

ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Aperçu du fonds

| | |
|-----------------------|----------------------------------|
| Banque dépositaire | Banque Lombard Odier & Cie SA |
| Année de lancement | Janvier 2012 |
| Monnaie | CHF |
| Souscription/Rachat | quotidien jusqu'à 14 h (T) |
| Clôture de l'exercice | 30 septembre |
| Distribution | aucune, capitalisation |
| Indice de référence 1 | MSCI World ex-CH ndr |
| Indice de référence 2 | S&P Dev. High Income NTR |
| Fortune totale | CHF 43.89 mn |
| Portefeuille de base | CHF 86.00 mn |
| Nombre de positions | 190 |
| Source | Bloomberg ISTAGHD istfunds.ch |
| VNI Catégorie I | CHF 1'745.38 |
| VNI Catégorie II | CHF 1'758.28 |
| VNI Catégorie III | CHF 1'764.90 |

Gérant du fonds

| | |
|---------------------|---------------------------------------|
| Gérant du fonds | Robeco Institutional Asset Management |
| Gérant du fonds dès | Septembre 2015 |
| Signataire UNPRI | oui |

Souscription / Rachat

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

Chiffres clés

| | |
|------------------------|--------|
| Tracking Error ex-post | 4.68 % |
| Beta | 0.75 |
| Rendement de dividende | 3.37 % |

ESG

| | |
|-----------------------------|-----|
| Exercice des droits de vote | Oui |
| Liste d'exclusion | Oui |

Morningstar Style-Box™, 1

| | | | |
|-------|-------|--------|-------|
| | | | Large |
| | | | Mid |
| | | | Small |
| Value | Blend | Growth | Size |
| | | | Style |

Source: Copyright ©2017 Morningstar UK Ltd.

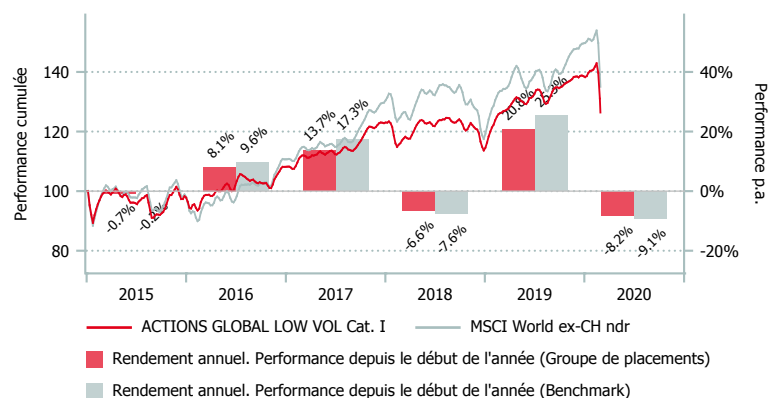
Politique d'investissement

IST ACTIONS GLOBAL LOW VOL est un groupe de placements géré activement investi dans des actions étrangères sur la base d'un processus quantitatif. La stratégie repose sur un modèle de sélection propriétaire mettant l'accent sur la minimisation du risque, le momentum et des rendements au dividende supérieurs à la moyenne. Les placements effectués avec un horizon à moyen et long terme se concentrent sur des sociétés de qualité avantagement valorisées. L'objectif consiste à réaliser, sur un cycle de marché complet, une performance supérieure à celle de l'indice mondial MSCI ex Suisse avec une volatilité plus faible. L'approche active conduit à une marge d'erreur comprise entre 3% et 6%. Le rendement au dividende du portefeuille est supérieur à celui de l'indice alors que le bêta est inférieur à 1.

Les critères ESG de l'association suisse pour des investissements responsables (SVK-ASIR) sont appliqués. Le portefeuille ne comprend pas les titres exclus par l'ASIR.

Depuis janvier 2020, les droits de vote des actionnaires sont exercés activement sur la base de recommandations effectuées par des spécialistes en gouvernance d'entreprise.

Performance en CHF (en %, nette de frais)



| | 1 m. | 3 m. | 6 m. | 1 a. | 3 a.* | 5 a.* | Vol. 3 a. |
|---------------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| AGHD cat. I | -8.61 | -9.43 | -4.81 | 0.39 | 4.42 | 5.07 | 10.11 |
| AGHD cat. II | -8.60 | -9.42 | -4.76 | 0.48 | 4.52 | 5.18 | 10.11 |
| AGHD cat. III | -8.60 | -9.40 | -4.74 | 0.53 | 4.57 | 5.23 | 10.11 |
| BM 1 | -8.14 | -9.33 | -1.30 | 1.48 | 5.97 | 6.38 | 12.67 |
| BM 2 | -9.15 | -12.54 | -4.18 | -6.58 | 0.13 | 2.87 | 12.56 |

*annualisée

| | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | YTD |
|---------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|
| AGHD cat. I | 9.47 | -0.75 | 8.13 | 13.71 | -6.60 | 20.80 | -8.21 |
| AGHD cat. II | 9.58 | -0.65 | 8.24 | 13.83 | -6.50 | 20.92 | -8.20 |
| AGHD cat. III | 9.64 | -0.60 | 8.29 | 13.88 | -6.46 | 20.98 | -8.19 |
| BM 1 | 17.46 | -0.18 | 9.63 | 17.34 | -7.64 | 25.27 | -9.11 |
| BM 2 | 12.12 | -3.27 | 14.82 | 12.07 | -11.49 | 17.98 | -12.86 |

ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

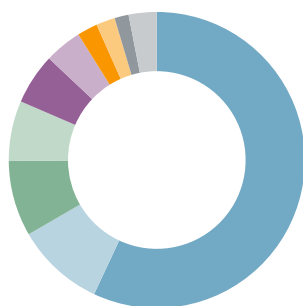
| | AGHD | BM 1 |
|------------------------|------|------|
| JP Morgan Chase | 1.5 | 0.9 |
| Intel Corp | 1.4 | 0.6 |
| Procter & Gamble | 1.3 | 0.7 |
| Home Depot | 1.3 | 0.6 |
| Verizon Communications | 1.1 | 0.6 |
| Coca-Cola Co. | 1.1 | 0.6 |
| Pepsico | 1.1 | 0.5 |
| Mc Donald's | 1.0 | 0.4 |
| Merck & Co | 1.0 | 0.5 |
| AT&T Inc | 1.0 | 0.7 |

Secteurs (en %)

| | AGHD | BM 1 |
|--------------------------|------|------|
| Finance | 20.0 | 15.2 |
| Consomm. non essentielle | 13.6 | 10.6 |
| Services publics | 13.0 | 3.8 |
| Industrie | 9.9 | 10.9 |
| Services inform. | 9.4 | 18.9 |
| Serv. télécom | 8.7 | 8.9 |
| Biens de consom. de base | 8.7 | 7.8 |
| Immobiliers | 7.0 | 3.3 |
| Santé | 6.5 | 12.3 |
| Matériaux | 2.8 | 4.1 |
| Energie | 0.4 | 4.3 |

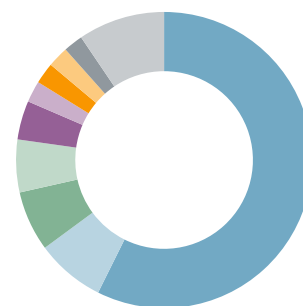
Répartition monétaire (en %)

| | AGHD | BM 1 |
|--------|------|------|
| USD | 57.0 | 65.9 |
| EUR | 9.7 | 11.4 |
| CAD | 8.3 | 3.4 |
| AUD | 6.6 | 2.3 |
| JPY | 5.6 | 8.3 |
| GBP | 4.1 | 5.0 |
| HKD | 2.2 | 1.1 |
| NOK | 2.1 | 0.2 |
| SGD | 1.5 | 0.5 |
| Divers | 3.1 | 1.8 |



Répartition géographique (en %)

| | AGHD | BM 1 |
|-------------|------|------|
| Etats-Unis | 57.4 | 65.8 |
| Canada | 7.5 | 3.5 |
| Australie | 6.6 | 2.3 |
| Japon | 5.8 | 8.3 |
| Royaume-Uni | 4.2 | 5.0 |
| Allemagne | 2.3 | 2.9 |
| Hong Kong | 2.3 | 1.2 |
| Italie | 2.3 | 0.8 |
| Norvège | 2.1 | 0.2 |
| Divers | 9.5 | 9.9 |



Points de repère

| | Cat. I | Cat. II | Cat. III |
|--|--------------|--------------|--------------|
| Numéro de valeur | 14.316.840 | 14.316.842 | 14.316.843 |
| ISIN | CH0143168406 | CH0143168422 | CH0143168430 |
| Investissement minimum en CHF | < 10 Mio. | 10 - 30 Mio. | > 30 Mio. |
| TER KGAST/CAFP ² en % p.a. au 30.09.2019 | 0.67 | 0.57 | 0.52 |
| dont TER fonds cibles ³ en % p.a. au 30.09.2019 | 0.45 | 0.45 | 0.45 |
| ex-ante TER ⁴ en % p.a. au 30.11.2019 | 0.65 | - | - |
| Frais achat / vente en % ⁵ | 0.10 | 0.10 | 0.10 |

¹ 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

² 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

³ 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.

⁴ Le ratio des charges d'exploitation TER ex ante inclut tous les coûts qui seront imputés au groupe de placements dans les 12 prochains mois et à situation inchangée.

⁵ en faveur du groupe de placements

Source de données pour le benchmark: MSCI/S&P