

Politique de placement

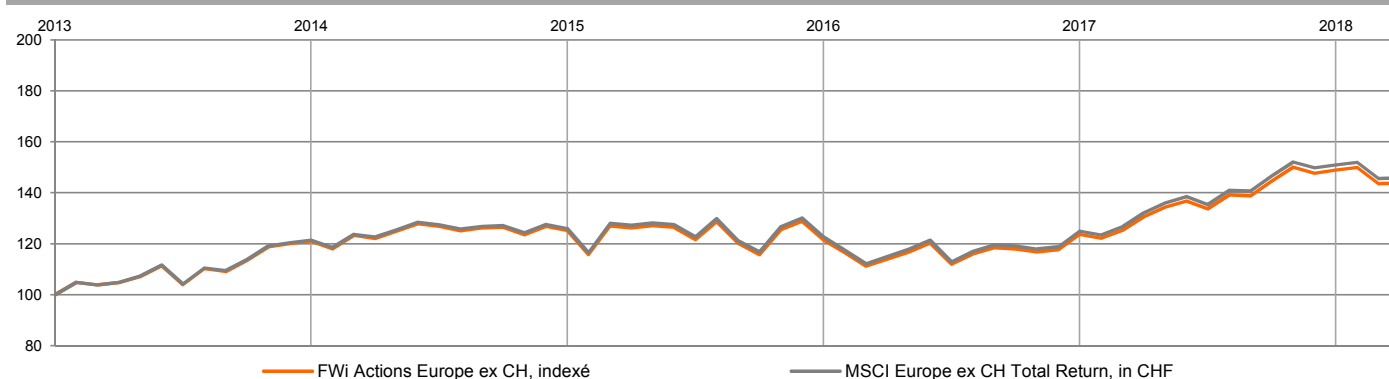
Le groupe de placement se compose exclusivement d'actions et de créances de sociétés d'Europe occidentale hormis les sociétés suisses. L'indice de référence est le MSCI Europe ex CH, réinvesti.

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 parfaite de l'indice de référence. Le groupe de placement peut entièrement reproduire sa politique au moyen d'investissements collectifs.

Caractéristiques

Groupe de placement:	FWi Actions Europe ex CH, indexé
Numéro de valeur:	441474
ISIN:	CH0004414741
Administration:	AXA Investment Managers Schweiz AG
Gestion:	Credit Suisse Asset Management
Date de lancement:	02.05.1996
Indice de référence:	MSCI Europe ex CH Total Return, in CHF
Clôture de l'exercice:	31. Décembre
Bloomberg:	<AWIEURO>
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	0.19%	-3.42%	-3.42%	10.15%	13.97%	37.25%	13.32%	205.57%
Indice de référence	0.23%	-3.35%	-3.35%	10.44%	14.70%	39.09%	14.52%	210.95%
Performances annualisées				1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Création
Portefeuille				10.15%	4.45%	6.54%	1.26%	5.23%
Indice de référence				10.44%	4.68%	6.82%	1.37%	5.31%
Performances annuelles				2017	2016	2015	2014	2013
Portefeuille				20.42%	1.71%	-2.86%	3.42%	21.05%
Indice de référence				20.75%	1.90%	-2.66%	3.78%	21.46%

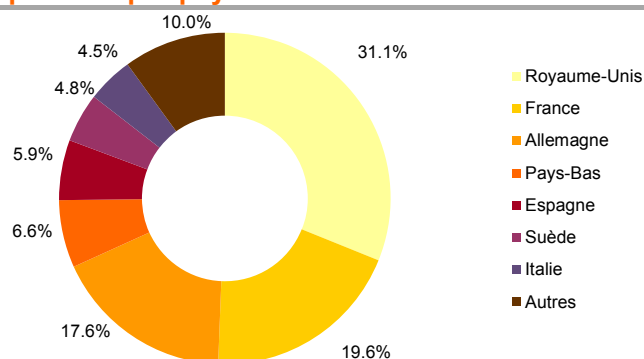
Analyse du risque

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Création
Volatilité annualisée					
Portefeuille	9.24%	12.76%	12.81%	17.66%	18.07%
Indice de référence	9.27%	12.84%	12.87%	17.76%	18.04%
Tracking Error	0.11%	0.11%	0.10%	0.20%	0.85%
Tracking Error (ex ante)	0.60%				
Ratio d'information	-2.61	-2.03	-2.72	-0.53	-0.10
Ratio de Sharpe	1.18	0.41	0.55	0.07	0.24
Coefficient bêta	1.00	0.99	1.00	0.99	1.00
Alpha de Jensen	-0.24%	-0.19%	-0.25%	-0.10%	-0.09%
Perte relative maximale	-4.35%	-13.70%	-13.70%	-51.36%	-60.14%
Délai de récupération*	(1)	13	13	103	(109)

*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	32.71	34.16	
Nombre de droits	12'050.13	12'151.13	
Valeur nette d'inventaire en CHF	2'714.73	2'810.94	
Pas de distribution			
Emission/Rachat quotidienne jusqu'à 12h00			
Fortune totale en mio. de CHF	< 20	20-30*	> 30*
TER KGAST 2016 p.a. *(moins rabais):	0.33%	0.29%	0.27%
Frais forfaitaires p.a. *(moins rabais):	0.32%	0.28%	0.26%

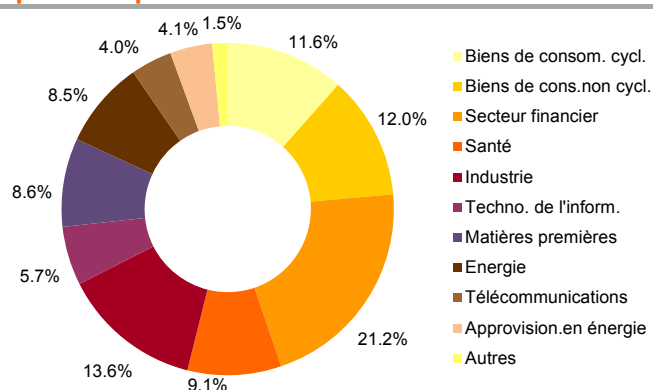
Répartition par pays



10 principales participations

Royal Dutch Shell	3.93%
HSBC Holdings	3.03%
BP	2.20%
Total	2.10%
Sanofi	1.95%
Banco Santander	1.79%
Glaxosmithkline	1.77%
Unilever	1.69%
British American Tobacco	1.66%
Bayer	1.65%

Répartition par secteur



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.