

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)

Aperçu du fonds

Banque dépositaire	Banque Lombard Odier & Cie SA
Année de lancement	Janvier 2007
Monnaie	CHF
Souscription/Rachat	quotidien jusqu'à 14 h (T)
Clôture de l'exercice	30 septembre
Distribution	aucune, capitalisation
Indice de référence	SPI
Fortune totale	CHF 95.20 mn
Portefeuille de base	CHF 185.15 mn
Nombre de positions	62
Source	Bloomberg ISTASPL istfunds.ch
VNI Catégorie I	CHF 1'492.41
VNI Catégorie II	CHF 1'494.69
VNI Catégorie III	CHF 1'530.62

Gérant du fonds

Gérant du fonds	Swiss Rock AM
Gérant du fonds dès	Mars 2013

Souscription / Rachat

Valeur souscription	T + 2 jours
Valeur remboursement	T + 2 jours

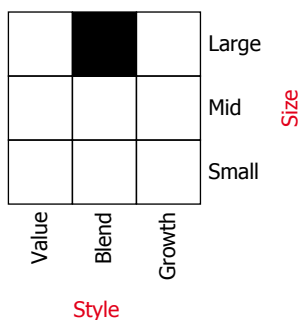
Chiffres clés

Tracking Error ex-post	0.98 %
Beta	0.97

Politique d'investissement

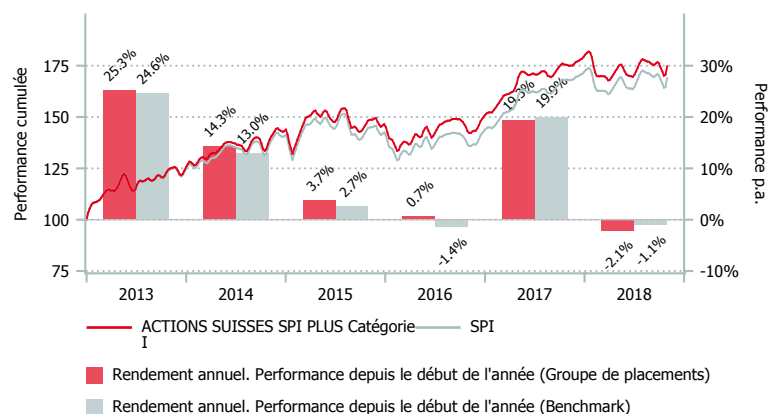
ACTIONS SUISSES SPI PLUS est un groupe de placements géré activement selon une approche quantitative. L'univers de placement se compose des titres du Swiss Performance Index (SPI). Le modèle de sélection des titres utilisé se focalise pour une moitié sur des critères fondamentaux (P/B, P/EBITDA, P/CF) et une autre moitié sur des critères comportementaux (révision des estimations bénéficiaires, price momentum). Le portefeuille comprend typiquement une soixantaine de positions, dont la pondération s'écarte au maximum de 2% de la pondération du titre dans l'indice SPI. La marge d'erreur ex-ante visée est de max. 1.5%. Les droits de vote des actionnaires sont exercés activement sur la base de recommandations effectuées par des spécialistes en gouvernance d'entreprise.

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
Source: Copyright ©2017 Morningstar UK Ltd.

Performance en CHF (en %, nette de frais)



	1 m.	3 m.	6 m.	1 a.	3 a.*	5 a.*	Vol. 3 a.
ASPI cat. I	-1.70	-2.17	0.69	-0.52	5.48	6.95	8.87
ASPI cat. II	-1.69	-2.15	0.73	-0.44	5.53	6.98	8.87
ASPI cat. III	-1.68	-2.14	0.75	-0.40	5.61	7.08	8.87
BM	-1.59	-2.41	1.05	0.29	5.21	6.32	9.12

*annualisée

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	YTD
ASPI cat. I	16.56	25.30	14.29	3.75	0.68	19.35	-2.12
ASPI cat. II	16.78	25.34	14.29	3.75	0.69	19.44	-2.06
ASPI cat. III	16.83	25.45	14.43	3.87	0.80	19.49	-2.02
BM	17.72	24.60	13.00	2.68	-1.41	19.92	-1.08

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

	ASPI	BM
Nestlé (nom)	20.1	20.1
Novartis (nom)	15.7	16.3
Roche (nom)	13.9	13.3
Zurich Insurance Grp (nom)	4.4	3.7
UBS Group (nom)	4.0	4.2
CS Group (nom)	2.3	2.5
Cie Fin. Richemont (nom)	2.2	3.0
ABB Ltd (nom)	2.2	2.9
Partners Group Hldg (nom)	2.0	1.3
Swiss Life Holding (nom)	1.8	1.0

Secteurs (en %)

	ASPI	BM
Santé	34.7	34.5
Biens de consom. de base	22.0	22.1
Finance	18.7	18.4
Industrie	11.6	10.3
Consomm. non essentielle	4.7	4.8
Matériaux	3.2	5.4
Serv. télécom	2.7	1.2
Services publics	1.4	0.1
Services inform.	0.9	1.9
Immobiliers	0.0	1.3

Points de repère

	Catégorie I	Catégorie II	Catégorie III
Numéro de valeur	2.733.872	2.903.078	2.903.079
ISIN	CH0027338729	CH0029030787	CH0029030795
Investissement minimum en CHF	< 10 Mio.	10 - 30 Mio.	> 30 Mio.
TER KGAST/CAFP ¹ en % p.a. au 30.09.2018	0.35	0.27	0.23
dont TER fonds cibles ² en % p.a. au 30.09.2018	0.15	0.15	0.15
Frais achat / vente en %	0.06	0.06	0.06

¹ 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

² 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.