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.

31 octobre 2023
France

Multi Asset Premia ("MAP") BH (EUR)

Politique d'investissement

La stratégie de placement de ce fonds est centrée sur la monétisation de sources de rendement (primes de risque) dans un large éventail de classes d'actifs et au moyen de méthodes d'investissement alternatives sophistiquées, permettant de construire un portefeuille très diversifié. Le fonds sera exposé aux principaux style factoriels alternatifs, y compris, sans toutefois s'y limiter: le portage, la valeur, le momentum et, dans le cas des actions, la qualité, la capitalisation et la volatilité. Ces styles peuvent notamment s'appliquer sur les marchés suivants: actions, revenu fixe, volatilité, marché monétaire, devises et matières premières, avec une mise en œuvre reposant principalement sur des swaps de rendement excédentaire sur indices éligibles OPCVM.

Caractéristiques du fonds

Nom du gestionnaire	Didier Anthamatten, Philipp Müller, Giuseppe Travigilia
Gérant du fonds depuis	04.04.2022, 15.11.2022, 04.04.2022
Gérant basé à	Zürich, Switzerland
Gestionnaire d'investissement	Credit Suisse AG, Zurich
Direction du fonds	MultiConcept Fund Management S.A.
Domicile du fonds	Luxembourg
Devise du fonds	USD
Fin de l'exercice fiscal	31 décembre
Encours total (en mio.)	429,60
Date de lancement	07.05.2019
Frais de gestion par an [2]	1,20%
Frais courants [2]	1,41%
Swinging single pricing (SSP) [4]	Oui
Catégorie de parts	**Tranche BH (capitalisation)**
Monnaie des catégories de parts	EUR
Code ISIN	LU1963358541
Code Bloomberg	MCMAPBE LX
N° de valeur	46852474
Valeur liquidative	99,69

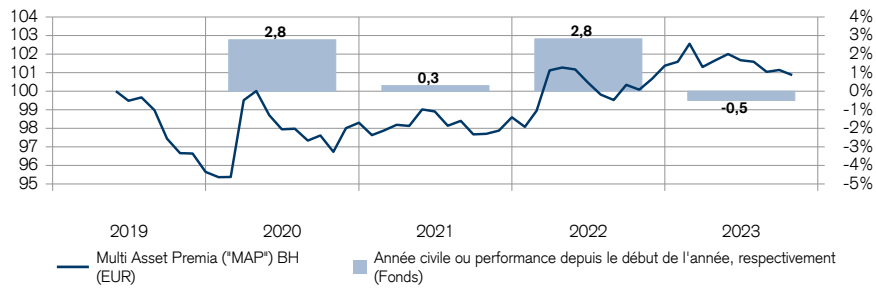
Statistiques du fonds

	1 an	3 ans
Volatilité annualisée en %	2,10	2,37

Principales positions de couverture en %

Société	Coupon %	Maturité	en % des capitaux
Treasury Bill		18.04.24	10,17
Treasury Bill		16.05.24	10,12
Treasury Bill		30.11.23	9,22
Treasury Bill		31.03.24	9,16
Treasury Bill		07.03.24	9,08
Treasury Bill		21.03.24	9,08
Treasury Bill		11.01.24	8,70
Israel Makam Bill		08.11.23	8,12
Treasury Bill		25.01.24	8,02
Treasury Bill		22.02.24	4,56
Total			**86,23**

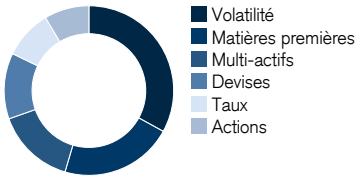
Performance nette en EUR (base de 100) et performance annuelle [1]



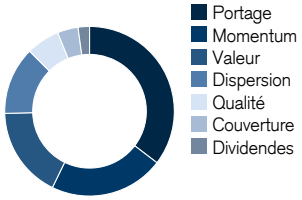
Performance nette en EUR [1]

	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans	5 ans
Fonds	-0,27	-0,71	-0,50	0,79	4,28	-

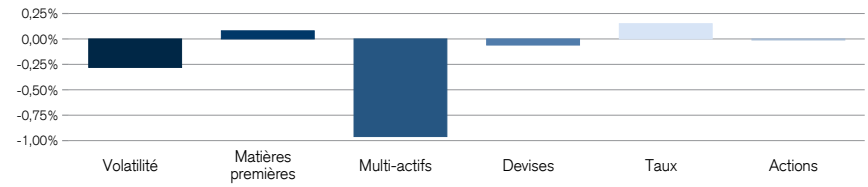
Allocation par classe d'actifs



Allocation par prime

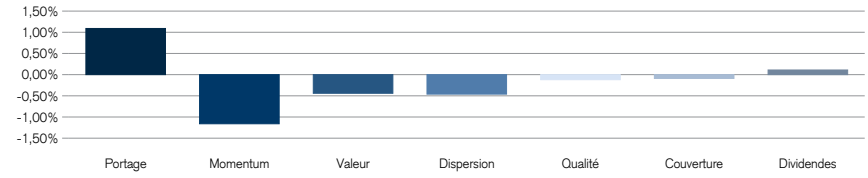


Contribution par classe d'actifs (brute) [3]



en %	Volatilité	Matières premières	Multi-actifs	Devises	Taux	Actions
Exposition actuelle	50,4	32,9	23,0	19,2	14,2	13,0
Contribution MTD	0,15	-0,18	-0,09	-0,24	-0,08	0,03
Contribution YTD	-0,28	0,08	-0,96	-0,06	0,15	-0,01

Contribution par prime (brute) [3]



en %	Portage	Momentum	Valeur	Dispersion	Qualité	Couverture	Dividendes
Exposition actuelle	54,0	33,3	26,5	19,7	9,7	6,0	3,3
Contribution MTD	0,10	-0,13	-0,38	0,00	0,01	-0,02	0,01
Contribution YTD	1,09	-1,16	-0,44	-0,46	-0,12	-0,09	0,11

1) 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.
2) 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 décroitre en fonction de la fluctuation des devises.
3) Les légères différences entre l'attribution mensuelle totale du portefeuille et la performance nette mensuelle sont dues aux charges et aux commissions de gestion. Les rendements générés depuis le début de l'année par les fonds représentent la performance depuis le lancement des fonds lancés pendant l'année en cours. Les rendements générés depuis le début de l'année par les gérants de hedge funds représentent la performance depuis le capital initial du fonds dans chaque fonds sous-jacent.
4) Pour plus de détails, veuillez vous référer au chapitre «Valeur nette d'inventaire» du prospectus du fonds.

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. Les investissements du Fonds comportent un risque de crédit important.
- 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. En outre, la vente à découvert de titres peut exposer le Fonds à un risque de liquidité particulier.
- Risque de contrepartie: la faillite ou l'insolvabilité des contreparties du Fonds peut entraîner un défaut de paiement ou de livraison. Le Compartiment s'efforcera d'atténuer ce risque au moyen de garanties financières reçues à titre de cautionnement.
- 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.
- L'utilisation de l'effet de levier par le fonds peut entraîner une amplification des mouvements de marché, c'est-à-dire augmenter la volatilité du fonds, ainsi qu'un accroissement des pertes par rapport aux produits qui n'utilisent pas cet effet de levier.

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.

La documentation de placement complète présentant toutes les informations sur les risques peut être obtenue gratuitement auprès d'un représentant de Credit Suisse ou, si disponible, via https://www.credit-suisse.com/microsites/multiconcept/en/our-funds.html.

Contact

e-mail: list.wealth-funds@credit-suisse.com

Sources des données à partir du 31. octobre 2023: Credit Suisse, sauf indication contraire.
Pour plus d'informations concernant ce fonds, veuillez contacter votre Relationship Manager.

Clause de non-responsabilité

France: Ce document est distribué par Credit Suisse (Luxembourg) S.A., Succursale en France (« la succursale française ») qui est une succursale de Credit Suisse (Luxembourg) S.A., un établissement de crédit dûment autorisé au Luxembourg (Grand-Duché du Luxembourg) dont l'adresse est 5 rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg. La succursale française est soumise au contrôle prudentiel de l'autorité de supervision luxembourgeoise, la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF), 283, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg et également autorisée et réglementée en France par l'Autorité de Contrôle Prudentiel et de Résolution (ACPR) et l'Autorité des Marchés Financiers (AMF).
Les informations fournies constituent un support marketing. Ce document commercial n'est pas un document contractuellement contraignant ni un document d'information requis par une disposition législative quelconque. Les informations fournies dans le présent document ne constituent ni une offre ni une incitation visant à la conclusion de quelque transaction financière que ce soit. 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 fournies dans le présent document ont été élaborées par Credit Suisse AG et/ou ses filiales (ci-après "CS") avec le plus grand soin et en toute bonne foi. 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. Il est interdit d'envoyer, d'introduire ou de distribuer ces informations ou une copie de celles-ci aux Etats-Unis ou de les remettre à une personne US (au sens de la Regulation S de l'US Securities Act de 1933, dans sa version amendée). La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit du CS est interdite. Les actions sont soumises aux lois du marché et donc sujettes à des fluctuations de valeur qui ne sont pas complètement prévisibles. Les placements dans les marchés émergents impliquent généralement des risques élevés tels que les risques politiques, les risques économiques, les risques de crédit, les risques de change, les risques d'illiquidité, les risques juridiques, les risques de règlement et les risques de marché. Les marchés émergents sont situés dans des pays qui répondent à une ou plusieurs des caractéristiques suivantes: une certaine instabilité politique, une relative imprévisibilité des marchés financiers et de la croissance économique, un marché financier encore en phase de développement ou une économie faible. En outre, les monnaies étrangères sont exposées au risque de dépréciation par rapport à la monnaie de référence de l'investisseur. Ce fonds est domicilié en Luxembourg. Le représentant en Suisse est Credit Suisse Funds AG, Zurich. Le service de paiement en Suisse est Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich. 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 auprès de représentant en Suisse ou de toute succursale de CS en Suisse et, dés lors qu'ils sont disponibles, via http://www.fundinfo.com/. 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. Le gestionnaire de fonds d'investissement alternatifs 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 en Luxembourg, peut être obtenu via le site https://www.credit-suisse.com/microsites/multiconcept/en.html, La législation locale relative aux droits des investisseurs peut s'appliquer.

Le fond susmentionné est autorisé à la commercialisation en France.

Copyright © 2023 Credit Suisse et/ou sociétés affiliées. Tous droits réservés.