

CS Investment Funds 2 - Credit Suisse (Lux) Systematic Index Fund Yield CHF IB

Morningstar Categorie Index

Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld
Free NR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

CB CS (Lux) Systematic Index Fund Yield

Morningstar Rating™

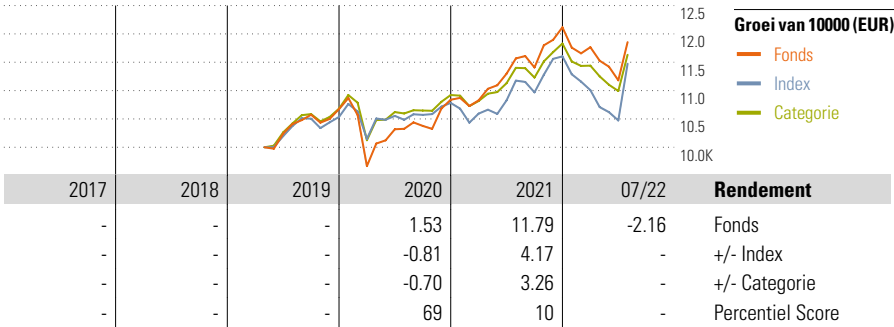
—

Morningstar Categorie™

Mixfondsen CHF Defensief

Beleggingsdoelstelling

Within the Subfund, the aim is to generate as much income as possible in the respective Reference Currency – while taking due account of the principle of risk diversification and the liquidity of the assets – by investing in the asset classes described below and focusing on current income.



Risicomaatstaven

Alpha	1.08	Sharpe Ratio	0.62
Beta	0.99	Std Deviatie	8.52
R-kwadraat	69.19	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	0.22	5-jr Risico	-
Tracking Error	4.54	10-jr Risico	-

Berekeningen met Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld Free NR (waar van toepassing)

Rendementen (30 aug 2022)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.18	2.77	3.38
6 Maanden	0.13	-0.99	0.15
1 jaar	-0.75	-6.52	-3.74
3 jr gean.	3.22	-0.73	1.16
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

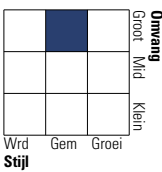
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2022	-2.90	-4.96	-	-
2021	-0.09	4.34	0.97	6.22
2020	-9.43	6.72	0.57	4.45
2019	-	-	3.25	0.96

Portefeuille 30 apr 2024

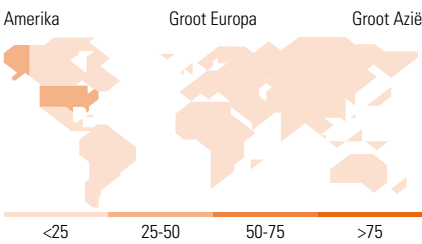
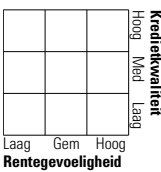
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	36.06	0.00	36.06
Obligaties	57.27	0.00	57.27
Kas/ geldmarkt	65.46	64.59	0.87
Overig	5.80	0.00	5.80

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
UBS(Lux)FS SBI@Frgn...	—	8.13
CSIF (Lux) Equity EMU ESG Blue...	—	7.70
iShares \$ Treasury Bd 3-7y ETF...	—	7.39
UBS(Lux)FS MSCI Swd IMI Scy Rp...	—	6.48
CSIF (Lux) Equity EmMkts ESG...	—	5.91
iShares MSCI USA SRI ETF USD Acc	—	4.43
CSIF (IE) MSCI USA ESG Ldrs Bl...	—	4.42
BNPP E JPM ESG EMBI GI Dvr...	—	4.38
UBS FS CMCI Composite SF USD A...	—	4.28
UBS(Lux)FS SBI@Frgn...	—	3.84
Totaal Aantal Aandelen		0
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		56.96

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	41.54
Basismaterialen	5.59
Cyclische consumentenproducten	10.11
Financiële dienstverlening	16.81
Vastgoed	9.03
Licht Cyclisch	36.09
Communicatiediensten	6.46
Energie	3.33
Industrie	10.85
Technologie	15.44
Defensief	22.37
Defensieve consumptiegoederen	7.73
Gezondheidszorg	12.43
Nutsbedrijven	2.21

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	30.62
Verenigde Staten	29.02
Canada	0.22
Latijns Amerika	1.38
Groot Europa	50.46
Verenigd Koninkrijk	4.91
West Europa – Euro	21.50
West Europa – Niet Euro	21.98
Emerging Europa	0.40
Midden-Oosten / Afrika	1.66
Groot Azië	18.93
Japan	5.31
Australazië	0.28
Azië - Ontwikkeld	5.53
Azië - Emerging	7.81

Fondsinformatie

Fondsgroep	Credit Suisse Fund...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	500,000
Telefoon	+352 4 36 16 11	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	-
Website	www.credit-suisse.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	20 mei 2019	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Sacha Widin	ISIN	LU1233274205		
Aanvangsdatum	1 jan 2018				
Koers (30 aug 2022)	CHF 997.63				
Fondsvermogen (mln)	CHF 1.00				