



# EUROPE INDEX (EI)

## Aperçu du fonds

|                       |                                  |
|-----------------------|----------------------------------|
| Banque dépositaire    | Banque Lombard Odier & Cie SA    |
| Année de lancement    | Juin 1996                        |
| Monnaie               | CHF                              |
| Souscription/Rachat   | quotidien jusqu'à 14 h (T)       |
| Clôture de l'exercice | 30 septembre                     |
| Distribution          | aucune, capitalisation           |
| Indice de référence   | MSCI Europe ex CH ndr            |
| Fortune totale        | CHF 134.43 mn                    |
| Portefeuille de base  | CHF 484.54 mn                    |
| Nombre de positions   | 414                              |
| Source                | Bloomberg ISTEUIN<br>istfunds.ch |
| VNI Catégorie I       | CHF 628.56                       |
| VNI Catégorie II      | CHF 636.73                       |
| VNI Catégorie III     | CHF 643.70                       |
| VNI Catégorie G       | CHF 644.84                       |

## Gérant du fonds

|                     |           |
|---------------------|-----------|
| Gérant du fonds     | Pictet AM |
| Gérant du fonds dès | Juin 1996 |
| Signataire UNPRI    | oui       |

## Souscription / Rachat

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| Valeur souscription  | T + 2 jours |
| Valeur remboursement | T + 2 jours |

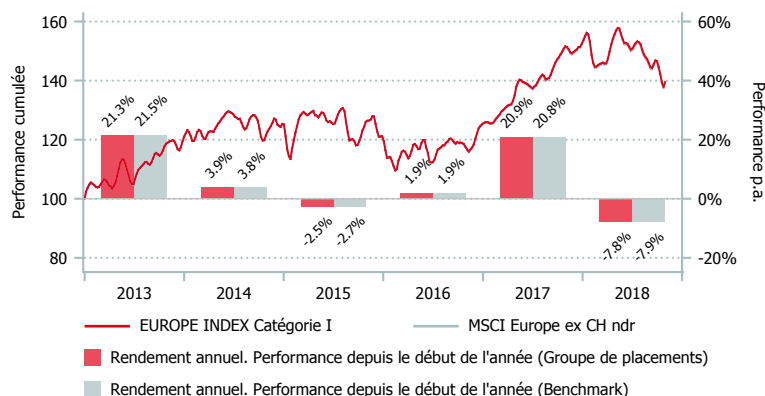
## Chiffres clés

|                        |        |
|------------------------|--------|
| Tracking Error ex-post | 0.11 % |
| Beta                   | 1.00   |

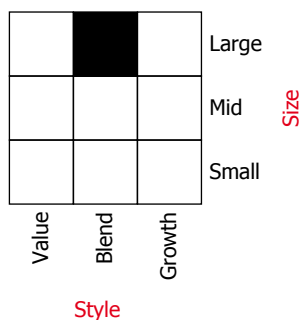
## Politique d'investissement

EUROPE INDEX est un groupe de placements géré passivement et répliquant l'indice MSCI Europe. Les critères ESG de l'association suisse pour des investissements responsables (SVVK-ASIR) sont appliqués depuis le 1er juillet 2018. Le portefeuille ne comprend pas les titres exclus par l'ASIR. L'objectif est de reproduire cet indice avec une marge d'erreur minimale. La marge d'erreur annuelle moyenne ex-ante ne doit pas dépasser 0.15%. EUROPE INDEX est géré selon la méthode de la « réplification quasi parfaite optimisée », selon laquelle toutes les composantes de l'indice sont reproduites le plus fidèlement possible compte tenu des frais de transaction et de la liquidité du marché. Les pondérations sont ajustées en fonction des modifications survenues dans l'univers de l'indice.

## Performance en CHF (en %, nette de frais)



## Morningstar Style-Box™



La Morningstar Style Box™ décrit graphiquement la stratégie d'investissement dominante d'un fonds. Pour de plus amples informations sur la méthodologie, visitez [www.morningstar.com](http://www.morningstar.com)  
Source: Copyright ©2017 Morningstar UK Ltd.

|             | 1 m.  | 3 m.  | 6 m.   | 1 a.  | 3 a.* | 5 a.* | Vol. 3 a. |
|-------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-----------|
| EI cat. I   | -5.46 | -9.44 | -10.60 | -8.53 | 3.22  | 3.21  | 12.19     |
| EI cat. II  | -5.45 | -9.42 | -10.57 | -8.48 | 3.28  | 3.27  | 12.19     |
| EI cat. III | -5.45 | -9.41 | -10.54 | -8.42 | 3.34  | 3.33  | 12.19     |
| EI cat. G   | -5.44 | -9.40 | -10.53 | -8.39 | 3.38  | 3.37  | 12.19     |
| BM          | -5.45 | -9.42 | -10.67 | -8.62 | 3.13  | 3.12  | 12.19     |

\*annualisée

|             | 2012  | 2013  | 2014 | 2015  | 2016 | 2017  | YTD   |
|-------------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|
| EI cat. I   | 16.42 | 21.33 | 3.85 | -2.54 | 1.93 | 20.88 | -7.77 |
| EI cat. II  | 16.57 | 21.46 | 3.93 | -2.48 | 1.99 | 20.95 | -7.73 |
| EI cat. III | 16.67 | 21.58 | 4.00 | -2.42 | 2.05 | 21.02 | -7.68 |
| EI cat. G   | 16.67 | 21.58 | 4.03 | -2.38 | 2.09 | 21.06 | -7.65 |
| BM          | 16.42 | 21.46 | 3.78 | -2.66 | 1.90 | 20.75 | -7.89 |

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

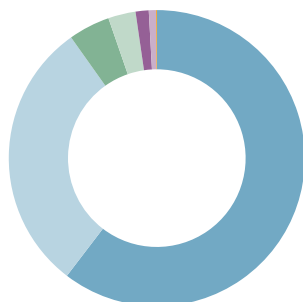
|                          | EI  | BM  |
|--------------------------|-----|-----|
| HSBC Holdings            | 2.3 | 2.3 |
| Royal Dutch Shell A      | 2.0 | 2.0 |
| BP                       | 2.0 | 2.0 |
| Total                    | 1.9 | 2.0 |
| Royal Dutch Shell B      | 1.7 | 1.7 |
| Sap Se                   | 1.4 | 1.5 |
| Sanofi                   | 1.4 | 1.4 |
| British American Tobacco | 1.4 | 1.4 |
| Astrazeneca              | 1.3 | 1.3 |
| Glaxosmithkline          | 1.3 | 1.3 |

Secteurs (en %)

|                          | EI   | BM   |
|--------------------------|------|------|
| Finance                  | 19.5 | 19.2 |
| Industrie                | 13.4 | 13.6 |
| Biens de consom. de base | 12.1 | 12.2 |
| Santé                    | 10.0 | 10.1 |
| Energie                  | 9.9  | 10.1 |
| Consomm. non essentielle | 9.4  | 9.5  |
| Matériaux                | 8.0  | 8.1  |
| Services inform.         | 5.9  | 5.9  |
| Serv. télécom            | 5.5  | 5.5  |
| Services publics         | 4.2  | 4.3  |
| Immobiliers              | 1.4  | 1.4  |
| Autres (liq. comp.)      | 0.8  | 0.0  |

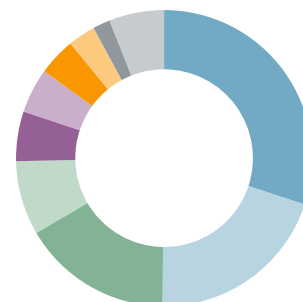
Répartition monétaire (en %)

|     | EI   | BM   |
|-----|------|------|
| EUR | 60.4 | 60.9 |
| GBP | 29.8 | 30.0 |
| SEK | 4.5  | 4.6  |
| DKK | 3.0  | 3.0  |
| NOK | 1.4  | 1.4  |
| CHF | 0.8  | 0.1  |
| USD | 0.1  | 0.0  |



Répartition géographique (en %)

|             | EI   | BM   |
|-------------|------|------|
| Royaume-Uni | 30.1 | 30.3 |
| France      | 20.1 | 20.4 |
| Allemagne   | 16.4 | 16.6 |
| Pays-Bas    | 8.1  | 8.2  |
| Espagne     | 5.4  | 5.5  |
| Suède       | 4.9  | 4.9  |
| Italie      | 4.1  | 4.2  |
| Danemark    | 3.0  | 3.0  |
| Finlande    | 1.9  | 1.9  |
| Divers      | 6.0  | 4.9  |



Points de repère

|  | Catégorie I  | Catégorie II | Catégorie III | Catégorie G  |
|--|--------------|--------------|---------------|--------------|
| Numéro de valeur   | 456.993      | 2.903.099    | 2.903.101     | 2.256.507    |
| ISIN   | CH0004569932 | CH0029030993 | CH0029031017  | CH0022565078 |
| Investissement minimum en CHF                            | < 10 Mio.    | 10 - 50 Mio. | 50 - 100 Mio. | > 100 Mio.   |
| TER KGAST/CAFP <sup>1</sup> en % p.a. au 30.09.18        | 0.23         | 0.17         | 0.12          | 0.08         |
| dont TER fonds cibles <sup>2</sup> en % p.a. au 30.09.18 | 0.08         | 0.08         | 0.08          | 0.08         |
| Frais achat / vente en %                                 | 0.39         | 0.39         | 0.39          | 0.39         |

<sup>1</sup> Le ratio des charges d'exploitation TER KGAST/CAFP comprend l'entier des frais avec pour exceptions les coûts de transactions ainsi que le droit de timbre et les taxes de bourse

<sup>2</sup> Le TER fonds cibles est composé du TER de chaque fonds cible pondéré par son poids, respectivement des fonds institutionnels de IST. Le chiffre indiqué correspond à la valeur du dernier TER calculé. Il est susceptible d'évoluer à la hausse comme à la baisse dans le futur.