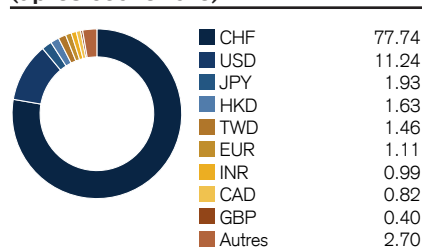
Performance nette en CHF * 1)

	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans	5 ans	3 ans p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	depuis lancement
CSF	3.01	5.91	5.91	7.52	0.92	20.46	0.30	3.79	-	23.21

*Le gestionnaire de portefeuille cherche à atteindre un rendement équivalent à la performance du benchmark moins les coûts de gestion

Monnaies en %

(après couverture)



Duration et rendement*

Rendement brut du portefeuille en %	2.23
Duration modifiée en années ²⁾	7.55

*Calculée sur les obligations.

Positions principales

Société	Echéance en % des capitaux
Novartis AG	2.54
Swisscom	1.76
Microsoft Corp	1.72
PSP Swiss Property	1.66
Swiss Prime Site AG	1.57
Swiss Re	1.21
Nvidia	1.11
Holcim	1.06
Nestlé SA	1.01
Kühne & Nagel	0.98
Total	14.62

Composition de l'indice de

référence en %

SBI AAA-BBB ESG (TR)	8.00
Bloomberg Barclays MSCI Global Aggr. ex-CHF Sustainability(TR) (CHF-H)	8.00
Bloomberg Barclays WGILB ex-Italy ex-Japan ex-Spain (TR) (CHF-H)	4.00
SPI ESG Multi Premia (TR)	37.00
MSCI World ESG Leaders Minimum Volatility (NR)	16.00
MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (NR) (CHF-Hgd)	16.00
MSCI Emerging Markets ESG Leaders (NR)	6.00
SXI Real Estate Funds Broad (TR)	5.00

Types de placements en %

Valeurs nominales	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Liquidités/équivalents de liquidités	0.02	0.00	0.02
Obligations CHF	7.86	8.00	-0.14
Obligations en monnaies étrangères couvertes en CHF	7.88	8.00	-0.12
Obligations indexées sur l'inflation couvertes en CHF	3.88	4.00	-0.12
Parts en valeurs nominales	19.64	20.00	
Valeurs réelles	CSF	Benchmark	Par rapport à l'indice de référence
Actions suisses	37.61	37.55	0.06
Actions européennes	5.26	5.22	0.04
Actions États Unis	21.30	21.17	0.13
Actions Canada	1.34	1.31	0.03
Actions Japon	2.97	2.94	0.03
Actions Pacifique sauf Japon	0.82	0.81	0.01
Actions marchés émergents	6.06	6.00	0.06
Valeurs immobilières Suisse	5.00	5.00	0.00
Parts en valeurs réelles	80.36	80.00	

ESG Integration (ESG aware): Ce produit comprend des investissements qui intègrent et mesurent de façon explicite des critères de durabilité des immeubles dans leur processus d'investissement.

1) Les performances historiques et les scénarios de marché financier ne constituent pas des indicateurs fiables de résultats courants ou futurs. Les commissions et les frais perçus lors de l'émission et du rachat de droits de participation du groupe de placement ne sont pas pris en compte dans les indications de performance.

2) Perte totale maximale au cours de la période d'observation, indépendamment de l'intervalle partielle reprises.

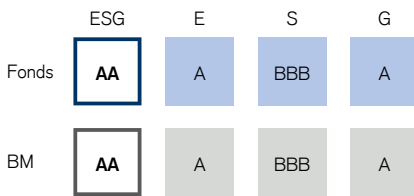
La clause de non-responsabilité figurant à la fin de ce document s'applique également à cette page.

CSF Mixta-LPP Index 75

(quote-part actions selon OPP 2 dépassée)

Le sigle ESG fait référence aux facteurs environnementaux (E), sociaux (S) et de gouvernance (G). Pour en savoir plus sur les critères d'investissement ESG et sur les aspects du produit en matière de durabilité, veuillez consulter les documents juridiques et réglementaires du produit et vous rendre sur le site credit-suisse.com/esg. Parallèlement aux aspects relatifs à la durabilité, la décision d'investir dans le produit devrait prendre en considération tous les objectifs et les caractéristiques décrits dans les informations devant être communiquées aux investisseurs conformément à la réglementation en vigueur.

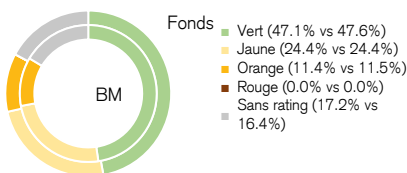
Notation ESG vs indice de référence ³⁾



Ventilation ESG ⁵⁾

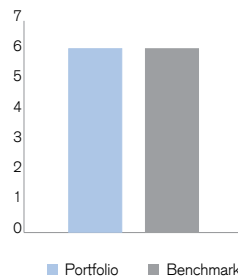
	Notes
Note générale	7.8
Environnement	6.2
Changement climatique	7.6
Opportunités env.	5.6
Capital naturel	5.8
Pollution et déchets	4.9
Social	5.5
Capital humain	5.4
Responsabilité en matière de produit	5.7
Opportunités sociales	4.9
Opposition des parties prenantes	7.2
Gouvernance	6.2

Flag des controverses ESG ⁶⁾



Note Low Carbon Transition ⁸⁾

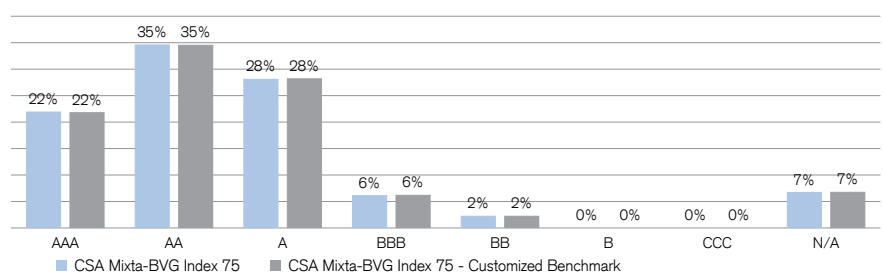
Portefeuille: **6.1** / Indice de référence: **6.1**



Caractéristiques ESG appliquées ⁴⁾

- Indice de référence ESG
- Intégration de critères ESG
- Critères d'exclusion
- Vote par procuration
- Engagement

Notation ESG en % vs indice de référence ⁷⁾

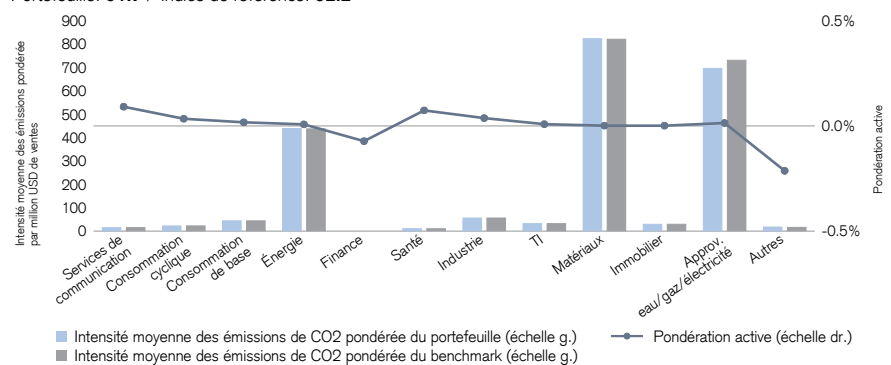


10 principaux actifs

Nom des actifs	Pondération	Notation ESG	Flag cont.	E	S	G
Novartis Ag	2.5%	AA	■	■	■	■
Swisscom Ag	1.8%	AA	■	■	■	■
Microsoft Corporation	1.7%	AA	■	■	■	■
Psp Swiss Property Ag	1.7%	3*	■	■	■	■
Swiss Prime Site Ag	1.6%	AA	■	■	■	■
Swiss Re Ag	1.2%	AAA	■	■	■	■
Nvidia Corp	1.1%	AAA	■	■	■	■
Holcim Ltd	1.1%	AA	■	■	■	■
Nestle	1.0%	A	■	■	■	■
Kuehne & Nagel International Ag	1.0%	AAA	■	■	■	■

Intensité des émissions de carbone ⁹⁾

Tonnes d'émissions en équivalent de CO2 par mio. de \$ de revenus
 Portefeuille: **91.7** / Indice de référence: **92.2**



Légende

3) Les notations ESG, fournies par MSCI ESG, se déclinent sur une échelle allant de AAA (notation la plus élevée) à CCC (notation la plus basse). La notation est fonction de l'exposition de l'entreprise concernée aux risques de durabilité spécifiques au secteur et de sa capacité à atténuer ces risques comparativement aux autres acteurs du secteur. La note globale du portefeuille est attribuée sur une base sectorielle relative. En revanche, pour les critères environnementaux (E), sociaux (S) et de gouvernance (G) individuels, il s'agit de notes absolues. La note globale ne peut donc pas être considérée comme une moyenne des notes E, S et G individuelles.

4) Pour de plus amples informations sur la méthodologie suivie pour évaluer les caractéristiques ESG des investissements, veuillez consulter msci.com/our-solutions/esg-investing/

5) La note «Overall ESG Quality» (note globale Qualité ESG) ne correspond pas directement aux notes «Pillar» (notation par piliers) pour les critères environnementaux, sociaux et de gouvernance de l'entreprise. Les notes «Pillar» sont déterminées sur une base absolue, alors que la note «Overall ESG Quality» est ajustée de manière à refléter l'exposition au risque de durabilité au niveau d'un secteur donné. Dans la mesure où les notations «Pillar» sont des notes absolues et que les notations Overall sont des notes relatives, ces dernières ne peuvent être calculées en faisant la moyenne des premières. Les thèmes ESG présentent une ventilation des notations E, S et G individuelles. Toutes les notations et leurs composantes sont déclinées sur une échelle de 0 à 10 (fournie par MSCI), où 0 correspond à «très faible» et 10 à «très élevé».

6) ESG Controversies Flag est conçu pour fournir une évaluation à jour et cohérente des controverses ESG impliquant des sociétés cotées en bourse et des émetteurs obligataires. Un cas de controverse est en général un événement ponctuel tel qu'une marée noire ou un accident, ou bien une allégation, par exemple de problèmes de sécurité sur un site de production. La couleur, du rouge au vert, indique le degré d'implication dans des controverses, allant de très élevé (rouge) à très faible (vert). La couleur grise indique qu'aucune donnée n'est disponible.

7) La note ESG représente la répartition en pourcentage de la note ESG MSCI, d'un point de vue absolu ou relatif à un indice de référence. Les notes GRESB pour l'immobilier ne sont pas prises en compte.

8) La note Low Carbon Transition repose sur une évaluation multidimensionnelle des risques et des opportunités et prend en considération les risques prédominants et secondaires auxquels une entreprise est confrontée. L'échelle va de 0 à 10 (10 correspondant à un potentiel de leader), ne tient pas compte du secteur et correspond à la position de l'entreprise vis-à-vis de la transition. Au niveau du portefeuille, les notes individuelles sont agrégées et comparées à l'indice de référence (si existant).

9) L'intensité carbone compare l'intensité moyenne pondérée des émissions par million de dollars de chiffre d'affaires (ventilées par secteur GICS) entre le portefeuille et l'indice de référence. Elle présente également les pondérations actives du secteur GICS.

Contact

CREDIT SUISSE FONDATION DE PLACEMENT

Postfach 800, 8070 Zürich

Téléphone 044 333 48 48

csa.info@credit-suisse.com

Les informations fournies constituent un support marketing. Elles ne doivent pas être interprétées comme un conseil financier ou autre fondé sur la situation personnelle du destinataire ni comme le résultat d'une analyse indépendante et objective. Les informations fournies dans le présent document ne sont pas juridiquement contraignantes et ne constituent ni une offre ni une incitation visant à la conclusion de quelque transaction financière que ce soit.

Les placements comportent des risques, en particulier des risques de fluctuation des valeurs et des rendements ainsi que de nombreux autres risques parfois imprévisibles.

Les informations fournies dans le présent document ont été élaborées par Credit Suisse SA, fait partie du Groupe UBS, et/ou ses filiales (ci-après CS) avec le plus grand soin et en toute bonne foi. Les informations et les opinions exprimées dans le présent document reflètent celles du Credit Suisse au moment de la rédaction et sont sujettes à modification à tout moment sans préavis. Elles proviennent de sources considérées comme fiables.

CS ne fournit aucune garantie quant au contenu et à l'exhaustivité des informations et, lorsque cela est légalement possible, n'accepte aucune responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de l'utilisation de ces informations. Sauf indication contraire, tous les chiffres ne sont pas vérifiés.

Les informations contenues dans ce document sont à l'usage exclusif du destinataire. Il est interdit d'envoyer, d'introduire ou de distribuer ces informations ou une copie de celles-ci aux Etats-Unis ou de les remettre à une personne US (au sens de la Regulation S de l'US Securities Act de 1933, dans sa version amendée). La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit du CS est interdite.

Credit Suisse Fondation de placement, Zurich, est l'émetteur et le gestionnaire des produits CSF. Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich, est la banque dépositaire. Les statuts, les réglementations et les directives de placement ainsi que les derniers rapports annuels et fact sheets peuvent être obtenus gratuitement auprès de Credit Suisse Fondation de placement. Seuls les fonds de pension domiciliés en Suisse qui ne sont pas soumis à l'impôt sont autorisés comme investisseurs directs.

Le TER KGAST reflète la totalité des frais et commissions qui pèsent de manière constante sur la fortune du groupe de placement (charges d'exploitation). Il est exprimé en pourcentage de la fortune nette moyenne du groupe de placement. Le TER KGAST est calculé à la fin de chaque exercice pour les douze derniers mois (à l'exception du premier exercice, pour lequel un TER projeté (TER ex ante) est indiqué dès le début).

La composition des indices de référence sur mesure ainsi que des explications complémentaires sur les indices de référence liés sont disponibles auprès de la gérance de la fondation de placement ou du représentant en Suisse.

Les indices sous-jacents sont des marques déposées et ont fait l'objet d'une licence concédée en vue de leur utilisation. Les indices sont composés et calculés exclusivement par les donneurs de licence, qui ne peuvent être tenus pour responsables en ce qui concerne leurs prestations. Les produits basés sur ces indices ne sont aucunement sponsorisés, soutenus, vendus ou promus par les donneurs de licence.

© 2024 MSCI ESG Research LLC. Reproduction autorisée. Bien que les fournisseurs d'informations de Credit Suisse Asset Management, y compris, mais sans s'y limiter, MSCI ESG Research LLC et ses sociétés liées (les «Parties ESG»), obtiennent des informations de sources qu'ils considèrent fiables, aucune des Parties ESG ne garantit l'originalité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données contenues aux présentes. Aucune des Parties ESG ne donne de garantie expresse ou implicite de quelque nature que ce soit, et les Parties ESG déclinent expressément par les présentes toute responsabilité quant à la qualité marchande ou l'utilisation à des fins particulières, à l'égard de toute donnée qui y est incluse. Aucune des Parties ESG ne peut être tenue responsable d'erreurs ou d'omissions en rapport avec les données contenues dans les présentes. De plus, sans limiter la portée de ce qui précède, en aucun cas les Parties ESG ne pourront être tenues responsables des dommages directs, indirects, spéciaux, punitifs, consécutifs ou autres (y compris un manque à gagner), même si elles ont été avisées de la possibilité de tels dommages.

Copyright © 2024 CREDIT SUISSE. Tous droits réservés.