

## Politique de placement

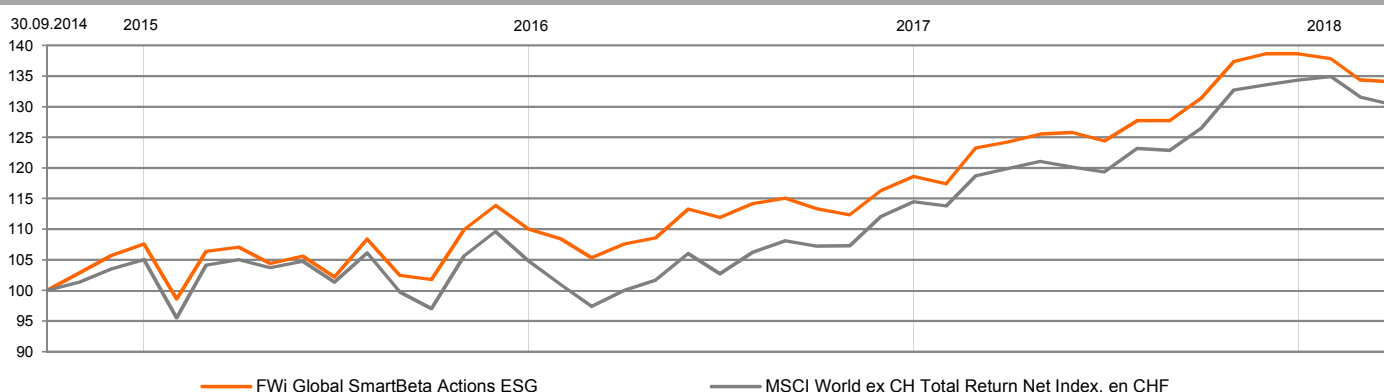
Le FWi Global SmartBeta Actions offre une stratégie d'investissement efficiente, diversifiée et économique qui vise à améliorer le rendement actions pour les investisseurs institutionnels de long terme, en capitalisant sur les inefficiences de marché, et en évitant les limitations des approches indicelles traditionnelles. Le fonds vise à réduire l'impact des marchés baissiers et des bulles spéculatives. Les coûts d'implémentation sont réduits en raison de la faible rotation des titres et grâce au focus permanent sur la réduction des frais et des coûts de transaction.

## Caractéristiques

|                        |   |
|------------------------|---|
| Groupe de placement:   | FWi Global SmartBeta Actions ESG                    |
| Numéro de valeur:      | 24760880  |
| ISIN:                  | CH0247608802  |
| Gestion:               | AXA Rosenberg Investment Management Limited, London |
| Date de lancement:     | 30.09.2014  |
| Univers:*              | MSCI World ex CH Total Return Net Index, en CHF     |
| Clôture de l'exercice: | 31. Décembre  |
| Bloomberg:             | <AWGSAHC>   |
| CAFP:                  | www.cafp.ch   |

\*MSCI World Total Return Net Index, en CHF jusqu'au 31.01.2018

## Performance nette en CHF



## Performance nette en CHF

| Performances cumulées    | 1 mois | 3 mois | YTD    | 1 an   | 3 ans  | 5 ans  | 10 ans | Création |
|--------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|
| Portefeuille             | -0.24% | -3.33% | -3.33% | 7.88%  | 25.21% |        |        | 34.06%   |
| Indice de référence      | -0.95% | -2.99% | -2.99% | 8.67%  | 24.09% |        |        | 30.36%   |
| Performances annualisées |        |        |        | 1 an   | 3 ans  | 5 ans  | 10 ans | Création |
| Portefeuille             |        |        |        | 7.88%  | 7.78%  |        |        | 8.74%    |
| Indice de référence      |        |        |        | 8.67%  | 7.46%  |        |        | 7.87%    |
| Performances annuelles   |        |        |        | 2017   | 2016   | 2015   | 2014   | 2013     |
| Portefeuille             |        |        |        | 16.90% | 7.78%  | 2.31%  | 7.58%  |          |
| Indice de référence      |        |        |        | 17.36% | 9.16%  | -0.14% | 5.04%  |          |

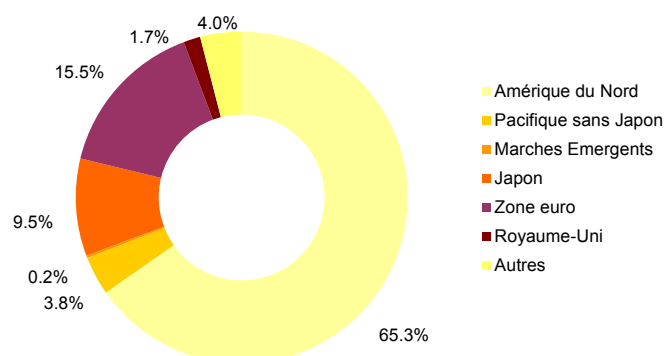
## Analyse du risque

|                          | 1 an   | 3 ans  | 5 ans | 10 ans | Création |
|--------------------------|--------|--------|-------|--------|----------|
| Volatilité annualisée    |        |        |       |        |          |
| Portefeuille             | 6.69%  | 9.96%  |       |        | 11.25%   |
| Indice de référence      | 7.17%  | 11.01% |       |        | 12.37%   |
| Tracking Error           | 1.93%  | 3.15%  |       |        | 3.14%    |
| Tracking Error (ex ante) | 2.37%  |        |       |        |          |
| Ratio d'information      | -0.41  | 0.10   |       |        | 0.28     |
| Ratio de Sharpe          | 1.29   | 0.86   |       |        | 0.84     |
| Coefficient bêta         | 0.90   | 0.87   |       |        | 0.88     |
| Alpha de Jensen          | 0.15%  | 1.41%  |       |        | 1.88%    |
| Perte relative maximale  | -3.33% | -7.48% |       |        | -8.33%   |
| Délai de récupération*   | (0)    | 5      |       |        | 6        |

\*En mois, les chiffres entre parenthèses indiquent la période de récupération non compensée

| Données de référence                      | 31.03.2018 | 31.12.2017 |       |
|---|------------|------------|-------|
| Fortune en mio. de CHF                    | 67.74      | 57.11      |       |
| Nombre de droits                          | 50'529.44  | 41'184.45  |       |
| Valeur nette d'inventaire en CHF          | 1'340.63   | 1'386.75   |       |
| Pas de distribution                       |            |            |       |
| Emission/Rachat quotidienne jusqu'à 12h00 |            |            |       |
| Fortune totale en mio. de CHF             | < 20       | 20-50*     | > 50* |
| TER KGAST 2016 p.a. *(moins rabais):      | 0.31%      | 0.30%      | 0.29% |
| Frais de gestion p.a. *(moins rabais):    | 0.20%      | 0.19%      | 0.18% |

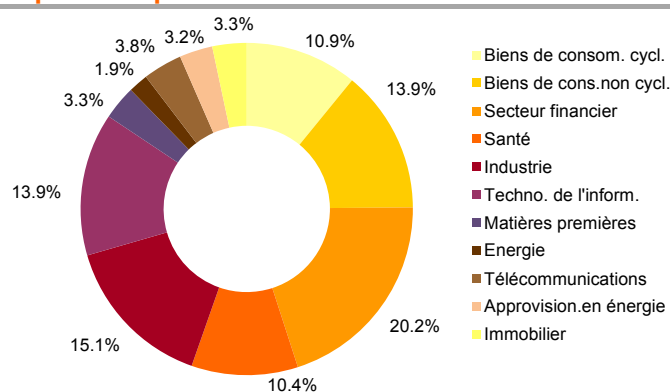
## Répartition par région



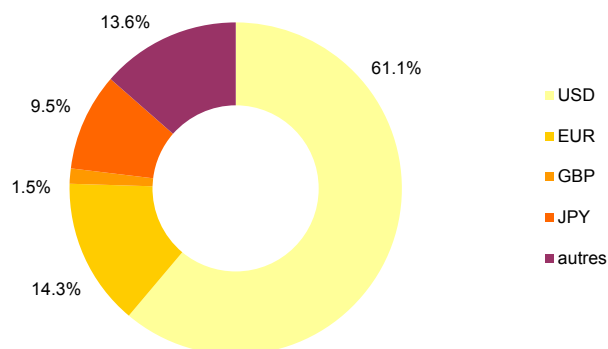
## 10 principales participations

|                     |       |
|---------------------|-------|
| Johnson & Johnson   | 1.25% |
| Procter & Gamble    | 1.24% |
| Visa                | 1.19% |
| Pepsico             | 1.15% |
| United Health Group | 0.99% |
| 3M                  | 0.95% |
| Mastercard          | 0.94% |
| Exxon Mobil         | 0.92% |
| Home Depot Inc      | 0.92% |
| Raytheon            | 0.87% |

## Répartition par secteur



## Répartition par devise



## MSCI clause de non-responsabilité

L'exactitude des données MSCI n'est pas garantie. Les produits ici décrits ne font aucunement l'objet de parrainages, de commentaires, de contrôles ni de transmissions de la part du MSCI. Ni le MSCI ni aucune entreprise lui étant liée n'offre de garantie quant aux données et produits ici évoqués. Toute reproduction ou transmission des données MSCI est formellement interdite.

**Disclaimer:** La présente publication ne constitue pas une recommandation ni une aide à la décision dans le cadre de demandes de conseil d'ordre économique, juridique, fiscal ou autre. Elle n'a pas plus valeur d'offre ou d'incitation concernant l'acquisition ou la vente d'instruments de placement. Les informations contenues dans le présent document se fondent sur l'état des choses et des connaissances au moment de leur élaboration. Elles sont régulièrement contrôlées et mises à jour. Des erreurs indépendantes de notre volonté restent cependant possibles. Toute responsabilité ou garantie de notre part quant à l'actualité, l'exactitude et l'exhaustivité des informations est donc exclue. La performance historique ne représente pas un indicateur de performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.