

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 60.16 mn
Portefeuille de base	CHF 162.44 mn
Nombre de positions	68
Source	Bloomberg ISTASPL istfunds.ch
VNI Catégorie I	CHF 2'071.21
VNI Catégorie II	CHF 2'079.36
VNI Catégorie III	CHF 2'132.58

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

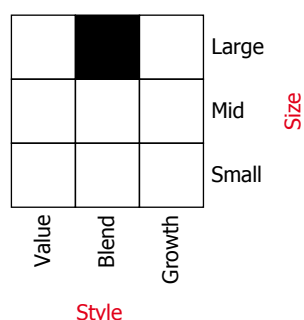
Chiffres clés

Tracking Error ex-post	1.07%
Beta	0.99

ESG

Exercice des droits de vote	Oui
Liste d'exclusion	Oui

Morningstar Style-Box™, 1



Source: Morningstar

Politique d'investissement

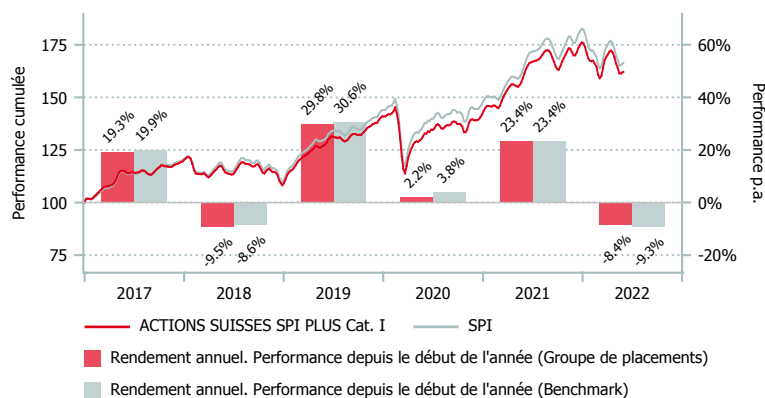
ACTIONS SUISSES SPI PLUS est un groupe de placements géré activement selon une approche quantitative. L'univers de placement se compose des titres du Swiss Performance Index (SPI). Le modèle de sélection des titres utilisé se focalise pour une moitié sur des critères fondamentaux (P/B, P/EBITDA, P/CF) 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 critères ESG de l'association suisse pour des investissements responsables (SVVK-ASIR) sont appliqués. Le portefeuille ne comprend pas les titres exclus par l'ASIR. Les entreprises (sociétés minières ou producteurs d'électricité), qui réalisent plus de 25 % de leurs chiffres d'affaires à partir du charbon thermique, sont également exclues de l'univers d'investissement, selon les classifications de Sustainalytics.

Les droits de vote des actionnaires sont exercés activement sur la base de recommandations effectuées par des spécialistes en gouvernance d'entreprise.

Pour plus d'informations, voir la fiche ESG sous www.istfunds.ch/produits-cours.

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	-4.68	-1.21	-3.46	1.51	8.69	7.15	12.63
ASPI cat. II	-4.68	-1.19	-3.43	1.57	8.76	7.23	12.63
ASPI cat. III	-4.67	-1.18	-3.42	1.61	8.80	7.27	12.63
BM	-4.38	-1.66	-3.95	1.70	8.92	7.80	12.68

*annualisée

	2016	2017	2018	2019	2020	2021	YTD
ASPI cat. I	0.68	19.35	-9.45	29.77	2.19	23.44	-8.35
ASPI cat. II	0.69	19.44	-9.38	29.87	2.25	23.51	-8.33
ASPI cat. III	0.80	19.49	-9.34	29.92	2.30	23.56	-8.32
BM	-1.41	19.92	-8.57	30.59	3.82	23.38	-9.28

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

	ASPI	BM
Nestlé (nom)	19.6	20.3
Roche (bon)	14.8	14.1
Novartis (nom)	13.7	13.0
Zurich Insurance Grp (nom)	4.8	4.1
UBS Group (nom)	4.5	3.7
Cie Fin. Richemont (nom)	4.0	3.4
ABB Ltd (nom)	3.3	2.9
Lonza Group (nom)	1.9	2.7
Swiss Life Holding (nom)	1.8	1.1
Sika Ltd	1.7	2.5

Secteurs (en %)

	ASPI	BM
Santé	34.7	36.1
Biens de consom. de base	21.4	22.4
Finance	16.9	15.5
Industrie	10.9	10.1
Consomm. non essentielle	7.5	4.5
Matériaux	3.6	7.1
Services informatiques	2.5	1.9
Services télécom	1.7	0.9
Services publics	0.0	0.2
Immobiliers	0.0	1.4
Autres (liq. comp.)	0.7	0.0

Points de repère

	Cat. I	Cat. II	Cat. 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 ² en % p.a. au 30.09.2021	0.31	0.25	0.20
dont TER fonds cibles ³ en % p.a. au 30.09.2021	0.15	0.15	0.15
Frais achat / vente en % ⁴	0.06	0.06	0.06

¹ La Morningstar Style Box™ décrit graphiquement la stratégie d'investissement dominante d'un fonds. Informations sur 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 en faveur du groupe de placements

Source de données pour le benchmark: SIX Swiss Exchange