

31 luglio 2023

CSF Mixta-LPP Basic I

(la quota immobiliare ai sensi dell'OPP 2 può essere superata)*

Politica d'investimento

L'obiettivo del gruppo d'investimento è ottenere proventi adeguati alla struttura di rischio in CHF. A questo scopo, il gruppo investe in strumenti collettivi a reddito fisso e variabile del mercato monetario, obbligazioni e titoli di debito nonché ipoteche e immobili svizzeri. In immobili e ipoteche è collocato almeno il 45% del patrimonio del gruppo d'investimento. Gli investimenti in monete estere sono coperti per quanto possibile in franchi svizzeri.

Il gruppo d'investimento soddisfa le disposizioni applicabili dell'Ordinanza sulla previdenza professionale per la vecchiaia, i superstiti e l'invalidità (OPP 2) e dell'Ordinanza sulle fondazioni d'investimento (OFond).

* Con riferimento all'art. 29 cpv. 1 lett. e OFond e alle direttive d'investimento della Credit Suisse Fondazione d'investimento, a partire dall'1.12.2022 può essere superato il limite di categoria per gli immobili indicato nell'OPP 2.

Cifre salienti

Responsabile di investimento

Christoph Christen, Roger Düggelein

Responsabile di investimento da allora

31.12.2007, 31.12.2011

Domicilio del gestore Zurigo, Zurigo

Valuta base CHF

Investimento minimo (diritto) 1

Chiusura d'esercizio 30 giugno

Data di lancio 28.10.2002

Quota delle spese di esercizio TER KGAST 0.51

(dal 30.06.2022) in % p.a.

Sottoscrizioni / Riscatti Giornalieri

Benchmark (BM) CB CSA Mixta-BVG Basic I

Numero di valore 1503660

Codice ISIN CH0015036608

Codice Bloomberg CSABVGL SW

Codice Reuters 1503660X.CHE

Utilizzo del ricavi Capitalizzazione

Quota totale (in mio.) 190.64

Prezzo d'emissione 1'436.82

Prezzo di riscatto 1'436.82

TNA del fondo strategico (in mio.) 923.60

Indici statistici

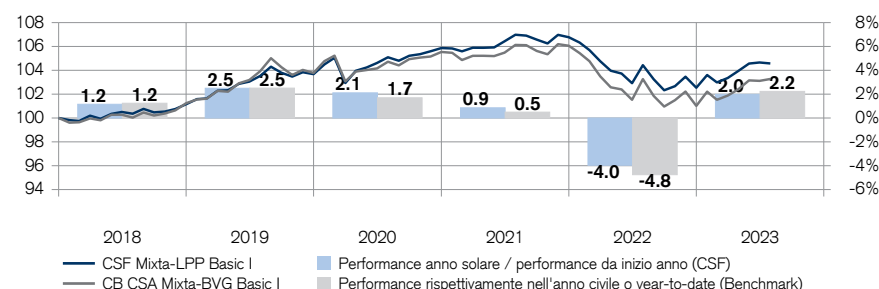
	1 anno	5 anni	10 anni
Volatilità annualizzata in %	2.55	2.08	1.60
Information ratio	0.22	0.35	-0.07
Tracking Error (Ex post)	0.57	0.53	0.61
Tracking Error (Ex ante)	0.42	-	-
Massima perdita in % ²⁾	-2.02	-4.35	-4.35
Sharpe ratio	-0.32	0.56	1.07
Beta	0.86	0.86	0.81
Alpha	0.00	0.03	0.03
Periodo di ripresa (in mesi)	8	-	-

Duration e rendimento

Modified duration in anni ³⁾ 5.30

3) Duration calcolato sulle obbligazioni e ipoteche.

Performance netta in CHF (base 100) e performance annua ¹⁾



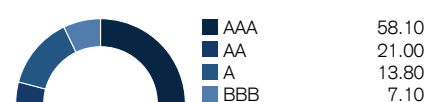
Performance netta in % calcolata in CHF ¹⁾

	1 mese	3 mesi	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	3 anni p.a.	5 anni p.a.	10 anni p.a.
CSF	-0.08	0.61	1.98	0.14	-0.49	4.20	14.70	-0.16	0.83	1.38
Benchmark	0.15	0.85	2.23	0.01	-1.38	3.24	15.17	-0.46	0.64	1.42

Valute in % (dopo la copertura)



Credit rating (a reddito fisso) in % ⁴⁾



4) Rating di credito, calcolati su obbligazioni e mercato monetario.

Ripartizione del indice di riferimento 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

Posizioni principali

Principali posizioni	Scadenza	in % del totale
CSA Real Estate CH		28.77
CSA Hypotheken CH		24.45
Swiss Mortgage Fund		4.32
Pfandbrief Schweiz Hypo	09.04.32	0.55
Pfandbriefbank Schweiz. Hypothekarinstitute	27.04.27	0.55
Svizzera	27.06.32	0.48
Confed. Svizzera	08.03.36	0.47
Confed. Svizzera	08.04.28	0.47
Confed. Svizzera	06.01.49	0.47
Pfandbriefzentrale	17.06.26	0.45
Totale		60.98

Categorie d'investimento in %

Valori nominali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Attività liquide e strumenti assimilati	1.69	5.00	-3.31
Ipoteche svizzere	28.43	30.00	-1.57
Obbligazioni CHF	40.18	38.00	2.18
Totale valori nominali	70.30	73.00	
Valori reali	CSF	Benchmark	Rispetto al Benchmark
Immobili Svizzera	29.70	27.00	2.70
Totale valori reali	29.70	27.00	

1) I dati storici sulla performance e gli scenari dei mercati finanziari non sono indicatori affidabili per i rendimenti attuali o futuri. I dati relativi alla performance non tengono conto delle commissioni e dei costi applicabili per l'emissione e il riscatto del gruppo d'investimento.

2) Perdita totale massimo nell'arco del periodo di osservazione, a prescindere da una serie di rimbalzi parziale intermedia. Il disclaimer riportato alla fine del presente documento si applica anche a questa pagina.

Contatto

CREDIT SUISSE FONDAZIONE D'INVESTIMENTO
Postfach 800, 8070 Zürich
Telefonò 044 333 48 48
csa.info@credit-suisse.com

Le informazioni fornite nel presente documento costituiscono materiale di marketing. Non si tratta di una consulenza d'investimento o di altro tipo basata su una considerazione della situazione personale del destinatario né del risultato o dell'obiettivo di una ricerca indipendente. Le informazioni fornite nel presente documento non sono giuridicamente vincolanti e non costituiscono né un'offerta né un invito a effettuare alcun tipo di operazione finanziaria.

L'investimento è associato a rischi, in particolare rischi di fluttuazione di valore e ricavi, nonché numerosi altri rischi, tra cui alcuni imprevedibili.

Le informazioni fornite nel presente documento sono state allestite da Credit Suisse AG e/o delle sue affiliate (denominati di seguito "CS") con la massima cura e secondo scienza e coscienza. Le informazioni e le opinioni contenute nel presente documento sono quelle di CS al momento della redazione e possono cambiare in qualsiasi momento senza preavviso. Esse sono state ricavate da fonti ritenute attendibili.

CS non fornisce alcuna garanzia per quanto riguarda il contenuto e la completezza delle informazioni e, ove giuridicamente possibile, non si assume alcuna responsabilità per i danni che potrebbero derivare dall'utilizzo delle informazioni. Se non viene indicato il contrario, tutte le cifre non vengono verificate.

Le informazioni contenute in questo documento sono ad uso esclusivo del destinatario. Né le presenti informazioni né eventuali copie delle stesse possono essere inviate, consegnate o distribuite negli Stati Uniti o a US Person (ai sensi della Regulation S dello US Securities Act del 1933, e successive modifiche). Il presente documento non può essere riprodotto, né totalmente né parzialmente, senza l'autorizzazione scritta di CS.

Credit Suisse Fondazione d'investimento, Zurigo, è l'emittente e il gestore dei prodotti CSF. Banca depositaria è Credit Suisse (Svizzera) SA, Zurigo. Lo statuto, i regolamenti, le direttive d'investimento, il più recente rapporto annuale e i fact sheet sono disponibili gratuitamente presso Credit Suisse Fondazione d'investimento. Solo gli istituti di previdenza domiciliati in Svizzera che non sono soggetti a imposta sono consentiti come investitori diretti.

L'indicatore TER KGAST esprime la totalità delle commissioni e spese che vengono addebitate correntemente al patrimonio del gruppo d'investimento (costi operativi). Viene rappresentato come percentuale del patrimonio netto medio del gruppo d'investimento. Il TER KGAST si calcola alla fine di ciascun anno finanziario, per i dodici mesi precedenti (a eccezione del primo esercizio, per il quale viene indicato all'inizio un TER proiettato (TER ex ante)).

La composizione dei customized benchmark nonché le spiegazioni complementari sui benchmark correlati sono ottenibili presso l'amministrazione della Fondazione d'investimento o presso il rappresentante in Svizzera.

Gli indici sottostanti sono marchi registrati e sono stati concessi in licenza per l'utilizzo. Gli indici vengono raggruppati e calcolati esclusivamente dai datori di licenze, che non si assumono alcuna responsabilità a tal riguardo. I prodotti che si basano sugli indici non vengono in alcun modo sponsorizzati, supportati, venduti o commercializzati dai datori di licenze.

Copyright © 2023 CREDIT SUISSE. Tutti i diritti riservati.