

Ceci est une communication commerciale.  
 Veuillez consulter le prospectus/document d'information du fonds et le DICI/DIC (selon ce qui est applicable) avant de prendre une décision de placement finale.  
 Ce produit ne peut être distribué que en ou depuis la Suisse aux investisseurs qualifiés, comme cela est défini par la loi fédérale sur les placements collectifs des capitaux (LPCC) en accord avec la loi fédérale sur les services financiers (LSFin).  
 Fournie à titre d'information uniquement, cette présentation ne saurait servir de base à quelque décision de placement que ce soit.

Asset Management  
**31 mars 2024**

# CSIF (CH) Bond Corporate Global ex CHF ESG Blue ZBH



## Information sur le fonds

Obligations

|   |  |  |
|---|--|--|
| <b>468'613'871</b><br>Total des actifs nets du fonds en CHF |  |  |
| TNA classe de parts, CHF<br><b>436'095'299</b>              | NAV classe de parts, CHF<br><b>860.68</b>                    | Frais courants <sup>1</sup><br><b>0.0215%</b>                |
| Rendement (net) MTD<br><b>0.98%</b><br>Indice <b>0.98%</b>  | Rendement (net) QTD<br><b>-0.92%</b><br>Indice <b>-0.94%</b> | Rendement (net) YTD<br><b>-0.92%</b><br>Indice <b>-0.94%</b> |

## Fiche du fonds

|                                |   |
|--------------------------------|---|
| Gestionnaire d'investissements | Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Index Solutions Team |
| Date de lancement              | 04.06.2020  |
| Date de lancement de la part   | 04.06.2020  |
| Catégorie de parts             | ZBH   |
| Devise au lancement            | CHF   |
| Politique de distribution      | Capitalisation  |
| Domicile du fonds              | Suisse  |
| Indice de référence            | Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H)             |

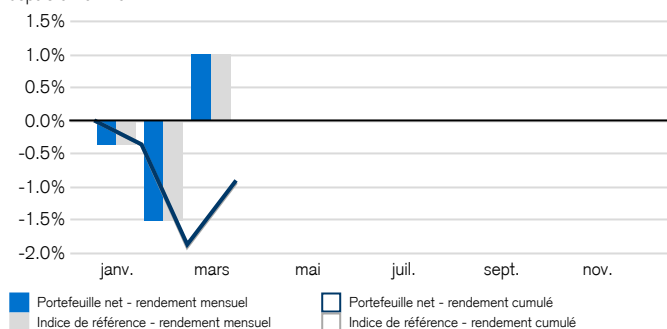
## Politique d'investissement

Le fonds est géré selon une méthode indexée et se distingue par une large diversification, de faibles erreurs de suivi et des frais de gestion modestes. Son objectif de placement est de reproduire au mieux l'indice de référence et de limiter autant que possible les écarts de performance par rapport à cet indice. Le Bloomberg MSCI Global Corporate ex-CHF Sustainability Index est un indice de référence des obligations d'entreprise investment grade à taux fixe, qui offre une exposition à des sociétés affichant une forte performance environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) par rapport à leurs concurrents du même secteur.

Tout investissement comporte des risques, dont celui de perdre son capital. La performance passée ne prédit pas les résultats futurs. Ni la performance simulée ni la performance historique ne sont un indicateur fiable de résultats actuels ou futurs.

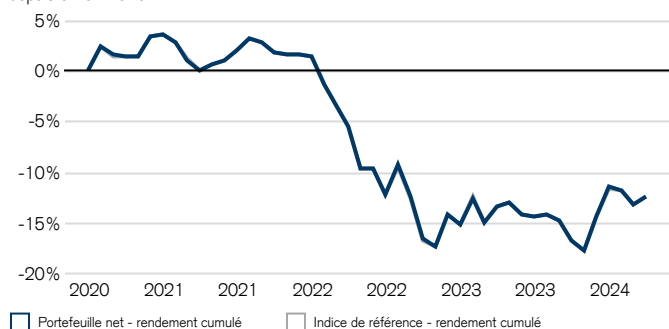
## Aperçu de la performance - mensuelle et cumulée

depuis 01.01.2024



## Aperçu de la performance - cumulée

depuis 01.07.2020



## Aperçu de la performance - mensuelle et YTD

depuis 01.01.2024, en %

|                     | janv.       | févr.       | mars        | avr. | mai | juin | juil. | août | sept. | oct. | nov. | déc. | YTD         |
|---------------------|-------------|-------------|-------------|------|-----|------|-------|------|-------|------|------|------|-------------|
| Portefeuille net    | -0.38       | -1.51       | 0.98        |      |     |      |       |      |       |      |      |      | -0.92       |
| Indice de référence | -0.38       | -1.53       | 0.98        |      |     |      |       |      |       |      |      |      | -0.94       |
| <b>Relatif net</b>  | <b>0.00</b> | <b>0.02</b> | <b>0.00</b> |      |     |      |       |      |       |      |      |      | <b>0.02</b> |

<sup>1</sup> Si la devise d'un produit financier et/ou ses coûts sont différents de votre devise de référence, son rendement et ses coûts peuvent augmenter ou décroître en fonction de la fluctuation des devises.

ESG signifie «Environnemental» (E), «Social» (S) et «Gouvernance» (G).

Le glossaire vous fournira la définition de tous les acronymes/termes utilisés dans ce document. Des informations supplémentaires importantes sont disponibles à la fin du document.

## Aperçu de la performance

depuis 01.07.2020, en %

|                     | Rendements glissants |             | Rendements annualisés |             |             |             |
|---------------------|----------------------|-------------|-----------------------|-------------|-------------|-------------|
|                     | 1 mois               | 3 mois      | 1 an                  | 3 années    | 5 années    | ITD         |
| Portefeuille net    | 0.98                 | -0.92       | 1.28                  | -4.30       | n.a.        | -3.46       |
| Indice de référence | 0.98                 | -0.94       | 1.21                  | -4.32       | n.a.        | -3.48       |
| <b>Relatif net</b>  | <b>0.00</b>          | <b>0.02</b> | <b>0.06</b>           | <b>0.02</b> | <b>n.a.</b> | <b>0.01</b> |

## Aperçu des risques - ex post

depuis 01.07.2020, en %

|                         | Risque annualisé, en % |             |             |             |
|-------------------------|------------------------|-------------|-------------|-------------|
|                         | 1 an                   | 3 années    | 5 années    | ITD         |
| Volatilité portefeuille | 6.73                   | 7.59        | n.a.        | 7.09        |
| Volatilité indice       | 6.71                   | 7.59        | n.a.        | 7.07        |
| <b>Erreur de suivi</b>  | <b>0.15</b>            | <b>0.12</b> | <b>n.a.</b> | <b>0.13</b> |

## Aperçu de la performance - annuelle

depuis 01.07.2020, en %

|                     | 2020        | 2021         | 2022         | 2023        | 2024        | ITD         |
|---------------------|-------------|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| Portefeuille net    | 3.67        | -2.13        | -16.40       | 4.26        | -0.92       | -12.38      |
| Indice de référence | 3.63        | -2.10        | -16.36       | 4.18        | -0.94       | -12.42      |
| <b>Relatif net</b>  | <b>0.04</b> | <b>-0.03</b> | <b>-0.05</b> | <b>0.07</b> | <b>0.02</b> | <b>0.04</b> |

## Répartition des actifs par devises

En % de l'exposition économique totale

|        | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|--------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| CHF    | 97.65        | 99.96               |                                     |
| USD    | 1.57         | 0.02                |                                     |
| EUR    | 0.58         | 0.00                |                                     |
| GBP    | 0.10         | 0.00                |                                     |
| CAD    | 0.07         | 0.00                |                                     |
| Autres | 0.03         | 0.02                |                                     |

## Répartition des actifs par durée

En % de l'exposition économique totale

|          | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|----------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| <1 an    | 0.54         | 1.02                |                                     |
| 1-3 ans  | 27.24        | 27.90               |                                     |
| 3-5 ans  | 23.93        | 22.72               |                                     |
| 5-7 ans  | 19.11        | 18.32               |                                     |
| 7-10 ans | 9.91         | 11.11               |                                     |
| >10 ans  | 19.26        | 18.92               |                                     |
| Autres   | 0.01         | -                   |                                     |

## Répartition des actifs par notation selon Bloomberg

En % de l'exposition économique totale

|        | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|--------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| AAA    | 0.85         | 0.81                |                                     |
| AA+    | 0.86         | 0.87                |                                     |
| AA     | 1.04         | 1.00                |                                     |
| AA-    | 5.51         | 5.69                |                                     |
| A+     | 11.46        | 11.78               |                                     |
| A      | 12.96        | 12.77               |                                     |
| A-     | 20.31        | 19.89               |                                     |
| BBB+   | 19.46        | 18.94               |                                     |
| BBB    | 19.95        | 18.44               |                                     |
| Autres | 7.60         | 9.81                |                                     |

## Répartition des actifs par secteur Bloomberg

En % de l'exposition économique totale

|                           | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|---------------------------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| Industriel                | 52.46        | 51.60               |                                     |
| Établissements financiers | 39.87        | 38.93               |                                     |
| Eau/gaz/électricité       | 9.56         | 9.50                |                                     |
| Liquidités                | 0.54         | -                   |                                     |
| Devises                   | -2.45        | -0.03               |                                     |
| Autres                    | 0.01         | -                   |                                     |

## Répartition des actifs par pays de risque

En % de l'exposition économique totale

|             | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|-------------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| États-Unis  | 53.22        | 52.52               |                                     |
| Royaume-Uni | 9.07         | 9.00                |                                     |
| France      | 7.08         | 7.01                |                                     |
| Canada      | 5.50         | 5.29                |                                     |
| Allemagne   | 4.25         | 4.17                |                                     |
| Autres      | 20.88        | 22.02               |                                     |

## Risques potentiels

Le profil de risque et de rendement ne reflète pas les risques auxquels le fonds pourrait être exposé à l'avenir en cas de développements sans rapport avec ce que le fonds a pu connaître dans un passé récent. Cela comprend notamment les risques suivants, rares mais susceptibles d'avoir un impact important.

- Risque de crédit: les émetteurs des actifs détenus par le Fonds peuvent ne pas verser de revenus ou ne pas rembourser le capital à l'échéance. D'une manière générale, les investissements du Fonds comportent un faible risque de crédit.
- Risque de liquidité: les actifs ne peuvent pas nécessairement être vendus à un coût limité dans un laps de temps suffisamment court. Les investissements du Fonds peuvent présenter une liquidité limitée. Le Fonds s'efforcera d'atténuer ce risque au moyen de différentes mesures.
- Risque de contrepartie: la faillite ou l'insolvabilité des contreparties du Fonds peut entraîner un défaut de paiement ou de livraison.
- Risque opérationnel: des processus inadéquats, des erreurs techniques et des événements catastrophiques peuvent être à l'origine de pertes.
- Risques politiques et juridiques: les placements sont exposés aux changements de normes et de lois du pays où ils sont effectués. Cela comprend les restrictions sur la convertibilité des monnaies, le prélèvement d'impôts et la réalisation de contrôles sur les transactions, les limites des droits de propriété, ainsi que d'autres risques juridiques.
- Risques en matière de durabilité: Les risques en matière de durabilité sont des conditions ou des événements environnementaux, sociaux ou de gouvernance qui peuvent avoir un impact négatif important sur le rendement, compte tenu du secteur, de la branche et de l'exposition de la société.

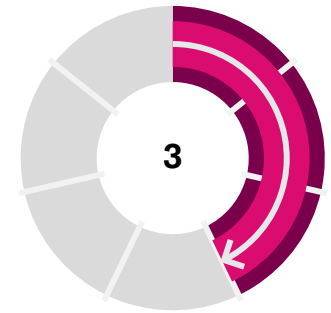
Les objectifs de placement, les risques, les frais et dépenses du produit, ainsi que des informations plus exhaustives sur celui-ci, sont fournis dans le prospectus (ou dans le document de l'offre), qui doit être lu avec attention avant tout investissement.

**Les investisseurs peuvent perdre tout ou partie du montant investi.**

**La documentation d'offre complète comprenant toutes les informations sur les risques peut être obtenue gratuitement auprès d'un conseiller clientèle du Credit Suisse, d'un représentant ou, le cas échéant, via Fundsearch (credit-suisse.com/fundsearch). L'investissement présenté dans ce document commercial concerne l'acquisition d'unités ou de parts d'un fonds et ne concerne pas l'acquisition d'actifs sous-jacents. Les actifs sous-jacents sont la seule propriété du fonds.**

## Profil de risque<sup>2</sup>

PRIIP SRI



Des valeurs plus élevées (jusqu'à 7) indiquent un risque supérieur, tandis que des valeurs plus faibles (jusqu'à 1) indiquent un risque inférieur.

## BVV2

- Total placements alternatifs (selon l'art. 53 OPP 2): 0
- Dont placements alternatifs (selon l'art. 53 al. 1 let. e OPP 2): 0
- Dont placements similaires à des créances (selon l'art. 53 al. 3 OPP 2): 0
- Le fonds investit uniquement dans des créances qui sont autorisées en vertu de l'art. 53 al. 1 let. b ch. 9 OPP 2.

Les affirmations en rapport avec l'ordonnance sur la prévoyance professionnelle vieillesse, survivants et invalidité (OPP 2) ont été énoncées par le CS avec le plus grand soin et en toute bonne foi. Elles représentent le point de vue du CS au moment de l'élaboration de la fact sheet et peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Le CS ne fournit aucune garantie quant aux classifications et décline toute responsabilité à cet égard.

## 10 plus larges émetteurs

En % de l'exposition économique totale

| Nom de l'émetteur <sup>3</sup> | Pondération |
|--------------------------------|-------------|
| BANK OF AMERICA CORP           | 1.74%       |
| JPMORGAN CHASE & CO            | 1.67%       |
| MORGAN STANLEY                 | 1.45%       |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE    | 1.20%       |
| HSBC HOLDINGS PLC              | 1.11%       |
| CITIGROUP INC                  | 0.98%       |
| AT&T INC                       | 0.95%       |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC     | 0.91%       |
| UBS GROUP AG                   | 0.90%       |
| APPLE INC                      | 0.80%       |

## Chiffres clés des risques

|   | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille                                 | Indice de référence |
|---|--------------|---------------------|--|---------------------|
| Pourcentage des 10 principales pondérations | 1.17%        | 0.58%               | Nombre de titres                             | 6'506 / 13'769      |
| Duration modifiée                           | 6.11         | 6.07                | Notation de crédit moyenne pondérée linéaire | BBB+ / BBB+         |
| Rendement à l'échéance                      | 1.44%        | 1.35%               |  |                     |
| Pire rendement possible                     | 1.38%        | 1.29%               |  |                     |

## Aperçu des risques - ex post

|      | 3 années     |
|------|--------------|
|      | Portefeuille |
| Bêta | 1.00         |

<sup>2</sup> L'indicateur de risque suppose que vous conservez le Produit pendant 5 ans. Le risque réel peut être très différent si vous optez pour une sortie avant échéance, et vous pourriez obtenir moins en retour. L'Indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce Produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce Produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés. Attention au risque de change si votre monnaie de référence est différente de la monnaie du Produit. Vous pourriez recevoir des paiements dans une monnaie différente, le rendement final que vous obtiendrez dépend donc du taux de change entre les deux monnaies. Les investisseurs doivent noter que le Produit peut être exposé à d'autres risques tels que des risques opérationnels, de contrepartie, politiques, de durabilité et juridiques qui ne sont pas inclus dans l'indicateur synthétique de risque. Ce Produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas du marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement.

<sup>3</sup> Les entités et/ou instruments mentionnés sur cette page ne le sont qu'à titre d'exemple, à ne pas interpréter comme une invitation à acheter ou à vendre tout intérêt ou investissement, ou comme une sollicitation en ce sens.

## Identifiants clés

|   |   |
|---|---|
| Nom de l'instrument                             | CSIF (CH) Bond Corporate Global ex CHF ESG Blue ZBH CHF |
| ISIN  | CH0424137526  |
| No de valeur                                    | 42413752  |
| Code Bloomberg                                  | CSEBPZC SW  |
| Indice de référence                             | Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H)   |
| Indice de référence code Bloomberg              | H34000CH  |
| Indice de référence traditionnel                | Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H)   |
| Indice de référence traditionnel code Bloomberg | H34000CH  |
| Autres classes de part                          | CH0424137500, CH0424137518, CH0424137526                |

## Données clés

|   |                        |
|---|------------------------|
| Direction du fonds                                    | Credit Suisse Funds AG |
| OPCVM   | Non                    |
| Fonds de fonds  | Oui                    |
| Fin d'exercice  | 28. février            |
| Prêt de valeurs mobilières                            | Non                    |
| Préavis de souscription                               | journalier             |
| Délai de souscription                                 | T + 3                  |
| Préavis pour le rachat                                | journalier             |
| Période de décompte de remboursement                  | T + 3                  |
| Frais de souscription (entièrement en faveur du fond) | 0.40%                  |
| Ecart de rachat (reste dans la fortune de placement)  | 0.00%                  |
| Heure limite de réception                             | 15:00 CET              |
| Swinging single pricing (SSP)                         | pas de swing NAV       |

## Approche ESG

Le fonds promeut les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG). En tant que fonds à stratégie de placement passive, les caractéristiques ESG du fonds et son approche d'intégration ESG sont dérivées de l'indice ESG suivi par le fonds. Par conséquent, les règles et critères ESG appliqués par le fonds sont définis par le promoteur d'indice et peuvent s'écarter des normes définies dans la politique d'investissement durable de CSAM.

En outre, le fonds peut appliquer des exclusions ESG supplémentaires, à condition de rester dans l'écart de suivi anticipé tel que déterminé dans le prospectus. Ces exclusions supplémentaires sont définies dans la politique d'investissement durable de CSAM et peuvent être fondées sur des normes (affectant les émetteurs qui ne sont pas conformes aux traités internationaux sur les armes controversées), sur des valeurs (affectant les émetteurs qui tirent une part importante de leurs revenus de la production de charbon thermique ou d'électricité à partir de charbon thermique) et sur des comportements de la SVVK-ASIR (c'est-à-dire les recommandations d'exclusion de l'Association suisse pour des investissements responsables affectant les émetteurs, dont le comportement ou les produits violent les critères normatifs de la SVVK-ASIR, p. ex. violations des conventions internationales ou production d'armes controversées).

Pour en savoir plus sur les critères d'investissement ESG et sur les aspects du fonds en matière de développement durable, veuillez consulter les documents juridiques et réglementaires du fonds (tels que, p. ex., le prospectus) et vous rendre sur le site [www.credit-suisse.com/esg](http://www.credit-suisse.com/esg). Parallèlement aux aspects relatifs au développement durable, la décision d'investir dans le fonds devrait prendre en considération tous les objectifs et les caractéristiques décrits dans le prospectus ou les informations devant être communiquées aux investisseurs conformément à la réglementation en vigueur.

Certains points de données sont fournis à la seule fin de transparence et ne se rapportent à aucun processus de placement ESG spécifique ni à la méthodologie ESG de CSAM. Pour de plus amples informations sur le processus de prise de décision du fonds en matière de placements ESG, veuillez vous reporter au prospectus du fonds.

Les répartitions présentées dans la section ESG ci-après s'appuient sur un indice de référence traditionnel qui peut s'écarter du principal indice de référence du fonds. Indice de référence du fonds : Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H). Indice de référence pour la répartition des actifs ESG: Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H).

## Caractéristiques ESG

| Index ESG                           | Critères d'exclusion                | Intégration ESG par le fournisseur d'indice | Actionnariat actif <sup>4</sup>     | Objectif d'investissement durable |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|-----------------------------------|
| <input checked="" type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/>         | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>          |

## Vue d'ensemble des critères ESG

Selon la méthodologie MSCI. Performance du fonds par rapport à l'indice de référence traditionnel: Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H).

|  | Portefeuille | Indice de référence |
|--|--------------|---------------------|
| Notation ESG   | AA           | A                   |
| Score qualité ESG  | 7.16         | 7.14                |
| Score environnemental  | 6.65         | 6.64                |
| Score social   | 4.96         | 4.95                |
| Score de gouvernance   | 5.96         | 5.97                |
| Couverture pour notation/score   | 101.85%      | 99.99%              |
| Moyenne pondérée intensité carbone (tonnes d'ém. CO2 / mio.\$ de C.A.) | 171.22       | 202.30              |
| Couverture pour intensité carbone                                      | 101.85%      | 99.99%              |

Remarque: le chiffre total de l'intensité carbone indiqué dans cette section peut être supérieur au total du graphique de ventilation, car le chiffre est normalisé et les poids réels sont gonflés en raison d'une couverture de données limitée. Pour plus d'informations sur la méthodologie de MSCI concernant les points de données ESG répertoriés ci-dessus, veuillez vous reporter au glossaire.

<sup>4</sup> L'actionnariat actif fait partie de la stratégie du fonds visant à agir au mieux des intérêts de ses investisseurs de préserver et d'optimiser la valeur à long terme de leurs placements. Afin de promouvoir les bonnes pratiques et de veiller à ce que les sociétés de portefeuille soient durables et prospères à long terme, l'actionnariat actif est pensé pour influencer les sociétés de portefeuille à deux niveaux: d'une part, au moyen du vote par procuration et, d'autre part, par le biais de l'engagement. Dans le cas de placements dans d'autres fonds (fonds cibles), le fonds n'a aucune capacité, ou seulement une capacité limitée, à exercer un actionnariat actif sur le fonds cible, ou sur les sociétés de portefeuille des fonds cibles.

## 10 premières positions - Caractéristiques ESG

En termes d'exposition économique totale du fonds. Certains points de données figurant dans le présent tableau sont fournis uniquement à des fins de transparence et ne se rapportent à aucun processus de placement ESG spécifique ni à la méthodologie ESG de CSAM. Pour plus de détails sur le processus de décision ESG du fonds, veuillez vous reporter au prospectus du fonds. Source: MSCI

| Nom de l'instrument <sup>5</sup> | Pondération | secteur GICS                        | Notation ESG MSCI | Indice de controverse | Intensité carbone (tCO2e / mio.\$ de C.A.) |
|----------------------------------|-------------|-------------------------------------|-------------------|-----------------------|--|
| BPCE SA                          | 0.13%       | Financiers                          | AA                | Jaune                 | 1.50                                       |
| NTT FINANCE CORP #16             | 0.13%       | Financiers                          | AA                | Orange                | 25.70                                      |
| NTT FINANCE CORP #17             | 0.13%       | Financiers                          | AA                | Orange                | 25.70                                      |
| MITSUI FUDOSAN CO LTD #83        | 0.12%       | Immobilier                          | AA                | Vert                  | 37.70                                      |
| BARCLAYS PLC                     | 0.12%       | Financiers                          | AA                | Orange                | 2.80                                       |
| FISERV INC                       | 0.12%       | Financiers                          | A                 | Vert                  | 7.60                                       |
| ANHEUSER-BUSCH COMPANIES LLC     | 0.11%       | Biens de consommation non cycliques | AA                | Jaune                 | 83.20                                      |
| APOLLO MANAGEMENT HOLDINGS LP    | 0.10%       | Financiers                          | BBB               | Jaune                 | 0.10                                       |
| BP CAPITAL MARKETS PLC           | 0.10%       | Énergie                             | A                 | Orange                | 150.70                                     |
| ABBVIE INC                       | 0.10%       | Santé                               | BBB               | Orange                | 10.60                                      |

Remarque: tous les points de données ESG de ce tableau se rapportent à un émetteur sous-jacent le cas échéant (p. ex. un émetteur d'actions dans le cas d'une obligation convertible). Pour plus d'informations sur la méthodologie concernant les points de données ESG répertoriés ci-dessus, veuillez vous reporter au glossaire.

### Répartition des actifs par notation ESG

En % de l'exposition économique totale. Performance du fonds par rapport à l'indice de référence traditionnel: Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H). Source: Notation ESG MSCI

|                              | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|------------------------------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| AAA                          | 9.99         | 9.28                |                                     |
| AA                           | 41.66        | 40.74               |                                     |
| A                            | 34.83        | 34.37               |                                     |
| BBB                          | 15.32        | 15.60               |                                     |
| BB                           | 0.10         | 0.00                |                                     |
| B                            | -            | -                   |                                     |
| CCC                          | -            | -                   |                                     |
| Non évaluable                | -1.91        | -0.03               |                                     |
| Aucune couverture de données | 0.01         | 0.04                |                                     |

Remarque: pour plus d'informations sur la méthodologie de notation ESG de MSCI et la différence entre les catégories «Non évaluable» et «Aucune couverture de données», veuillez vous reporter au glossaire.

### Répartition des actifs par indice de controverse ESG

En % de l'exposition économique totale du fonds aux sociétés d'investissement. Performance du fonds par rapport à l'indice de référence traditionnel: Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H). Source: MSCI

|                              | Portefeuille | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|------------------------------|--------------|---------------------|-------------------------------------|
| Vert                         | 30.23        | 28.78               |                                     |
| Jaune                        | 34.45        | 34.18               |                                     |
| Orange                       | 37.21        | 37.02               |                                     |
| Rouge                        | -            | -                   |                                     |
| Aucune couverture de données | -            | 0.03                |                                     |

Remarque: l'exposition aux sociétés d'investissement représente 101.85% du portefeuille pour cette classe d'actifs. MSCI fournit uniquement des données sur les controverses ESG pour les entreprises émettrices. Tous les autres instruments (p. ex. obligations d'État) sont exclus de cette répartition. Pour plus d'informations sur la méthodologie de signalement des controverses en matière d'ESG de MSCI, veuillez vous reporter au glossaire.

### Contribution à l'intensité des émissions de dioxyde de carbone par secteur Bloomberg

Intensité des émissions de tonnes d'équivalent CO2 (GES de scope 1 et 2) par million de dollars de revenus, selon secteur Bloomberg répartition. Performance du fonds par rapport à l'indice de référence traditionnel: Bloomberg MSCI Global Corp. ex-CHF Sust. (TR) (CHF-H). Source: MSCI

|                           | Portefeuille  | Indice de référence | Portefeuille<br>Indice de référence |
|---------------------------|---------------|---------------------|-------------------------------------|
| Eau/gaz/électricité       | 101.32        | 131.29              |                                     |
| Industriel                | 69.22         | 67.01               |                                     |
| Établissements financiers | 3.93          | 3.98                |                                     |
| Autres                    | 0.00          | 0.00                |                                     |
| Autres                    | 0.00          | 0.00                |                                     |
| <b>Total</b>              | <b>174.46</b> | <b>202.27</b>       |                                     |

Remarque: l'intégration de données pondérées en fonction des titres s'élève à 101.85% du portefeuille. Le total indiqué dans cette section peut être inférieur à celui de la vue d'ensemble ESG. En effet, les chiffres de cette ventilation ne sont pas normalisés et utilisent les poids réels. Pour en savoir plus sur l'intensité des émissions de carbone, veuillez vous reporter au glossaire.

<sup>5</sup> Les entités et/ou instruments mentionnés sur cette page ne le sont qu'à titre d'exemple, à ne pas interpréter comme une invitation à acheter ou à vendre tout intérêt ou investissement, ou comme une sollicitation en ce sens.

## Glossaire

|   |   |
|---|---|
| Capitalisation  | Indique un réinvestissement régulier des dividendes reçus dans le portefeuille  |
| Bêta  | Mesure de la volatilité, ou risque systématique, d'un titre ou d'un fonds donné par rapport au marché dans son ensemble.  |
| Intensité des émissions de carbone                      | L'intensité moyenne pondérée des émissions, qui est fournie par MSCI ESG, divise les émissions de scope 1 et 2 mesurées en tonnes de CO2 par le montant des ventes en million de dollars. Les intensités sont ventilées par secteur secteur Bloomberg et pondérées en fonction du niveau de sécurité.   |
| Politique de distribution                               | Indique si le fonds distribue ou réinvestit les dividendes reçus des titres sous-jacents (capitalisation)   |
| Sensibilisation à l'ESG                                 | Ce produit comprend des investissements qui intègrent et mesurent de façon explicite des critères de durabilité des entreprises dans leur processus d'investissement.   |
| Index ESG   | Une case «Index ESG» cochée indique que le fonds ESG vise une réplique d'un indice ESG et que l'indice de référence est utilisé dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues. Si la case n'est pas cochée, le fonds réplique un indice non ESG.  |
| Indice de controverse ESG                               | L'indice de controverse ESG est conçu pour fournir une évaluation cohérente et actualisée des controverses ESG impliquant des sociétés cotées et des émetteurs obligataires. Un cas de controverse est généralement un événement ponctuel tel qu'une marée noire, un accident ou par exemple des allégations concernant des problèmes de sécurité dans une usine. Les indices de controverse peuvent être rouge, orange, jaune ou vert. Le rouge indique qu'une entreprise est impliquée dans une ou plusieurs controverses très graves. L'orange indique que l'entreprise est impliquée dans une ou plusieurs controverses structurelles graves en cours. Le jaune indique que l'entreprise est impliquée dans des controverses de niveau grave à modéré. Le vert indique que l'entreprise n'est impliquée dans aucune controverse majeure. Pour de plus amples informations sur la méthodologie, veuillez consulter le site <a href="http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/">www.msci.com/our-solutions/esg-investing/</a> .  |
| Score qualité ESG                                       | Le score qualité ESG, basé sur les scores ESG sous-jacents de MSCI, est mesuré sur une échelle de 0 (très faible) à 10 (très bon). Il ne correspond pas directement aux scores sous-jacents des piliers environnemental, social et de gouvernance. Les scores des piliers sont calculés sur une base absolue tandis que le score qualité ESG du portefeuille est adapté afin de refléter le niveau d'exposition au risque ESG spécifique au secteur. Étant donné que les scores des piliers sont absolus et que le score qualité ESG du portefeuille est relatif, il n'est pas possible de prendre la moyenne du premier score pour en déduire le second. Le taux de couverture est pondéré en fonction du niveau de sécurité.  |
| Notation ESG de l'émetteur                              | Les notations ESG d'entreprises et de gouvernements, fournies par MSCI ESG, sont mesurées sur une échelle allant de AAA (notation la plus élevée) à CCC (notation la plus faible). Les notations ESG des entreprises sont basées sur l'exposition de l'émetteur aux risques ESG spécifiques au secteur et sur sa capacité à atténuer ces risques par rapport à ses pairs. Les notations ESG d'entreprises sont calculées sur une base sectorielle relative, tandis que les notations individuelles sous-jacentes E, S et G sont absolues. Par conséquent, la notation ESG ne peut pas être considérée comme une moyenne des notations individuelles E, S et G. Les notations ESG des gouvernements identifient l'exposition d'un pays aux facteurs de risque ESG ainsi que la gestion de ces derniers et expliquent comment ces facteurs peuvent avoir un impact sur la durabilité à long terme de l'économie de ce pays. Elles sont dérivées des scores de 0 à 10 attribués aux facteurs sous-jacents dans les piliers E, S et G. Pour de plus amples informations sur la méthodologie MSCI, veuillez consulter le site <a href="http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/">www.msci.com/our-solutions/esg-investing/</a> . |
| Ex post   | Fait référence à des mesures basées sur des données historiques   |
| Émissions de gaz à effet de serre (GES)                 | Les émissions de scope 1 sont générées par une entreprise directement à partir de sources lui appartenant ou contrôlées par elle telles que la combustion de carburant (stationnaire ou mobile), les processus industriels, etc. Les émissions de scope 2 sont des émissions indirectes, principalement liées à l'électricité consommée par une entreprise. Les émissions de scope 3 sont toutes les autres émissions indirectes liées aux activités d'une entreprise, comme les déplacements commerciaux, les déchets produits et les produits intervenant en amont (dans la chaîne d'approvisionnement) ainsi qu'en aval (utilisation des produits et fin de vie). Les émissions de scope 3 représentent généralement la part la plus importante des émissions d'une entreprise.  |
| ITD   | Du lancement à ce jour (Inception-to-date)  |
| MTD   | Depuis le début du mois (Month-to-date)   |
| MSCI  | MSCI se réfère au fournisseur de données externe MSCI ESG Research LLC et/ou à ses sociétés affiliées.  |
| Méthodologie ESG MSCI                                   | Pour plus d'informations sur la méthodologie employée pour estimer les caractéristiques ESG des investissements, merci de vous référer à <a href="http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/">www.msci.com/our-solutions/esg-investing/</a>   |
| NAV   | Valeur des actifs nette (Net Asset Value)   |
| Non évaluable / Aucune intégration de données           | Lorsque MSCI prend en compte un type d'actif pour une analyse ESG, mais que les données concernant une exposition économique ne sont pas disponibles en raison d'un manque de données du fournisseur de données, l'investissement relève de la catégorie «aucune intégration de données». Lorsque MSCI prend en compte un type d'actif hors du champ d'application de l'analyse ESG (p. ex. Espèces, Monnaie), l'exposition économique relève de la catégorie «non évaluable». Pour plus d'informations sur les types d'actifs exclus, veuillez consulter le site <a href="http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/">www.msci.com/our-solutions/esg-investing/</a> .  |
| Frais courants  | Le montant des charges en cours est basé sur les dépenses estimées, pour un maximum de 12 mois à compter de la fin de l'exercice financier du fonds et depuis sa création. Après cela, les charges en cours correspondent au TER du dernier rapport annuel. Les commissions de performance et les coûts de transaction de portefeuille sont exclus, sauf dans le cas d'une charge d'entrée/de sortie payée par le fonds lors de l'achat ou de la vente des parts/unités dans un autre organisme de placement collectif.   |
| Notation ESG du portefeuille / de l'indice de référence | Il peut exister des divergences entre la notation ESG au niveau du portefeuille calculée par CSAM en appliquant la méthodologie MSCI (fournie dans la présente fact sheet) et les notations ESG attribuées par d'autres fournisseurs (p. ex. notations de fonds ESG MSCI). Il existe trois raisons principales à ces éventuelles divergences: (1) CSAM base ses calculs sur les données mises à jour des positions de fin de mois et (2) CSAM utilise systématiquement les données des émetteurs sous-jacents le cas échéant (p. ex. émetteur d'actions dans le cas d'une obligation convertible), et (3) principe de transparence pour les fonds cibles appliqué par CSAM. Le taux de couverture est pondéré en fonction du niveau de sécurité. Pour de plus amples informations sur la méthodologie MSCI, veuillez consulter le site <a href="http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/">www.msci.com/our-solutions/esg-investing/</a> .   |
| QTD   | Depuis le début du trimestre (Quarter-to-date)  |
| Notation  | Mesures de la solvabilité d'un instrument financier (p. ex. une obligation) ou de son émetteur (p. ex. une entreprise ou un État). Elles sont publiées par les agences de notation et peuvent être regroupées en une seule mesure représentative  |
| Objectif d'investissement durable                       | Lorsque la case «objectif d'investissement durable» est cochée, cela signifie que le produit met en œuvre des stratégies d'investissement de CSAM qui allouent du capital aux entreprises apportant des solutions aux enjeux de la société et répondant à un objectif d'investissement durable. L'objectif d'investissement durable est atteint par le biais d'un processus d'investissement dédié axé sur les placements dans des thèmes et des secteurs dont les activités économiques répondent à des défis spécifiques posés par les enjeux ESG. Une case non cochée indique que le produit ne vise pas à atteindre un objectif de placement durable.   |
| TNA   | Total des actifs net (Total Net Assets)   |
| Erreur de suivi   | Mesure de l'écart du rendement d'un fonds par rapport au rendement d'un indice de référence sur une période de temps fixe.  |
| Indice de référence traditionnel (non ESG)              | Le fonds suit un indice de référence ESG. Néanmoins, la section ESG du présent document compare la performance ESG du portefeuille avec celle de l'indice traditionnel (non ESG). Cela permet de garantir la comparabilité entre un portefeuille ESG (qui suit l'indice ESG) et l'indice de marché traditionnel.  |
| YTD   | Depuis le début de l'année (Year-to-date)   |

## Messages d'avertissement

|  |   |
|--|---|
| Répartition des actifs                         | L'allocation indicative peut changer au fil du temps. Toutes les positions sont indiquées exclusivement à des fins d'information et ne constituent pas des recommandations de placement du Credit Suisse. Veuillez noter que ceci ne constitue pas une offre ou une sollicitation d'achat ou de vente d'un intérêt ou d'un placement quel qu'il soit. |
| Date de début de la performance                | Le calcul et la présentation de la performance commencent le premier mois complet d'une stratégie investie. Cela peut entraîner une différence dans les dates de lancement et de début de performance.  |
| PRIIP SRI                                      | L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce Produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce Produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés.  |
| Rendement à l'échéance/Pire rendement possible | Le rendement à l'échéance/pire rendement possible présenté est calculé au 31.03.2024 et ne tient pas compte des coûts, des évolutions du portefeuille, des fluctuations du marché et des défauts potentiels. Le rendement à l'échéance est fourni à titre indicatif uniquement et est susceptible d'évoluer.  |

## Remarques ESG

Les chiffres contenus dans cette section ne sont pas vérifiés. Les informations, déclarations et notes ESG contenues dans ce document et obtenues par le CS peuvent découler totalement ou partiellement d'informations accessibles au public, de données développées en interne et/ou d'informations obtenues auprès d'autres sources tierces que le CS estime fiables. La capacité du CS à vérifier de tels objectifs ESG peut être limitée par la fiabilité des données disponibles en ce qui concerne les actifs sous-jacents et le statut des réglementations en matière de suivi et de fourniture de ces données. Le CS n'a effectué aucune vérification indépendante des informations obtenues auprès de ces sources publiques et tierces et ne peut émettre aucune déclaration ni garantie quant à leur exactitude, leur exhaustivité ou leur fiabilité. Il est possible que les données des fournisseurs de données ESG soient incorrectes, indisponibles ou ne soient pas entièrement mises à jour. Cela est particulièrement vrai lorsque le CS dispose d'un accès limité aux données de parties externes concernant les éléments sous-jacents d'un investissement, par exemple en raison d'un manque de données de transparence. De telles lacunes dans les données pourraient mener à une évaluation inexacte d'une pratique de développement durable et/ou à des risques et opportunités de développement durable connexes. Les données ESG fournies dans ce document ne doivent pas être utilisées par les investisseurs pour satisfaire leurs propres exigences réglementaires en matière de publication ou de déclaration. Le CS ne peut pas garantir le contenu ni l'exhaustivité de ces publications en matière d'ESG, lesquelles restent sujettes à modification et ne sont pas entièrement fiables. En particulier, le CS ne saurait être tenu responsable de toute erreur ou omission liée à des données ESG contenues dans le présent document, ni de tout dommage direct, indirect, spécial, punitif, consécutif ou autre (y compris les pertes de bénéfices). En l'absence d'un système de classification ESG normalisé à l'échelle du secteur, le CS a développé son propre cadre ESG (le «cadre d'investissement durable du CS»). Par conséquent, les investisseurs noteront que la classification ESG du fonds reflète l'opinion du CS et est basée sur le cadre d'investissement durable du CS, qui peut varier de la classification établie par des tiers. Le fait qu'un fonds respecte le cadre d'investissement durable du CS ne signifie pas nécessairement qu'il répond aux objectifs d'investissement globaux des investisseurs, ni à leurs préférences en matière de développement durable. Étant donné que les règlements et les directives en matière de développement durable sont encore en cours d'élaboration, le CS peut avoir besoin d'examiner certaines classifications/descriptions relatives aux critères ESG à mesure que les pratiques du secteur évoluent et que davantage de directives réglementaires deviennent disponibles. La performance ESG d'un portefeuille peut également différer de sa performance financière et le CS ne peut pas faire de représentation quant à la corrélation entre la performance financière et la performance ESG. Les pratiques liées au développement durable diffèrent également selon la région, le secteur et le sujet concernés en matière d'ESG et évoluent constamment. Par conséquent, les pratiques liées au développement durable peuvent évoluer au fil du temps. De même, les nouvelles exigences locales en matière de développement durable peuvent entraîner des coûts de conformité supplémentaires, des obligations de publication ou d'autres restrictions concernant le fonds. Le point de vue de CS sur ce qui constitue une classification adéquate est également susceptible d'évoluer au fil du temps, y compris en réponse à des directives réglementaires ou à des changements dans l'approche d'un secteur envers la classification. Une modification de la classification concernée peut nécessiter la prise de mesures supplémentaires, telles que des publications supplémentaires ou de nouveaux processus de saisie des données, pouvant entraîner des coûts supplémentaires.

**Vous souhaitez en savoir plus?**

Rendez-vous sur: <https://credit-suisse.com/fundsearch>

#### Informations importantes

Source: Credit Suisse, sauf mention contraire

Des informations MSCI ont été utilisées dans ce document; ©2024 MSCI et/ou ses sociétés affiliées. Utilisé avec l'autorisation correspondante. Tous droits réservés; voir [msci.com/disclaimer](https://msci.com/disclaimer).

Ce support est un document marketing de Credit Suisse SA et/ou de ses filiales (ci-après dénommé «CS»).

Il ne constitue nullement ou ne fait partie d'aucune offre ou invitation à émettre ou vendre, ni une sollicitation d'offre de souscription ou d'achat de valeurs ou d'autres instruments financiers, ou à effectuer toute autre opération financière, ni ne constitue une incitation de souscription à un produit, une offre ou un placement. Ce document commercial n'est pas un document contractuellement contraignant ni un document d'information requis par une disposition législative quelconque. Aucun élément de ce support ne saurait constituer une recherche ou un conseil en investissement et ne peut en aucun cas y être assimilé. Il n'est pas adapté à votre situation personnelle ni ne constitue une recommandation personnalisée et ne suffit pas pour prendre une décision de placement. 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. Le CS ne fournit aucune garantie quant au contenu et à l'exhaustivité de ces informations et, dans la mesure où la loi le permet, il décline toute responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de l'utilisation de ces informations. Sauf mention contraire, les chiffres n'ont pas été vérifiés. Les informations fournies dans le présent document sont réservées au seul usage de son destinataire. Les informations figurant dans ce support peuvent être modifiées sans préavis après la date d'émission de celui-ci sans que CS soit tenu de les actualiser. Ce support peut contenir des informations sous licence et/ou protégées par les droits de propriété intellectuelle des concédants de licence et des détenteurs du droit à la propriété. Rien dans ce support ne saurait être interprété comme imposant une responsabilité aux concédants de licence ou aux détenteurs du droit à la propriété. La copie non autorisée des informations des concédants de licence ou des détenteurs du droit à la propriété est formellement interdite. La documentation complète présentant l'offre, le prospectus ou la notice d'offre, le document d'information clé pour l'investisseur («DICI»), le document d'information clé («DIC»), les règles du fonds ainsi que les rapports annuels et bisannuels («Documentation complète présentant l'offre»), si ceux-ci existent, peuvent être obtenus gratuitement dans une des langues listées ci-dessous auprès de l'entité juridique indiquée ci-dessous et, dès lors qu'ils sont disponibles, via FundSearch ([credit-suisse.com/fundsearch](https://credit-suisse.com/fundsearch)). Les informations concernant vos distributeurs, représentants locaux, l'agent d'information, l'agent payeur, si ceux-ci existent, et vos contacts locaux relativement au(x) produit(s) d'investissement figurent ci-dessous. Les seules conditions juridiquement contraignantes applicables aux produits de placement indiqués dans ce document, notamment en ce qui concerne les risques, les objectifs, les frais et les dépenses, sont celles qui figurent dans le prospectus, le memorandum de placement, les documents de souscription, le contrat de fonds et/ou tout autre document régissant le fonds. Vous trouverez la description complète des caractéristiques des produits nommés dans ce document ainsi que la description complète des opportunités, risques et coûts associés à ces produits dans les prospectus correspondants des titres sous-jacents, prospectus de vente ou bien autres documentations produits détaillées que nous mettons volontiers à votre disposition à tout moment, sur simple demande. L'investissement présenté dans ce document commercial concerne l'acquisition d'unités ou de parts d'un fonds et non pas d'actifs sous-jacents. Les actifs sous-jacents sont la seule propriété du fonds. Ce document ne peut en aucun cas être transféré ou distribué à une autre personne ni ne peut être reproduit. Tout transfert, distribution ou reproduction est interdit et peut entraîner une violation de la loi américaine de 1933 sur les valeurs mobilières, US Securities Act, telle que modifiée et actuellement en vigueur (loi ci-après dénommée «Securities Act»). Les valeurs concernées dans la présente n'ont pas été ni ne seront enregistrées conformément au Securities Act, ni aux lois en matière de valeurs mobilières en vigueur dans tout autre Etat des Etats-Unis et, sous réserve de certaines exceptions, les valeurs ne peuvent pas être offertes, données en garantie, vendues ou transférées sur le territoire des Etats-Unis ou vers les Etats-Unis, ni au bénéfice ou pour le compte de personnes US.

De plus, il peut y avoir des conflits d'intérêts concernant l'investissement. Dans le cadre de la prestation de services, Credit Suisse AG et/ou ses filiales peuvent le cas échéant payer à des tiers ou recevoir de la part de tiers, sous forme de frais ou autre, une rémunération unique ou récurrente (par exemple commissions de souscription, commissions de placement ou de suivi). Avant de prendre toute décision de placement, les investisseurs potentiels doivent évaluer indépendamment et avec soin (avec leurs conseillers fiscaux, juridiques et financiers) les risques spécifiques décrits dans les supports accessibles, les conséquences légales, réglementaires, fiscales et comptables ainsi que l'impact sur le crédit. Le gestionnaire de fonds d'investissement alternatif ou la société de gestion (des OPCVM), selon ce qui est applicable, peut décider de résilier les accords locaux concernant la commercialisation des parts/unités d'un fonds, y compris mettre un terme aux enregistrements ou aux notifications avec l'autorité de surveillance locale. Une énumération des droits des investisseurs concernant les investissements dans des fonds d'investissement domiciliés dans l'Espace économique européen, gérés ou sponsorisés par Credit Suisse Asset Management, peut être obtenu en français et en anglais via [www.credit-suisse.com/am/regulatory-information](https://www.credit-suisse.com/am/regulatory-information). La législation locale relative aux droits des investisseurs peut s'appliquer.

#### Suisse

**Représentant pour Lux fonds et Société de gestion pour les fonds Suisses:** Credit Suisse Funds AG<sup>1</sup>, Uetlibergstrasse 231, CH-8070 Zurich

**Agent payeur (pour les fonds Luxembourgeois), Dépositaire (pour les fonds Suisses) et Distributeur – si ce document est distribué par:** Credit Suisse (Schweiz) AG, Paradeplatz 8, CH-8001 Zurich

**Superviseur (Autorité d'enregistrement):** Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers («FINMA»)

**Distributeur – si ce document est distribué par:** Credit Suisse AG, Paradeplatz 8, CH-8001 Zurich

**Distributeur – si ce document est distribué par:** Credit Suisse Asset Management (Switzerland) Ltd., Kalandergasse 4, CH-8045 Zurich

<sup>1</sup>Entité légale auprès de laquelle la documentation complète de l'offre, le document d'information clé pour l'investisseur («DICI»), les documents constitutifs et les rapports annuels et semestriels, le cas échéant, peuvent être obtenus gratuitement.

**Versions disponibles en:** anglais, allemand, français ou italien

Copyright © 2024 CREDIT SUISSE. Tous droits réservés.