



ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE (ASMV)

Aperçu du fonds

| | |
|-----------------------|-------------------------------|
| Banque dépositaire | Banque Lombard Odier & Cie SA |
| Année de lancement | Octobre 2013 |
| 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 73.31 mn |
| Portefeuille de base | CHF 77.09 mn |
| Nombre de positions | 44 |
| VNI Catégorie II | CHF 2'142.70 |
| VNI Catégorie III | CHF 2'150.03 |

Gérant du fonds

| | |
|---------------------|--------------|
| Gérant du fonds | Unigestion |
| Gérant du fonds dès | Octobre 2013 |
| Signataire UNPRI | oui |

Souscription / Rachat

| | |
|----------------------|-------------|
| Valeur souscription | T + 3 jours |
| Valeur remboursement | T + 3 jours |

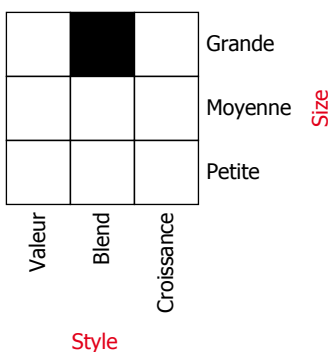
Chiffres clés

| | |
|------------------------|-------|
| Tracking Error ex-post | 3.45% |
| Beta | 0.82 |

ESG

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

Style Box¹



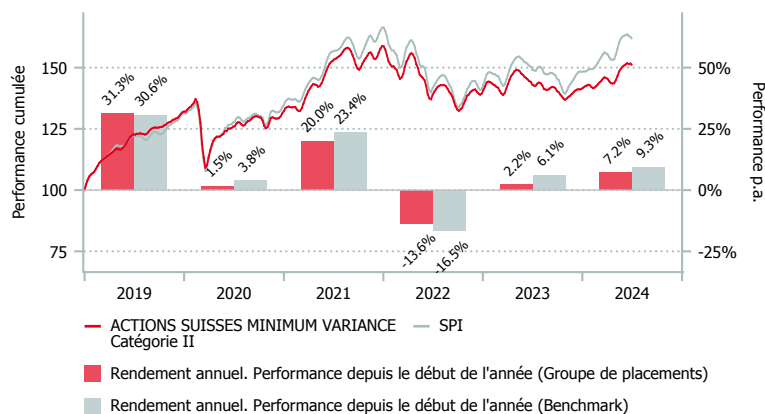
Politique d'investissement

ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE est un groupe de placements géré activement, investi dans des sociétés du Swiss Performance Index (SPI). En sont exclus les titres au profil de risque instable et dont la liquidité est insuffisante. Dans un deuxième temps et sur la base d'un modèle propriétaire quantitatif, un portefeuille est construit avec pour objectif la minimisation du risque absolu. La dernière étape est basée sur la recherche fondamentale et consiste à détecter et éviter les risques cachés. Le portefeuille comprend en règle générale entre 35 et 50 sociétés. La position par entreprise ne doit pas dépasser de plus de 5 points de pourcentage son poids dans le Swiss Performance Index (SPI). L'objectif de placement est de dégager à moyen long terme une performance supérieure à celle de l'indice de référence avec une volatilité réduite.

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. 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.

Depuis janvier 2020, les droits de vote des actionnaires sont activement exercés par le gestionnaire sur la base des recommandations de spécialistes de la 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. |
|---------------|-------|------|------|------|-------|-------|-----------|
| ASMV cat. II | 0.23 | 2.90 | 7.16 | 4.61 | -0.27 | 4.36 | 10.91 |
| ASMV cat. III | 0.23 | 2.91 | 7.18 | 4.65 | -0.23 | 4.41 | 10.91 |
| BM | -0.46 | 3.09 | 9.25 | 7.12 | 1.23 | 5.86 | 12.89 |

*annualisée

| | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | YTD |
|---------------|-------|-------|------|-------|--------|------|------|
| ASMV cat. II | -9.90 | 31.26 | 1.49 | 19.98 | -13.64 | 2.20 | 7.16 |
| ASMV cat. III | -9.86 | 31.32 | 1.54 | 20.03 | -13.60 | 2.24 | 7.18 |
| BM | -8.57 | 30.59 | 3.82 | 23.38 | -16.48 | 6.09 | 9.25 |

ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE (ASMV)

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

| | ASMV | BM |
|----------------------------|------|------|
| Novartis (nom) | 12.2 | 12.5 |
| Nestlé (nom) | 11.2 | 15.2 |
| Roche (bon) | 9.0 | 11.1 |
| Zurich Insurance Grp (nom) | 7.8 | 4.4 |
| Cie Fin. Richemont (nom) | 5.8 | 4.8 |
| Swiss Re AG (nom) | 5.2 | 2.1 |
| Swisscom (nom) | 3.7 | 0.8 |
| UBS Group (nom) | 3.3 | 5.4 |
| Galenica Santé (nom) | 3.2 | 0.2 |
| Swiss Prime Site (nom) | 3.1 | 0.4 |

Secteurs (en %)

| | ASMV | BM |
|--------------------------|------|------|
| Finance | 30.1 | 17.9 |
| Santé | 24.5 | 33.4 |
| Industrie | 12.5 | 12.9 |
| Biens de consom. de base | 11.2 | 17.3 |
| Consomm. non essentielle | 7.5 | 5.6 |
| Immobiliers | 6.4 | 1.2 |
| Services télécom | 3.7 | 0.9 |
| Matériaux | 2.5 | 8.4 |
| Services informatiques | 0.5 | 2.1 |
| Services publics | 0.0 | 0.2 |
| Autres (liq. comp.) | 1.1 | 0.0 |

Points de repère

| | Catégorie II | Catégorie III |
|--|--------------|---------------|
| Numéro de valeur | 34.706.367 | 22.431.333 |
| ISIN | CH0347063676 | CH0224313335 |
| Investissement minimum en CHF | - | > 30 Mio. |
| TER KGAST/CAFP ² en % p.a. au 30.09.2023 | 0.52 | 0.48 |
| dont TER fonds cibles ³ en % p.a. au 01.04.2024 | 0.40 | 0.40 |
| Frais achat / vente en % ⁴ | 0.10 | 0.10 |

¹ La Style Box décrit graphiquement la stratégie d'investissement dominante d'un fonds.

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