

Risk profile (SRRI) <sup>1)</sup>

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

## CS (Lux) Broad EUR Bond Fund

### Clase EB EUR

#### Política de inversión

El objetivo de inversión es obtener ingresos atractivos y estables en EUR basados en el rendimiento del mercado para bonos en EUR con vencimientos a medio y largo plazo. El fondo invertirá en bonos EUR de medio a largo plazo ampliamente diversificados, otros instrumentos de renta fija, así como instrumentos a tipo de interés variable de la categoría de grado de inversión. El fondo puede invertir también en valores convertibles y bonos con opciones.

#### Datos principales

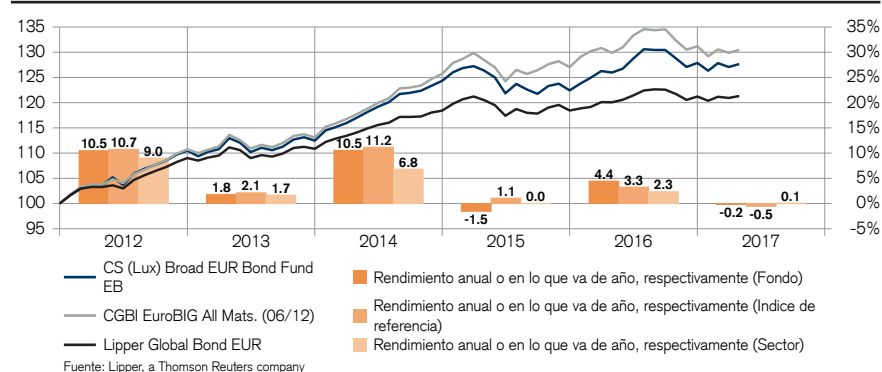
|                                                    |                                     |
|----------------------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Gestor del fondo</b>                            | Michel Berger                       |
| <b>Gestor de fondos desde</b>                      | 31.05.2012                          |
| <b>Domicilio de gestión</b>                        | Zurich                              |
| <b>Domicilio del fondo</b>                         | Luxemburgo                          |
| <b>Moneda del fondo</b>                            | EUR                                 |
| <b>Cierre del ejercicio</b>                        | 31 de marzo                         |
| <b>Patrimonio (en mill.)</b>                       | 60.04                               |
| <b>Fecha de lanzamiento</b>                        | 31.05.2012                          |
| <b>Comisión de gestión anual en %</b>              | 0.25                                |
| <b>TER (a 31.03.2016) en %</b>                     | 0.43                                |
| <b>Índice de referencia (BM)</b>                   | CGBI EuroBIG All Mats. (06/12)      |
| <b>Swinging single pricing (SSP) <sup>3)</sup></b> | Si                                  |
| <b>Clase de participaciones</b>                    | <b>Clase EB</b><br>(capitalización) |
| <b>Moneda de las categorías de Participaciones</b> | EUR                                 |
| <b>Código ISIN</b>                                 | LU0650587404                        |
| <b>Código Bloomberg</b>                            | CSBEURF LX                          |
| <b>Valor Liquidativo</b>                           | 161.23                              |
| <b>Amortizaciones</b>                              | Diario                              |

3) Para más información, por favor consulte el capítulo correspondiente, titulado "Valor liquidativo", del folleto del fondo.

#### Número de posiciones

|              |    |
|--------------|----|
| <b>Fondo</b> | 86 |
|--------------|----|

#### Rentabilidad neta en EUR (porcentualizada) y rendimiento anual <sup>2)</sup>

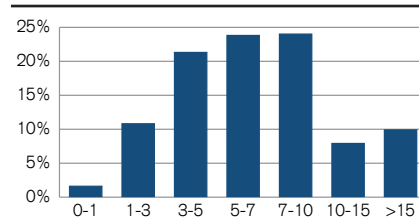


Former Track record of Orchis EUR Fixed Income (19.04.2005 - 30.05.2012)

#### Rentabilidad neta en EUR <sup>2)</sup>

|                      | 1 mes | 3 meses | YTD   | 1 año | 3 años | 5 años |
|----------------------|-------|---------|-------|-------|--------|--------|
| Fondo                | 0.45  | 1.05    | -0.17 | 1.34  | 9.10   | 23.21  |
| Índice de referencia | 0.45  | 0.98    | -0.55 | 0.45  | 10.84  | 25.77  |
| Sector               | 0.32  | 0.78    | 0.09  | 1.04  | 6.34   | 17.48  |

#### Vencimiento en años



#### Monedas en %

|     | antes de cobertura | después de cobertura |
|-----|--------------------|----------------------|
| EUR | 99.96              | 99.96                |
| USD | 0.04               | 0.04                 |
| CHF | 0.00               | -                    |

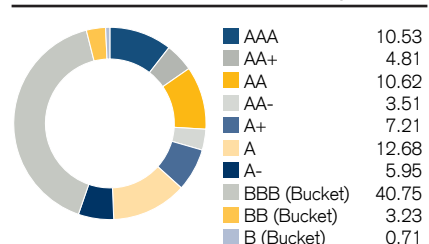
#### Duración y rendimiento

|                                    | Fondo |
|------------------------------------|-------|
| Rentabilidad bruta de cartera en % | 0.79  |
| Vencimiento medio en años          | 7.43  |
| Duración modificada en años        | 6.14  |

#### Estructura de la cartera en %

|                                   |       |
|-----------------------------------|-------|
| Bonos industriales                | 40.73 |
| Bonos del Estado                  | 38.09 |
| Bonos financieros                 | 8.95  |
| Sovereign/Agencies                | 6.17  |
| Servicios públicos                | 3.81  |
| Títulos respaldados por activos   | 1.83  |
| Efectivo/equivalentes de efectivo | 0.42  |

#### Calificaciones crediticias en %



Calificación crediticia media ponderada por probabilidad de incumplimiento = BBB  
Calificación crediticia media ponderada lineal = A-

#### Valores estadísticos del fondo

|                                               | 3 años | 5 años |
|-----------------------------------------------|--------|--------|
| Volatilidad anualizada en %                   | 3.51   | 3.52   |
| Coefficiente de información                   | -0.43  | -0.38  |
| Tracking Error (Ex post)                      | 1.22   | 1.08   |
| Máxima pérdida del período en % <sup>4)</sup> | -4.32  | -4.32  |

4) La pérdida máxima consiste en el mayor rendimiento acumulativo negativo en un período determinado.

#### 10 posiciones principales en %

| Principales valores | Vencim.  | % del fondo  |
|---------------------|----------|--------------|
| France OAT          | 25.11.24 | 3.55         |
| Italia              | 01.09.20 | 2.83         |
| Alemania            | 04.01.37 | 2.67         |
| Francia             | 25.10.38 | 2.47         |
| Finlandia           | 04.07.28 | 2.11         |
| Italia              | 01.12.24 | 2.05         |
| Microsoft           | 02.05.33 | 2.00         |
| Frankreich          | 25.10.22 | 1.91         |
| Shell Intl. Fin.    | 24.03.26 | 1.91         |
| ICO Reg             | 20.05.19 | 1.90         |
| <b>Total</b>        |          | <b>23.40</b> |

<sup>1)</sup> El cálculo del indicador del riesgo se basa en la Directiva CESR/10-673. El indicador del riesgo se basa en datos históricos o parcialmente simulados y no se puede utilizar para predecir evoluciones futuras. La clasificación del fondo puede cambiar en el futuro y no representa ningún tipo de garantías. La clasificación en la categoría 1 no entraña una inversión libre de riesgos.

<sup>2)</sup> Los rendimientos y escenarios de los mercados financieros pasados no son indicadores fiables de rendimientos futuros. Los datos de rendimiento no incluyen las comisiones y los costes incurridos en la emisión y el reembolso de las participaciones en fondos.

El aviso legal mencionado al final de este documento también es aplicable a esta página.

## Contacto

**CREDIT SUISSE AG**  
**Sucursal en España**  
**Calle Ayala 42**  
**28001 Madrid/Spain**  
**Tel +34 91 791 60 00 Fax +34 91 791 60 10**

Este documento ha sido elaborado por Credit Suisse AG y/o alguna de sus empresas asociadas (en lo sucesivo "CS") con el máximo esmero y conforme a su leal saber y entender. Sin embargo, CS no ofrece garantía respecto a su contenido y su exhaustividad, y declina cualquier responsabilidad por las pérdidas que pudieran producirse al utilizar esta información. Las opiniones expresadas en este documento corresponden al CS en el momento de redactarlo y están sujetas a modificaciones en cualquier momento sin previo aviso. Salvo indicación en contrario, todas las cifras están sin auditar. Este documento tiene finalidad únicamente informativa y su uso está reservado exclusivamente al receptor. No constituye una oferta o recomendación de compra o venta de instrumentos financieros o servicios bancarios y no exime al receptor de formar su propio juicio. Se recomienda en particular al receptor que compruebe si la información ofrecida está en línea con sus propias circunstancias respecto a cualquier consecuencia legal, regulatoria, fiscal, etc., en caso necesario con la ayuda de un asesor profesional. Este documento no puede reproducirse ni en todo ni en parte sin la autorización por escrito del CS. Ni el presente documento ni una copia del mismo podrán enviarse o llevarse a los Estados Unidos, ni distribuirse en los Estados Unidos o a una persona US (en el sentido del Reglamento S de la Ley de Valores de 1933 de EE.UU. en su versión vigente). No se dirige a personas que, por su nacionalidad o lugar de residencia, tienen prohibido el acceso a este tipo de información por la legislación local. Toda inversión implica riesgos, especialmente en lo relativo a las fluctuaciones del valor y del rendimiento. Las inversiones en monedas extranjeras implican el riesgo adicional de que puedan perder valor frente a la moneda de referencia del inversor. Rentabilidades históricas, futuras y los escenarios de los mercados financieros no son garantía de rentabilidades corrientes y futuras. Las indicaciones de rentabilidades no tienen en cuenta los gastos y comisiones aplicados con motivo de la suscripción y el reembolso de las participaciones. Además, no se puede garantizar que sea alcanzado o excedido el rendimiento del índice de referencia. En relación con las transacciones sobre los productos o servicios mencionados en este documento, puede ser que Credit Suisse AG pague a terceros o reciba de terceros una remuneración única o recurrente como parte de su compensación. En caso de necesitar informaciones adicionales puede ponerse en contacto con su asesor financiero. No puede excluirse potenciales conflictos de interés. Este documento se considera material de marketing publicado para fines publicitarios. No debe leerse como un análisis financiero o de inversión independiente. Tampoco constituye asesoramiento financiero ni cualquier otro servicio financiero regulado. Los fondos de inversión mencionados en la presente publicación son organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) constituidos de conformidad con el Derecho luxemburgués y están sujetos a la Directiva 2009/65/EC de la UE y sus modificaciones. Las suscripciones sólo serán válidas sobre la base de folleto de venta actual, del folleto simplificado actual o del documento de información clave para los inversores (si se hubiese establecido) y del más reciente informe anual (o informe semestral, si éste fuese más reciente), el último Informe económico publicado y la Memoria de comercialización del fondo en España registrada en la Comisión Nacional del Mercado de Valores. Estos, junto con los demás documentos constitutivos del fondo, pueden obtenerse gratuitamente solicitándolos a Credit Suisse AG, Sucursal en España, con domicilio social en la Calle Ayala 42, 28001 Madrid, España. Los inversores deben leer y analizar cuidadosamente el contenido de dichos documentos y buscar asesoramiento profesional de considerarlo necesario, antes de realizar cualquier inversión en este producto. Este material es distribuido en España por Credit Suisse AG, Sucursal en España, entidad registrada en la Comisión Nacional del Mercado de Valores como distribuidor del fondo.

Copyright © 2017 Credit Suisse Group AG y/o sus filiales. Todos los derechos reservados.