



**So perfekt wie sein Vorbild:
CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue**

So perfekt wie ihr Vorbild

Der Wal. Die grössten unter ihnen erreichen bis zu 200 Tonnen Lebendgewicht, deutlich mehr als der schwerste Dinosaurier. Trotz ihres massiven Körpergewichts schwimmen Wale mit unglaublicher Wendigkeit durch die Weltmeere, was das Interesse der Ingenieure weckt.

Wissenschaftliche Untersuchungen haben gezeigt, dass die mit Beulen und Scharten versehenen Vorderkanten der Brustflossen des Buckelwals den Wasserwiderstand senken und die Manövrierfähigkeit der Tiere optimieren. Mit viel Know-how, Erfahrung und Präzision gelingt es, deren Geheimnisse nicht nur zu ergründen, sondern auch für den Menschen nutzbar zu machen. Heute können Ingenieure dies technisch replizieren, um beispielsweise effizientere Turbinenblätter zu produzieren.

Die Bionik als interdisziplinäres Forschungsfeld hat sich genau solche Erfolge als Ziel gesetzt. Sie überträgt herausragende Phänomene aus der Natur auf technische Anwendungen, die wir Menschen im Alltag einsetzen können.

Bei Credit Suisse Index Solutions teilen wir die Begeisterung für exakte Replikation. Mit der Kombination von Wissen, Erfahrung und Technologie machen wir ausgewählte Indizes für unsere Kunden weltweit investierbar. Unser Anspruch an höchstmögliche Präzision hat uns zu einem der europaweit führenden Anbieter von Indexfonds gemacht, die so perfekt sind wie ihr Vorbild.

Wir freuen uns, Ihnen eine bedeutende und exklusive Erweiterung unserer Produktpalette präsentieren zu dürfen: Der CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue macht den neuen SPI Multi Premia® Index investierbar. Der Index zielt darauf ab, Faktorprämien abzuschöpfen. Erfahren Sie auf den folgenden Seiten, was diesen Ansatz ausmacht und warum er so überzeugend ist.

Wissenschaftlich fundiert, präzise repliziert

Der SPI Multi Premia® Index basiert auf den 60 grössten und liquidesten Titeln aus dem SPI, schöpft gezielt Faktorprämien ab und sucht so eine Überrendite gegenüber dem SPI zu generieren. Er kombiniert sieben SPI Single Premia® Indizes, die jeweils eine systematische Renditequelle (sogenannte Faktoren) abschöpfen. Der SPI Multi Premia® Index bietet eine breite und diversifizierte Anlage in Schweizer Aktien, weil die relativen Renditen der einzelnen Strategien nur gering miteinander korrelieren.

Die Faktoren verhalten sich folglich in verschiedenen Marktphasen unterschiedlich, was den Renditeverlauf über den gesamten Marktzyklus verstetigt.

Renditetreiber in Aktienmärkten

| Faktor | Selektion von Unternehmen mit folgenden Eigenschaften: | Beispiel für Kennzahlen |
|-------------------|--|---|
| Value | Günstige Bewertung | Kurs-Buchwert-Verhältnis |
| Size | Kleine Unternehmensgrösse | Marktkapitalisierung |
| Momentum | Hohe Rendite in der Vergangenheit (12 Monate) | Jahresrendite abzüglich letztem Monat |
| Residual Momentum | Hohe Überrendite im Vergleich zum Markt in der Vergangenheit (12 Monate) | Jahresüberrendite abzüglich letztem Monat |
| Reversal | Geringe Rendite in der Vergangenheit (3-5 Jahre) | 5-Jahres-Rendite abzüglich letztem Jahr |
| Low Risk | Geringes Risiko | Volatilität |
| Quality | Solide und konstante Unternehmenserträge | Kapitalrentabilität |

Angaben zur historischen Wertentwicklung und zu Finanzmarktszenarien sind kein verlässlicher Indikator für laufende und zukünftige Ergebnisse. Quellen: SIX, Credit Suisse

Fondsübersicht

| Fondsname | Valoren-Nr. | ISIN | Referenzindex | Index Bloomberg Ticker | Kosten |
|--|-------------|--------------|-------------------------|------------------------|---------|
| CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue DA-Klasse | 33403119 | CH0334031199 | SPI Multi Premia® Index | SPIMTPC | 0,174 % |
| CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue QA-Klasse | 33403121 | CH0334031215 | SPI Multi Premia® Index | SPIMTPC | 0,350 % |
| CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue FA-Klasse | 33403120 | CH0334031207 | SPI Multi Premia® Index | SPIMTPC | 0,450 % |

Die Anteilklasse DA beinhaltet lediglich die Administrationsgebühren, während die Managementgebühren auf individueller Basis (anhand eines Mandatsvertrags zwischen dem Investor und der Credit Suisse) vereinbart und vierteljährlich bezahlt werden. Die QA- und FA-Anteilklassen beinhalten die Administrations- und Managementgebühren und können unabhängig von einem Mandatsvertrag gezeichnet werden. QA umschreibt die Anlageklasse für qualifizierte Investoren, FA diejenige für Privatanleger ohne Anlegerkreisbeschränkung. Quelle: Credit Suisse

Was genau zeichnet die Indexfonds der Credit Suisse aus, und wie unterscheiden sie sich von ETFs?

Indexfonds verfolgen einen passiven Anlageansatz, indem sie ihren Referenzindex möglichst exakt nachbilden. Die Indexfonds der Credit Suisse verfügen über einen langjährigen Leistungsausweis, ein hohes Fondsvermögen und eine grosse Genauigkeit bei der Indexnachbildung. Weitere Vorteile sind tägliche Liquidität und eine attraktive All-in-Fee.

Im Vergleich zu ETFs, die ebenfalls einem passiven Ansatz folgen, zeichnen sich Credit Suisse Indexfonds durch drei Stärken aus:

- Sie bilden ihre Referenzindizes physisch nach. Der Anleger erhält nahezu die gleiche Wertentwicklung, die der Index abbildet.
- Sie werden transparent zum Nettoinventarwert abgerechnet.
- Bei unseren Indexfonds nach Schweizer Recht fällt die Stempelsteuer für Schweizer Investoren vollständig weg, und bei denjenigen nach Luxemburger Recht entfällt sie jeweils bei Rückgaben (aber nicht bei Zeichnungen). ETFs hingegen werden an der Börse gehandelt, womit sowohl beim Kauf als auch beim Verkauf die Stempelsteuer anfällt.

Wie geschaffen für einen Credit Suisse Index Fund (CSIF)

SPI Multi Premia[®] liegt an der Schnittstelle zwischen Finanztheorie und Anlagepraxis und eignet sich hervorragend für die Replikation durch Credit Suisse Index Solutions. Die transparente Konstruktion, die Zusammensetzung aus den liquidesten Titeln des SPI und die solide finanzwissenschaftliche Basis bedeuten, dass der darauf basierende Fonds die Vorteile des passiven und des aktiven Anlegens vereint.

- Investition in sieben statistisch signifikante Renditequellen
- Robuste erwartete Überrendite in unterschiedlichen Marktphasen
- Hohes Diversifikationspotenzial über eine Vielzahl an Faktorprämien
- Schlanker Verwaltungsapparat und geringe Kosten

Klare und verständliche Anlagen seit über 20 Jahren

Credit Suisse Index Solutions ist seit 1994 auf indexierte Vermögensverwaltung spezialisiert und mittlerweile der grösste Anbieter von Indexfonds und indexierten Mandaten in der Schweiz. Das verwaltete Vermögen belief sich per Ende Juli 2016 auf CHF 101,8 Milliarden.

Unser globales Kompetenzzentrum mit Sitz in Zürich entwickelt mit Sorgfalt und Präzision klare und verständliche Anlageprodukte.

Unser qualifiziertes Team von Portfoliomanagern verfügt über langjährige Erfahrung in der Verwaltung von indexierten Portfolios. Mit modernsten Systemen für Portfoliomanagement und Risikoüberwachung schaffen wir Sicherheit für unsere Kunden – zu jeder Zeit. Durch die sorgfältige Auswahl unserer Partner für Indexberechnung, Administration und Wertschriftenhandel gewährleisten wir die hohe Qualität unserer Produkte.

Unsere neueste Entwicklung, der CSIF (CH) SPI Multi Premia® Index Blue, vereint die Vorteile eines Faktoransatzes mit denen der kosteneffizienten indexierten Vermögensverwaltung.



**Dr. Valerio
Schmitz-Esser**

Managing Director,
Leiter Index Solutions

CREDIT SUISSE AG

Asset Management

Client Services

Tel.: +41 44 333 40 50

clientservices.amfunds@credit-suisse.com

www.credit-suisse.com

Quelle: Credit Suisse, ansonsten vermerkt

Wichtige Hinweise

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 AG 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 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. Credit Suisse Index Funds (CH) Umbrella sind vertragliche Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen». Fondsleitung ist die Credit Suisse Funds AG, Zürich. Depotbank ist die Credit Suisse AG, Zürich.

Für Liechtenstein das Dokument darf nur von lizenzierten Rechtseinheiten verteilt werden.

Es ist einer begrenzten Anlegergruppe vorbehalten. Es darf nicht zu anderen Zwecken verwendet oder vervielfältigt werden und ist ausschliesslich für Personen bestimmt, denen das Dokument persönlich zugesendet wurde. Die vorliegenden Unterlagen und die darin beschriebenen Transaktionen unterliegen nicht der Aufsicht und Überprüfung durch die Finanzmarktaufsicht Liechtenstein.

Copyright © 2016 Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen und Tochtergesellschaften. Alle Rechte vorbehalten.

CH/G/201608