

Politique de placement

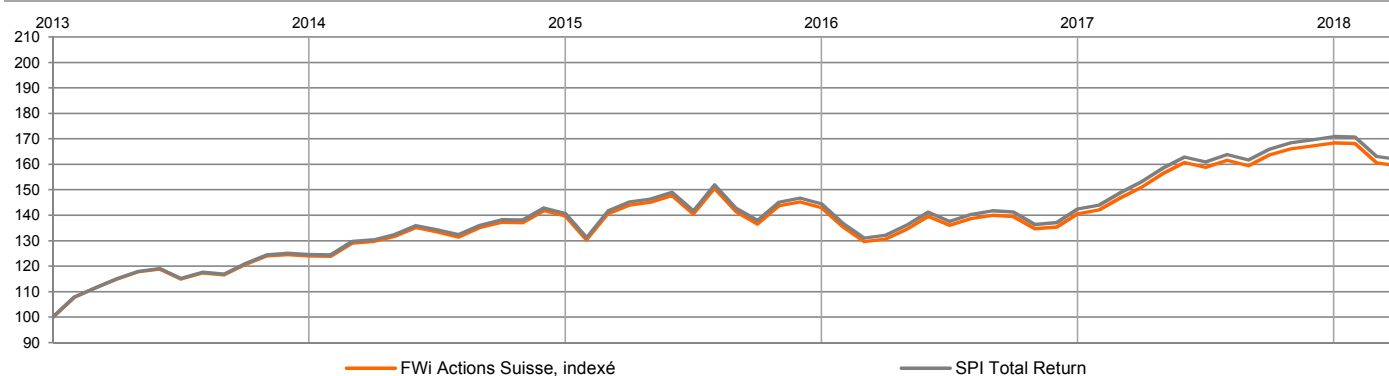
Le groupe de placement se compose exclusivement d'actions et de créances de sociétés suisses. L'indice de référence est le SPI (jusqu'au 07.12.2010 SMI).

L'objectif visé est d'obtenir une croissance de valeur qui corresponde aussi fidèlement que possible à celle de l'indice de référence. Nous utilisons la méthode de la réplique optimisée de l'indice de référence (optimized sampling). Le groupe de placement peut entièrement reproduire sa politique au moyen d'investissements collectifs.

Caractéristiques

Groupe de placement:	FWi Actions Suisse, indexé
Numéro de valeur:	441473
ISIN:	CH0004414733
Administration:	AXA Investment Managers Schweiz AG
Gestion:	Credit Suisse Asset Management
Date de lancement:	02.05.1996
Indice de référence:	SPI Total Return
Clôture de l'exercice:	31. Décembre
Bloomberg:	<AWISCHW>
CAFP:	www.cafp.ch

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	-0.69%	-5.28%	-5.28%	5.56%	10.72%	38.63%	64.81%	276.43%
Indice de référence	-0.67%	-5.22%	-5.22%	5.73%	11.52%	40.67%	70.34%	312.17%
Performances annualisées				1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Création
Portefeuille				5.56%	3.45%	6.75%	5.12%	6.24%
Indice de référence				5.73%	3.70%	7.06%	5.47%	6.68%
Performances annuelles				2017	2016	2015	2014	2013
Portefeuille				19.68%	-1.67%	2.40%	12.60%	24.09%
Indice de référence				19.92%	-1.41%	2.68%	13.00%	24.60%

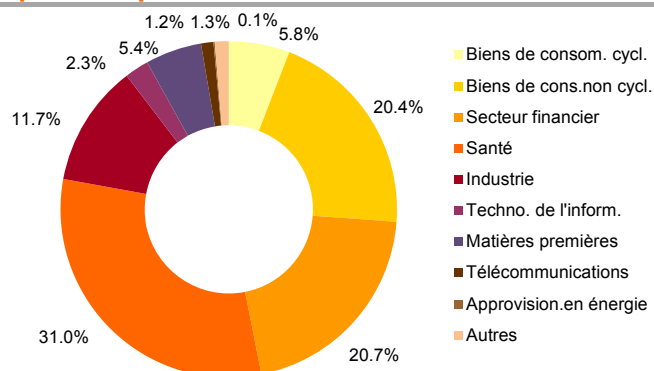
Analyse du risque

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Création
Volatilité annualisée					
Portefeuille	7.71%	10.78%	10.41%	12.67%	15.31%
Indice de référence	7.66%	10.79%	10.44%	12.70%	15.36%
Tracking Error	0.11%	0.07%	0.07%	0.08%	0.15%
Tracking Error (ex ante)	0.09%				
Ratio d'information	-1.54	-3.43	-4.49	-4.32	-2.85
Ratio de Sharpe	0.82	0.39	0.69	0.40	0.35
Coefficient bêta	1.01	1.00	1.00	1.00	1.00
Alpha de Jensen	-0.21%	-0.24%	-0.30%	-0.34%	-0.42%
Perte relative maximale	-5.28%	-13.81%	-13.81%	-36.95%	-49.01%
Délai de récupération*	(0)	13	13	47	34

*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	80.02	89.98	
Nombre de droits	22'760.29	24'241.29	
Valeur nette d'inventaire en CHF	3'515.76	3'711.77	
Pas de distribution			
Emission/Rachat quotidienne jusqu'à 12h00			
Fortune totale en mio. de CHF	< 30	30-100*	> 100*
TER KGAST 2016 p.a. *(moins rabais):	0.28%	0.26%	0.18%
Frais forfaitaires p.a. *(moins rabais):	0.27%	0.25%	0.17%

Répartition par secteur



10 principales participations

Nestle	18.37%
Novartis	14.86%
Roche Holdings	12.02%
UBS	5.05%
Zurich Insurance Group	3.70%
CIE Financiere Richemont	3.49%
ABB	3.23%
CS Group	3.19%
Swiss Reinsurance	2.39%
LafargeHolcim	1.96%

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 non 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.