

# Actions Emerging Markets Index

Croissance à long terme du capital associée à la diversification des risques

Les actions représentent une partie importante d'une stratégie d'investissement réussie. Grâce à leur capacité à réaliser des gains en capital, elles peuvent contribuer à des rendements du portefeuille attrayant. L'objectif d'un rendement plus élevé s'accompagne cependant nécessairement de risques plus importants.

## Vos avantages en un coup d'œil

- **Module pour une mise en œuvre flexible de la stratégie de placement d'une caisse de pension**
- **Placements largement diversifiés et transparents**
- **Processus indépendant de gestion des investissements remplissant les critères de compliance les plus élevés**
- **Conditions attrayantes**

## Univers de placement

Le groupe de placement Actions Emerging Markets Index investit dans des papiers et des droits de participation qui font partie du MSCI Emerging Markets Index (NR). Avec la réplique de l'indice de référence la performance doit correspondre au plus précisément possible à celle de l'indice de comparaison, avant la déduction des frais.

## Processus de placement

Contrôle des risques

- Réplique de l'indice au moyen d'un <<échantillonnage>>
- Méthodes exclusives d'indexation et de gestion des risques
- Surveillance et vérification indépendantes

Plus-value

- Négocier intelligemment en cas de modification des indices
- Maximisation de la valeur en cas d'opérations sur le capital
- Réduction des frais de transactions

Spécialisation dans les marchés émergents

Les restrictions à l'investissement dans certains pays peuvent être mises en œuvre efficacement au moyen de contrats à terme.

## Manager

UBS SA, Global Asset Management

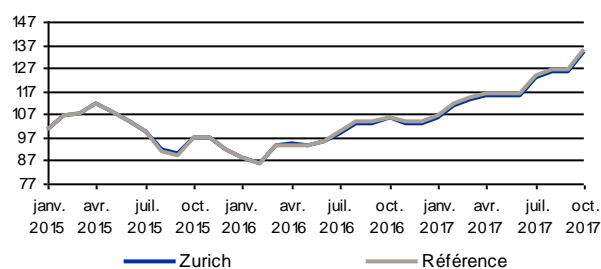
UBS Global Asset Management, une division d'UBS SA, est un des leaders de la gestion de fortune et propose des solutions de placement pour les clients privés, les intermédiaires financiers et les investisseurs institutionnels du monde entier. Avec près de 3'500 collaborateurs dans 25 pays, UBS Global Asset Management mérite particulièrement d'être qualifiée d'entreprise mondiale.

## Actions Emerging Markets Index

Le groupe de placement Actions Emerging Markets Index investit dans des papiers et des droits de participation qui font partie du MSCI Emerging Markets Index (NR). Avec la réplique de l'indice de référence la performance doit correspondre au plus précisément possible à celle de l'indice de comparaison, avant la déduction des frais.

Données au 31.10.2017

### Performance (brute, indexée)



### Caractéristiques

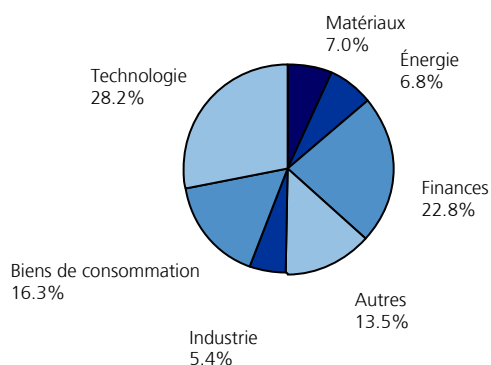
Manager	UBS AG
ISIN	CH0260886277
Bloomberg Ticker	ZURAEMP SW
Référence	MSCI Emerging Markets
Emission	01.2015
Exercice	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Monnaies investies	Autres
Volume (en mio.)	211.11
Valeur d'inventaire	1,389.58
Frais de gestion	0.40%
TER (selon CAF)	0.40%
Spread	0.30%
Achat / vente	Journalier
Positions hors BM	0.02%

Informations supplémentaires sur [www.zurich-fondation.ch](http://www.zurich-fondation.ch)

### Monnaies étrangères (en %)

	Zurich
HKD	21.55
KRW	15.56
TWD	11.73
USD	11.44
Autres	39.72

### Secteurs (en %)



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

	Zurich	Référence
1 mois	6.61	6.63
3 mois	8.77	8.88
Année en cours	29.25	29.71
1 an p.a.	26.89	27.46
5 ans p.a.	-	-
10 ans p.a.	-	-
Depuis le lancement	10.73	11.45

### Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	9.39	9.35
5 ans p.a.	-	-
10 ans p.a.	-	-
Depuis le lancement	13.86	13.84

### Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0.83	0.88
Bêta	1.00	1.00
Tracking Error p.a.	0.64	-
Ratio d'information	-1.13	-
Jensen's Alpha (en %)	-0.73	-
Perte maximale (en %)	30.77	30.39
Période de reprise*	13	13

\*) en mois

### Principales positions (en %)

	Zurich
Samsung Electronics Co Ltd	5.28
Tencent Holdings Ltd	4.86
Alibaba Group Holding Ltd	4.00
Taiwan Semiconductor Manufactu	3.78
Central Huijin Investment Ltd	2.21

## Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis le
Sharpe Ratio	2.94			0.83
Tracking Error p.a.	0.10			0.64
Tracking Error Ex Ante	0.08			-
Ratio d'information	-5.91			-1.13
Jensen's Alpha (en %)	-0.68			-0.73

## Aperçu de rendements (nets en %, en CHF)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jui	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	YTD
2017	2.35	4.65	2.39	1.60	0.03	-0.09	6.72	1.78	0.24	6.61			29.25
2016	-4.02	-2.97	9.07	0.40	-0.14	1.16	4.13	4.10	-0.12	2.19	-1.79	-0.04	11.89
2015		6.09	0.95	4.05	-3.48	-3.49	-4.11	-8.30	-2.13	8.09	0.07	-5.29	-8.49

<sup>1</sup> TER selon CAFP: Les indications correspondent au taux de charges d'exploitation (Total Expense Ratio) de l'exercice terminée et ne donne aucune garantie pour une telle performance dans l'avenir.

<sup>2</sup> Spread: Commissions d'émission et de rachat payées au fonds (protection contre la dilution de la performance)

### Disclaimer

Toutes les informations contenues dans ce document ont été établies avec soin et en toute conscience. Zurich Invest SA et la Zurich fondation de placement ne sont aucunement responsables de leur exactitude ni de leur exhaustivité et ne sauraient être tenues responsables des pertes éventuelles résultant de l'utilisation de ces informations. La performance historique ne constitue pas un indicateur de la performance actuelle ou future. Le document sert uniquement à des fins d'information et à l'utilisation par le destinataire. Il ne représente ni une offre ni une recommandation pour l'acquisition de produits financiers et il ne dispense pas le destinataire de sa propre appréciation ou de l'appréciation de tiers. Les informations ne constituent pas une aide à la décision pour des conseils économiques, juridiques, fiscaux ou autres. Tous les documents constituant les bases légales d'un investissement peuvent être obtenus gratuitement auprès de Zurich Invest SA ou de la Zurich fondation de placement. Toute reproduction et/ou transmission même partielle du présent document requiert l'approbation écrite de Zurich Invest SA.