

Nachhaltige Investitionen bei der Credit Suisse Asset Management MSCI ESG Leaders Methodik

ESG Integration bei Indexportfolios

Aufgrund der Natur ihrer Anlagen bilden passiv verwaltete Portfolios einen ESG-Referenzindex möglichst genau nach. Das bedeutet, dass die ESG-Merkmale des Portfolios sowie sein Ansatz zur Integration von ESG-Faktoren aus dem nachgebildeten ESG-Index abgeleitet werden. Der Investmentmanager bewertet die ESG-Methodik des Index und stellt sicher, dass ein ausgewählter Index die Mindestanforderungen der Credit Suisse Asset Management Sustainable Investing Policy erfüllt. Die Methode des Indexaufbaus legt die ESG-Integrationskomponente fest, die verwendet wird, um die ESG-Merkmale des Referenzindex zu erreichen.

ESG Faktoren

Indexportfolios, die eine nachhaltige Anlagestrategie verfolgen, integrieren ESG-Faktoren in den Anlageentscheidungsprozess, um die Nachhaltigkeit des Portfolios zu steigern, um das erwartete Risiko-Rendite-Profil zu verbessern oder um bestimmte nachhaltige Anlageziele zu erreichen. Die Relevanz individueller ESG-Faktoren ist von der allgemeinen Anlagestrategie und dem Anlageuniversum abhängig.

1. Umwelt (E):

Faktoren: Klimawandel, Umweltchancen, Natürliches Kapital, Luftverschmutzung und Abfall

2. Soziales (S):

Faktoren: Humankapital, Produkthaftung, soziale Chancen

3. Unternehmensführung (G):

Faktoren: Unternehmensführung, Unternehmensverhalten

MSCI ESG Leaders Methodik

Aus dem Anlageuniversum der Standard-Benchmark erfolgt der Ausschluss von Unternehmen für die Konstruktion der MSCI ESG Leaders Indizes nach den folgenden drei Kriterien:

1. Kontroverse Geschäftsfelder

Industrie	Aktivität	Grenzwerte (in % des Umsatzes)
Tabak	Produktion	5 %
	Weitere Einnahmen	15 %
Alkohol	Produktion	10 %
Glücksspiele	Produktion	10 %
Kernenergie	Produktion	10 %
Zivile Schusswaffen	Produktion	5 %
	Verkauf & Distribution	15 %
Konventionelle Kriegswaffen	Produktion	10 %
Kontroverse Kriegswaffen		Null-Toleranz
Thermische Kohlekraft	Stromerzeugung	5 %
	Förderung & Verkauf	5 %
Unkonventionelles Öl und Gas	Förderung	5 %

2. Kontroverse Geschäftspraktiken

10 9 8 7 6 5 4 3	} Geeignet für die Aufnahme in den Index
2 1	
0	} Im Index ausgeschlossen

Quelle: Credit Suisse, MSCI

MSCI analysiert die Unternehmen und prüft inwiefern kontroverse Geschäftspraktiken in Bezug auf Umwelt, Soziales und oder Unternehmensführung vorhanden sind. Anschliessend werden die Unternehmen auf einer Skala von 0-10 eingestuft, mit 0 als sehr kontrovers bis hin zu 10, dem besten Ergebnis.

Das MSCI ESG Rating soll die Widerstandsfähigkeit eines Unternehmens gegenüber langfristigen, branchenrelevanten Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungs-Risiken messen. Die ESG Ratings reichen von führenden Unternehmen (AAA, AA) zu durchschnittlichen (A, BBB, BB) bis hin zu Nachzüglern (B, CCC).

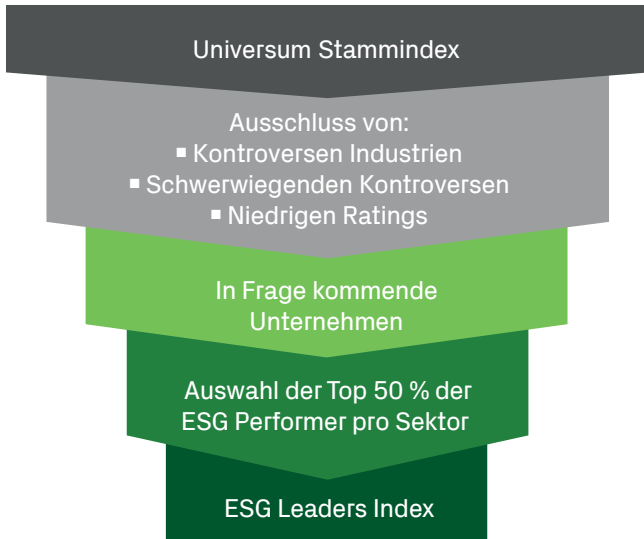
3. MSCI ESG Rating

AAA AA A BBB BB	} Geeignet für die Aufnahme in den Index
B CCC	

} Im Index ausgeschlossen

Kontroverse Geschäftsfelder werden ausgeschlossen, sobald ihr Umsatz gemäss obiger Tabelle den Grenzwert überschreitet. Ausserdem werden kontroverse Geschäftspraktiken sowie das MSCI ESG Rating der Titel gewertet. Anschliessend können die Titel jeweils in den Index aufgenommen werden oder müssen ausgeschlossen werden.

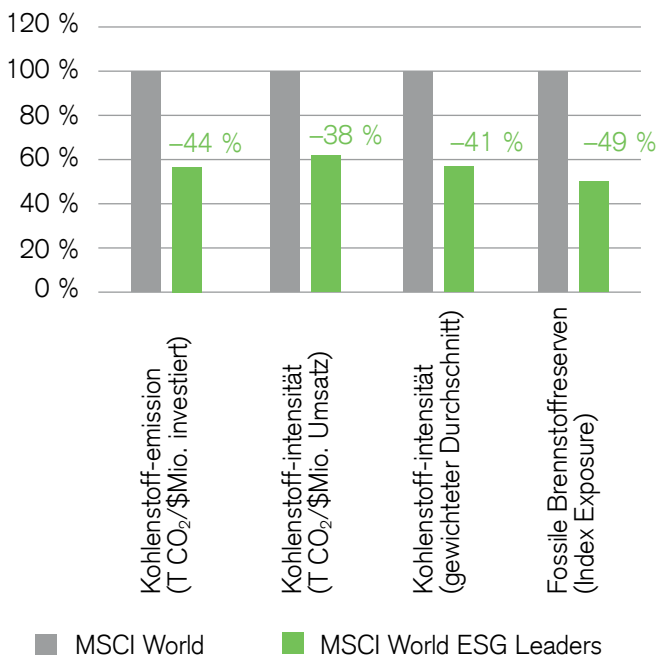
Dabei soll der ESG-Index soll 50 % der Marktkapitalisierung der zugrundeliegenden Standardindizes abdecken und gleichzeitig eine identische Sektorgewichtung als der Index vorweisen. Die nach dem Ausschluss verbleibenden Unternehmen, werden anhand des allgemeinen ESG-Ratings nach dem Best-in-Class-Ansatz rangiert.



Quelle: Credit Suisse, MSCI

MSCI World ESG Leaders: Co₂-Ausstoss-Reduktion im Verhältnis zum Standardindex

Je nach Kategorie reduziert sich der Co₂-Ausstoss im ESG Leaders Index im Vergleich zum Standardindex zwischen 38 % – 49 %.



Quelle: Credit Suisse, MSCI, 31.12.2020

Anwendung von Active Ownership

Credit Suisse Asset Management stellt durch die Einflussnahme und die Stimmrechtsausübung sicher, dass Portfoliounternehmen eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Berichterstattung und Transparenz

Nachhaltigkeitsinformationen auf Produktebene werden monatlich in einem gesonderten ESG-Abschnitt in den monatlichen Fund Factsheets bereitgestellt, die die Nachhaltigkeitskriterien enthalten.

Asset Management
Juli 2021
Dieses Produkt darf nur in oder von der Schweiz aus an qualifizierte Anleger im Sinne des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) in Verbindung mit dem Bundesgesetz über die Finanzdienstleistungen (FDLEG) vertrieben werden.



CSIF (CH) III Equity World ex CH ESG Blue - Pension Fund Plus ZBH

Informationen zum Produkt

Aktien Indexwert: **3'670'282'147**
Gesamthaltvermögen des Fonds in CHF: **1'431'207'258**

NVZ der Anteilsklasse: **1'478.98**

Liefernde Kohlen: **0.63%**

2-Jährige (netto) MTD Rendite: **2.10%** (Bench. 2.09%)

5-Jährige (netto) YTD Rendite: **16.85%** (Bench. 16.61%)

Performance-Übersicht – kumuliert
Seit 01.01.2018

Anlagepolitik

Der Fonds wird entsprechend einer indischer Methode bewirtschaftet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation, einen geringen Tracking Error und eine kostengünstige Verwaltung aus. Anstelle des Fonds sind eine möglichst genaue Replikation des Referenzindex und eine Minimierung der Performance-Abweichungen vom Benchmark. Der MSCI World ex Switzerland ESG Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und bezieht ein Engagement in Unternehmen mit hoher Performance basierend auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien (ESG-Kriterien) im Vergleich zu ihren Branchenmitbewerbern; er umfasst Large- und Mid-Cap-Unternehmen in Industrieländern weltweit (mit Ausnahme der Schweiz).

Portfolio Summary

Dieser Fonds investiert in Unternehmen, die in der Erhebung und Produktion von nuklearen, biologischen und chemischen Kampfstoffen und Waffen, Antipersonenminen und Sprengstoffen gemäss der Ausschüsse des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVK – ASB) involviert sind.

Ausschluss von kontroversen Waffen*

Die Bereiche und Erzeuge, Träler, Träger für die Entwicklung, Herstellung oder dem Erwerb von Kernwaffen, biologischen und chemischen Waffen sowie Antipersonenminen und Sprengstoffen bezieht sind. Wir folgen dem Ausschuss des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVK-ASB). Das Tracking-Quadrat unserer Indizes bleibt durch diese Ausschlüsse weitgehend unverändert.

Angewendete ESG-Merkmale

ESG Benchmark ESG Integration Engagement Ausschusskriterien Stimmrechtsüberwachung

ESG Gewichtete CO₂-Emissionsintensität
Emissionsintensität in CO₂-Äquivalent pro USD Mio. Umsatz

Sektor	Portfolio	Benchmark
Informationstechnologie	22	21
Finanzwerte	5	18
Gesundheitswesen	22	20
Zyklische Konsumgüter	31	35
Industrie	109	110
Kommunikation	12	14
Nichtzyklische Konsumgüter	53	49
Grundstoffe	502	625
Immobilienanlagen	131	124
Energie	416	483
Versehrer	613	1'285

ESG-Übersicht

Kriterium	Portfolio	Benchmark
Overall ESG Rating	AA	A
Overall ESG Score	7.35	6.15
Environment (Emissions)	6.95	6.07
Social (Diversity)	6.31	6.03
Governance	5.55	4.85
Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ₂ / USD Mio. Umsatz)	77.05	131.08
MSCI coverage (in %)	98.35	92.65

Nur für Illustrationszwecke.
Quelle: Credit Suisse, 31.07.2021

Aktien Welt ohne Schweiz

Fonds: CSIF (CH) III Equity World ex CH ESG Blue – Pension Fund Plus ZB

ESG-Rating: AA

Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (NR)

ESG-Rating: AA

Link zum Factsheet Aktien Welt

Fonds: CSIF (CH) III Equity World ex CH ESG Blue – Pension Fund Plus ZBH

ESG-Rating: AA

Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (NR) (hedged)

ESG-Rating: AA

Link zum Factsheet Aktien Welt (hedged)

Schweiz:

Vertreter für Lux Fonds und Verwaltungsgesellschaft (Fondsleitung) für CH Fonds:

Credit Suisse Funds AG¹
Uetlibergstrasse 231
CH-8070 Zürich

Zahlstelle (für Lux Fonds), Depotbank (for CH Fonds) und Vertriebsstelle, falls dieses Dokument vertrieben wird durch:

Credit Suisse (Schweiz) AG
Paradeplatz 8
CH-8001 Zürich

Aufsichtsorgan (Registrierungsstelle)
Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA)

Vertriebsstelle, falls dieses Dokument vertrieben wird durch:

Credit Suisse Asset Management (Switzerland) Ltd.
Kalendergasse 4
CH-8045 Zürich

¹ Rechtseinheit, von der die vollständigen Angebotsunterlagen, die wesentlichen Informationen für den Anleger (Key Investor Information Document, KIID), die Fondsreglemente sowie die Jahres- und Halbjahresberichte der Fonds, soweit einschlägig, kostenlos bezogen werden können.

Dieses Material stellt Marketingmaterial der Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundener Unternehmen (nachfolgend «CS» genannt) dar. Dieses Material stellt weder ein Angebot oder eine Aufforderung zur Emission oder zum Verkauf noch einen Bestandteil eines Angebots oder einer Aufforderung zur Zeichnung oder zum Kauf von Wertpapieren oder anderen Finanzinstrumenten oder zum Abschluss einer anderen Finanztransaktion dar. Ebenso wenig stellt es eine Aufforderung oder Empfehlung zur Partizipation an einem Produkt, einem Angebot oder einer Anlage dar. Dieses Material stellt in keiner Weise einen Anlageresearch oder eine Anlageberatung dar und darf nicht die Grundlage Ihrer Entscheidung darstellen. Es berücksichtigt weder Ihre persönlichen Umstände noch stellt es eine persönliche Empfehlung dar. 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, sofern rechtlich möglich, 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. Die Angaben in diesem Material können sich nach dem Datum der Veröffentlichung dieses Materials ohne Ankündigung ändern, und die CS ist nicht verpflichtet, die Angaben zu aktualisieren. Dieses Material kann Angaben enthalten, die lizenziert und/oder durch geistige Eigentumsrechte der Lizenzinhaber und Schutzrechtsinhaber geschützt sind. Nichts in diesem Material ist dahingehend auszulegen, dass die Lizenzinhaber oder Schutzrechtsinhaber oder gegebenenfalls über FundSearch (am-credit-suisse/fundsearch). Angaben zu Ihren örtlichen Vertriebsstellen, Vertretungen, Informationsstellen, gegebenenfalls Zahlstellen sowie zu Ihren örtlichen Ansprechpartnern für das/die Anlageprodukt(e) sind unten aufgeführt. Die einzigen rechtsverbindlichen Bedingungen der in diesem Material beschriebenen Anlageprodukte, einschliesslich der Risikoerwägungen, Ziele, Gebühren und Auslagen, sind im Verkaufsprospekt, dem Platzierungsprospekt, den Zeichnungsdokumenten, dem Fondsvertrag und/oder anderen für den Fonds massgeblichen Dokumenten festgelegt. Die vollständige Darstellung der Eigenschaften von in diesem Material genannten Produkten sowie die vollständige Darstellung der mit den jeweiligen Produkten verbundenen Chancen, Risiken und Kosten entnehmen Sie bitte den jeweils zugrundeliegenden Wertpapierprospekten, Verkaufsprospekten oder sonstigen weiterführenden Produktunterlagen, welche wir Ihnen auf Nachfrage jederzeit gerne zur Verfügung stellen. Dieses Material darf nicht an Dritte weitergegeben oder verbreitet und vervielfältigt werden. Jegliche Weitergabe, Verbreitung oder Vervielfältigung ist unzulässig und kann einen Verstoß gegen den Securities Act der Vereinigten Staaten von 1933 in seiner jeweiligen Fassung (der «Securities Act») bedeuten. Die hierin genannten Wertpapiere wurden oder werden nach dem Securities Act oder den Wertpapiergesetzen von US-Bundesstaaten nicht registriert, und mit gewissen Ausnahmen dürfen sie weder in den Vereinigten Staaten noch für Rechnung oder zugunsten von US-Personenangeboten, verpfändet, verkauft oder anderweitig übertragen werden. Zudem können im Hinblick auf das Investment Interessenkonflikte bestehen. In Zusammenhang mit der Erbringung von Dienstleistungen bezahlt die Credit Suisse AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen unter Umständen Dritten oder erhält von Dritten als Teil ihres Entgelts oder in anderer Weise eine einmalige oder wiederkehrende Vergütung (z.B. Ausgabeaufschläge, Platzierungsprovisionen oder Vertriebsfolgeprovisionen). Potenzielle Anleger sollten (mit ihren Steuer-, Rechts- und Finanzberatern) selbstständig und sorgfältig die in den verfügbaren Materialien beschriebenen spezifischen Risiken und die geltenden rechtlichen, regulatorischen, kreditspezifischen, steuerlichen und buchhalterischen Konsequenzen prüfen, bevor sie eine Anlageentscheidung treffen. Der Manager des alternativen Investmentfonds bzw. die Verwaltungsgesellschaft kann beschliessen, lokale Vereinbarungen über die Vermarktung der Aktien/Anteile eines Fonds zu kündigen und Registrierungen oder den Versand von Mitteilungen an die lokale Aufsichtsbehörde einzustellen. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte bei Anlagen in Luxemburg ist unter cssf.lu/en/consumer/abrufbar; gegebenenfalls gelten lokale Gesetze über Anlegerrechte. Copyright © 2021 CREDIT SUISSE GROUP AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.