

## CSA Fund Selection Equity Europe

### Anlagepolitik

Die Anlagegruppe CSA Fund Selection Equity Europe investiert in Zielfonds, die in paneuropäische Unternehmen (ohne Schweiz) investieren. Ziel der Anlagegruppe ist es, den Vergleichsindex MSCI Europe ex Schweiz risikoadjustiert und konstant zu übertreffen. Die Selektion der Zielfonds erfolgt aufgrund einer quantitativen und qualitativen Analyse. Mit einem "best-in-class"-Ansatz werden die Zielfonds nach Risk-Return-Aspekten eingesetzt, um die Korrelationen der Zielfonds möglichst tief zu halten. Da die Auswahl an ausgezeichneten Fonds mit Strategie "Europe ex Schweiz" beschränkt ist, kann es auf aggregierter Basis dennoch zu einer Allokation Schweiz (maximal 15%) kommen.

### Kennzahlen

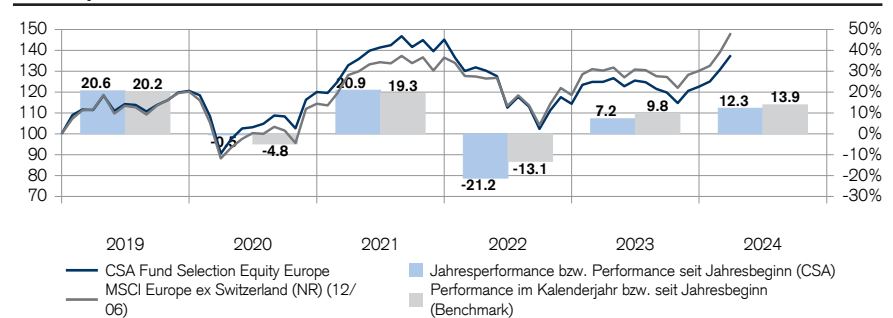
|                                                                  |                                         |
|------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|
| <b>Investment Manager</b>                                        | Robin Gottschalk                        |
| <b>Investment Manager seit</b>                                   | 31.03.2017                              |
| <b>Standort Investment Manager</b>                               | Zürich                                  |
| <b>Währung</b>                                                   | CHF                                     |
| <b>Mindestinvestition (Anspruch)</b>                             | 1                                       |
| <b>Ende des Geschäftsjahres</b>                                  | 30. Juni                                |
| <b>Erstmission</b>                                               | 28.01.1992                              |
| <b>Betriebsaufwandquote TER KGAST (per 30.06.2023) in % p.a.</b> | 1.79                                    |
| <b>Zeichnung / Rücknahme</b>                                     | Täglich                                 |
| <b>Benchmark (BM)</b>                                            | MSCI Europe ex Switzerland (NR) (12/06) |
| <b>Valoren-Nr.</b>                                               | 287502                                  |
| <b>ISIN</b>                                                      | CH0002875026                            |
| <b>Bloomberg Ticker</b>                                          | CSAAKEU SW                              |
| <b>Reuters</b>                                                   | 287502X.CHE                             |
| <b>Ertragsverwendung</b>                                         | Thesaurierung                           |
| <b>Anspruchsklassenvermögen (in Mio.)</b>                        | 28.93                                   |
| <b>Abrechnungspreis pro Anspruch (Swung-NAV)</b>                 | 3'129.56                                |
| <b>Anlagegruppenvermögen (in Mio.)</b>                           | 28.93                                   |

### Statistische Kennzahlen

|                                      | 1 Jahr | 5 Jahre | 10 Jahre |
|--------------------------------------|--------|---------|----------|
| Annualisierte Volatilität in %       | 11.23  | 18.10   | 16.12    |
| Information Ratio                    | -1.87  | -0.38   | -0.24    |
| Tracking Error (Ex post)             | 1.90   | 3.95    | 4.05     |
| Tracking Error (Ex ante)             | 1.99   | -       | -        |
| Maximaler Verlust in % <sup>2)</sup> | -9.42  | -30.27  | -30.27   |
| Sharpe Ratio                         | 0.72   | 0.24    | 0.22     |
| Beta                                 | 0.94   | 0.95    | 0.96     |
| Alpha                                | -0.21  | -0.10   | -0.06    |
| Erholungsphase (in Monaten)          | 4      | -       | -        |

2) Der maximale Verlust ist die tiefste kumulierte Rendite in einer bestimmten Periode.

### Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance <sup>1)</sup>



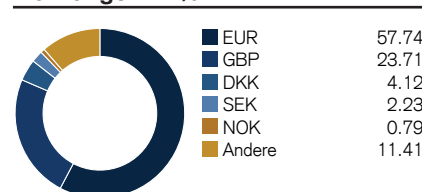
### Netto-Performance in % berechnet in CHF <sup>1)</sup>

|           | 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       | 5.28    | 12.27    | 12.27 | 10.21  | 3.62    | 23.58   | 41.88    | 1.19         | 4.33         | 3.56          |
| Benchmark | 6.55    | 13.87    | 13.87 | 13.76  | 15.67   | 32.84   | 55.53    | 4.98         | 5.84         | 4.51          |

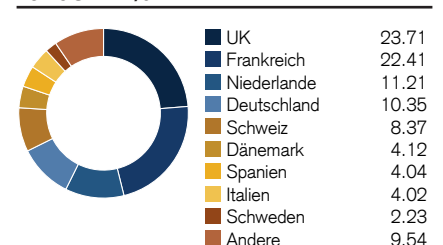
### Sektoren in %

|                              | CSA   | Benchmark | Im Vergleich zum Benchmark |
|------------------------------|-------|-----------|----------------------------|
| Industrie                    | 15.17 | 17.43     | -2.26                      |
| Gesundheitswesen             | 14.62 | 12.43     | 2.19                       |
| Finanzen                     | 14.39 | 18.29     | -3.90                      |
| Zyklische Konsumgüter        | 13.02 | 12.01     | 1.01                       |
| Nichtzykl. Konsumgüter       | 12.29 | 9.15      | 3.14                       |
| Informationstechnologie      | 10.70 | 9.20      | 1.50                       |
| Materialien                  | 6.44  | 6.56      | -0.12                      |
| Versorgungsbetriebe          | 4.50  | 4.40      | 0.10                       |
| Kommunikationsdienstleistung | 4.05  | 3.33      | 0.72                       |
| Andere                       | 4.82  | 7.20      | -2.38                      |

### Währungen in %



### Länder in %



### Top-5-Positionen in %

|                                         |              |
|-----------------------------------------|--------------|
| Comgest Growth Europe                   | 18.44        |
| CSIF (Lux) Equity Europe ESG Blue       | 17.75        |
| Credit Suisse EMU ESG Equity Index Fund | 16.39        |
| Amundi MSCI EMU ESG Leaders Select      | 14.28        |
| CSIF (Lux) Equity UK ESG Blue           | 8.73         |
| <b>Total</b>                            | <b>75.59</b> |

<sup>1)</sup> 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. 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 domizillierte 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).

Index: Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen (die «Informationen») dürfen ohne die vorherige schriftliche Zustimmung von MSCI weder ganz noch teilweise vervielfältigt oder weitergegeben werden. Die Informationen dürfen weder zur Überprüfung oder Berichtigung anderer Daten oder Erstellung von abgeleiteten Werken, Indizes, Risikomodellen oder Analysen noch in Verbindung mit der Ausgabe, dem Angebot, dem Sponsoring, der Verwaltung oder der Vermarktung von Wertpapieren, Portfolios, Finanzprodukten oder anderen Anlagevehikeln verwendet werden. Historische Daten und Analysen sollten weder als Hinweis noch als Garantie für zukünftige Ergebnisse, Analysen, Prognosen oder Voraussagen aufgefasst werden. Die Informationen, die MSCI-Indizes und sonstige Produkte oder Dienstleistungen stellen in keiner Weise ein Angebot zum Kauf oder Verkauf oder eine Empfehlung oder Förderung von Wertpapieren, Finanzinstrumenten, -produkten oder Handelsstrategien dar. Die Informationen und MSCI-Indizes sollen in keiner Weise eine Beratung oder Empfehlung zum Treffen einer Anlageentscheidung darstellen (oder davon abhalten) und dürfen hierfür nicht herangezogen werden. Die Informationen werden «wie besehen» bereitgestellt und der Nutzer der Informationen trägt das gesamte Risiko, das mit seiner oder der von ihm zugelassenen Verwendung der Informationen einhergeht. MSCI INC., SEINE TOCHTERUNTERNEHMEN, SEINE ODER DEREN DIREKTE(N) ODER INDIREKTE(N) LIEFERANTEN UND DRITTE, DIE AN DER ERARBEITUNG ODER ZUSAMMENSTELLUNG DER INFORMATIONEN BETEILIGT SIND (JEWEILS EIN «INFORMATIONSANBIETER»), GEBEN KEINERLEI ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG UND JEDER INFORMATIONSANBIETER LEHNT HIERMIT SOWEIT GESETZLICH ZULÄSSIG AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, EINSCHLIESSLICH DER GEWÄHRLEISTUNG DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER DER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK, AB. OHNE EINSCHRÄNKUNG DER VORSTEHENDEN AUSFÜHRUNGEN UND SOWEIT GESETZLICH ZULÄSSIG HAFTEN DIE INFORMATIONSANBIETER IN KEINEM FALL FÜR DIREKTE, INDIREKTE, BESONDERE ODER FOLGESCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SCHADENERSATZZAHLUNGEN ODER SONSTIGE SCHÄDEN IM ZUSAMMENHANG MIT DEN INFORMATIONEN, SELBST WENN ÜBER DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN INFORMIERT WURDE. Die vorstehenden Ausführungen stellen weder einen Ausschluss noch eine Begrenzung der Haftung dar, die nach anwendbarem Recht nicht ausgeschlossen oder begrenzt werden darf. Datenschutzhinweis: Informationen darüber, wie MSCI personenbezogene Daten erhebt und verwendet, entnehmen Sie bitte unserer Datenschutzerklärung unter <https://www.msci.com/privacy-pledge>.

Copyright © 2024 CREDIT SUISSE. Alle Rechte vorbehalten.