

## CSF Mixta-LPP Basic I

(selon l'OPP 2 – la quote-part immobilière peut être dépassée)\*

### Politique d'investissement

L'objectif du groupe de placement est l'obtention d'un revenu correspondant à la structure de risque en francs suisses. Le groupe de placement investit donc principalement, par le biais de placements collectifs, dans des placements en papiers monétaires à rémunération fixe ou variable, des obligations et des titres de créance, ainsi que dans des hypothèques et des biens immobiliers suisses. La part de l'immobilier et des hypothèques représente au minimum 45% de la fortune du groupe de placement. Les placements en monnaies étrangères sont couverts le plus largement possible par rapport au franc suisse.

Le groupe de placement remplit les prescriptions de l'Ordonnance sur la prévoyance professionnelle vieillesse, survivants et invalidité (OPP 2) et de l'Ordonnance sur les fondations de placement (OFP), dans la mesure où elles s'appliquent.

\* Conformément à l'art. 29, al. 1, lit. e OFP et aux directives de placement de Credit Suisse Fondation de placement, il sera possible, à compter du 1.12.2022, de dépasser la limite pour les immeubles fixée par l'OPP2.

### Repères

|                                                                             |                                     |
|-----------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Gestionnaire</b>                                                         | Christoph Christen, Roger Düggelein |
| <b>Gestionnaire depuis</b>                                                  | 31.12.2007, 31.12.2011              |
| <b>Gestionnaire basé à</b>                                                  | Zurich, Zurich                      |
| <b>Devise</b>                                                               | CHF                                 |
| <b>Investissement minimal (droit)</b>                                       | 1                                   |
| <b>Fin de l'exercice fiscal</b>                                             | 30 juin                             |
| <b>Date de lancement</b>                                                    | 28.10.2002                          |
| <b>Ratio des charges d'exploitation TER KGAST (au 30.06.2023) en % p.a.</b> | 0.49                                |
| <b>Souscription / Rachat</b>                                                | Quotidien                           |
| <b>Indice de référence (BM)</b>                                             | CB CSA Mixta-BVG Basic I            |
| <b>N° de valeur</b>                                                         | 1503660                             |
| <b>Code ISIN</b>                                                            | CH0015036608                        |
| <b>Code Bloomberg</b>                                                       | CSABVGL.SW                          |
| <b>Code Reuters</b>                                                         | 1503660X.CHE                        |
| <b>Utilisation du revenu</b>                                                | Capitalisation                      |
| <b>Valeur liquidative total (en mio.)</b>                                   | 163.33                              |
| <b>Prix d'émission</b>                                                      | 1'472.27                            |
| <b>Prix de rachat</b>                                                       | 1'472.27                            |
| <b>TNA du fonds cible (en mio.)</b>                                         | 827.63                              |

### Statistiques

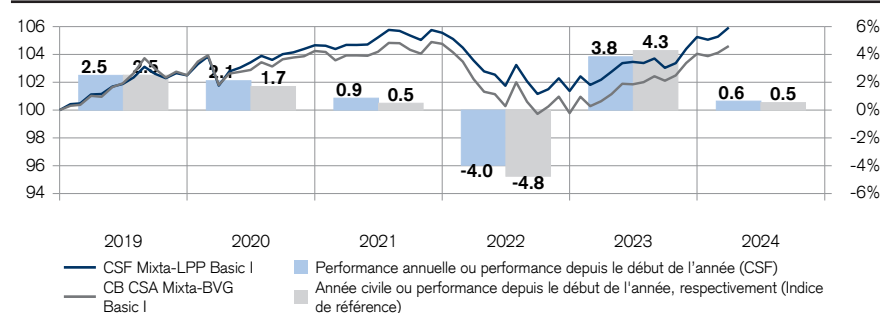
|                                  | 1 an  | 5 ans | 10 ans |
|----------------------------------|-------|-------|--------|
| Volatilité annualisée en %       | 1.61  | 2.16  | 1.66   |
| Ratio d'information              | -0.48 | 0.42  | -0.01  |
| Tracking Error (Ex post)         | 0.56  | 0.55  | 0.60   |
| Tracking Error (Ex ante)         | 0.27  | -     | -      |
| Perte maximum en % <sup>2)</sup> | -0.65 | -4.35 | -4.35  |
| Ratio de Sharpe                  | 1.23  | 0.46  | 0.92   |
| Beta                             | 1.21  | 0.88  | 0.82   |
| Alpha                            | -0.06 | 0.03  | 0.03   |
| Période de reprise (en mois)     | 2     | 18    | 18     |

### Duration et rendement\*

|                                           |      |
|-------------------------------------------|------|
| Rendement brut du portefeuille en %       | 1.28 |
| Duration modifiée en années <sup>2)</sup> | 7.79 |

\*Calculée sur les obligations.

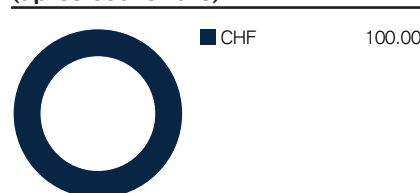
### Performance nette en CHF (base de 100) et performance annuelle <sup>1)</sup>



### Performance nette en % calculée en CHF <sup>1)</sup>

|                     | 1 mois | 3 mois | YTD  | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | 10 ans p.a. |
|---------------------|--------|--------|------|------|-------|-------|--------|------------|------------|-------------|
| CSF                 | 0.62   | 0.64   | 0.64 | 3.68 | 1.19  | 4.76  | 15.58  | 0.40       | 0.93       | 1.46        |
| Indice de référence | 0.46   | 0.54   | 0.54 | 3.94 | 0.65  | 3.54  | 15.62  | 0.22       | 0.70       | 1.46        |

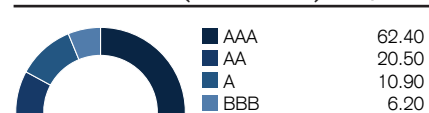
### Monnaies en % (après couverture)



### Composition de l'indice de référence en %

|                                      |       |
|--------------------------------------|-------|
| 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 |

### Cote de crédit (revenu fixe) en % <sup>3)</sup>



<sup>3)</sup> Notations de crédit calculées sur les obligations et le marché monétaire.

### Positions principales

| Société                       | Echéance | en % des capitaux |
|-------------------------------|----------|-------------------|
| CSA Real Estate CH            |          | 28.92             |
| CSA Hypotheken CH             |          | 26.47             |
| Swiss Mortgage Fund           |          | 2.44              |
| Pfandbrief Schweiz Hypo       | 09.04.32 | 0.63              |
| Suisse                        | 27.06.32 | 0.54              |
| Conféd. Suisse                | 06.01.49 | 0.53              |
| Conféd. Suisse                | 08.03.36 | 0.53              |
| Conféd. Suisse                | 08.04.28 | 0.51              |
| Pfandbriefzentrale            | 17.06.26 | 0.51              |
| SF Commercial Properties Fund |          | 0.49              |
| <b>Total</b>                  |          | <b>61.57</b>      |

### Types de placements en %

| Valeurs nominales                    | CSF          | Benchmark    | Par rapport à l'indice de référence |
|--------------------------------------|--------------|--------------|-------------------------------------|
| Liquidités/équivalents de liquidités | 2.04         | 5.00         | -2.96                               |
| Hypothèques suisses                  | 28.42        | 30.00        | -1.58                               |
| Obligations CHF                      | 39.38        | 38.00        | 1.38                                |
| <b>Parts en valeurs nominales</b>    | <b>69.84</b> | <b>73.00</b> |                                     |
| Valeurs réelles                      | CSF          | Benchmark    | Par rapport à l'indice de référence |
| Valeurs immobiliers Suisse           | 30.16        | 27.00        | 3.16                                |
| <b>Parts en valeurs réelles</b>      | <b>30.16</b> | <b>27.00</b> |                                     |

<sup>1)</sup> 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.

<sup>2)</sup> 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.

## 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.

Copyright © 2024 CREDIT SUISSE. Tous droits réservés.