

Actions Suisse

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

L'univers de placement se compose des actions provenant de Suisse et du Liechtenstein qui sont contenues dans l'indice de référence, le Swiss Performance Index (SPI®). Des connaissances approfondies de l'analyse fondamentale et une mise en œuvre solide du processus de placement constituent les éléments centraux de la méthode de placement.

Processus de placement

Le groupe de placement Actions Suisse est administré par deux sociétés spécialisées, Deutsche Asset Management Suisse SA et Schroder Investment Management Suisse SA. Cette combinaison permet une approche judicieuse, convenant sur mesure à l'environnement actuel de forte volatilité et de taux d'intérêt bas, tout en réduisant la dépendance envers un seul prestataire.

Les deux gérants de fortune emploient un processus à plusieurs étapes, comportant des analyses quantitatives et qualitatives. Le choix des titres se fonde sur une analyse détaillée de chaque émetteur. Lors de la phase ultime de la constitution du portefeuille, il est tenu compte des restrictions liées au client, de l'allocation tactique (entre capitalisations boursières de différentes tailles) et des impératifs de diversification.

Manager

Deutsche Asset Management Suisse SA

Deutsche Asset Management, filiale du groupe Deutsche Bank, compte parmi les principales sociétés d'administration de fortune en Europe servant la clientèle institutionnelle. Sa taille fait également sa force: présence renforcée sur le marché, analyses poussées et indépendance des évaluations.

Schroder Investment Management Suisse SA

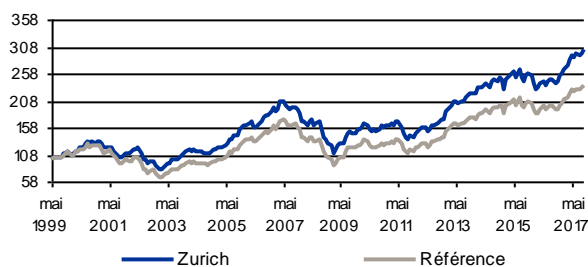
Schroders, qui compte parmi les plus importants gestionnaires de fortune indépendants dans le monde, est bien implantée en Suisse avec sa filiale Schroder Investment Management Suisse SA. Cette société basée à Londres, qui appartient en majorité à la famille qui l'a fondée, propose des solutions d'administration de fortune pour clients privés et institutionnels.

Actions Suisse

Le groupe de placement «Actions Suisse» investit de préférence dans des actions d'entreprises suisses de premier ordre dont le domaine d'activité est aussi bien local qu'international, pouvant bénéficier dans une proportion supérieure à la moyenne des développements actuels du marché.

Données au 31.10.2017

Performance (brute, indexée)



Caractéristiques

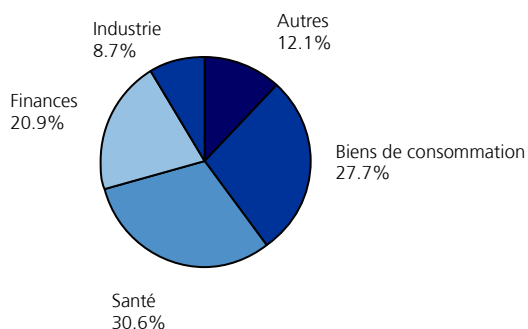
Manager	DEAMS, Schroders
ISIN	CH0007218610
Bloomberg Ticker	ZAKTSWZ SW
Référence	SPI
Emission	05.1999
Exercice	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Monnaies investies	CHF
Volume (en mio.)	849.63
Valeur d'inventaire	2,642.55
Frais de gestion	0.60%
TER (selon CAFI)	0.60%
Spread	0.10%
Achat / vente	Journalier
Nombre de débiteurs	48
Positions hors BM	0.00%

Informations supplémentaires sur www.zurich-fondation.ch

Monnaies étrangères (en %)

	Zurich
CHF	100.00

Secteurs (en %)



Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	1.61	1.50
3 mois	2.46	2.85
Année en cours	18.78	18.28
1 an p.a.	25.15	23.61
5 ans p.a.	11.79	11.74
10 ans p.a.	3.77	3.70
Depuis le lancement	5.54	4.77

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	6.05	6.04
5 ans p.a.	11.00	10.80
10 ans p.a.	13.50	13.27
Depuis le lancement	13.05	13.48

Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0.36	0.29
Bêta	0.95	1.00
Tracking Error p.a.	2.58	-
Ratio d'information	0.30	-
Jensen's Alpha (en %)	0.97	-
Perte maximale (en %)	89.91	97.12
Période de reprise*	56	33

*) en mois

Principales positions (en %)

	Zurich
Nestle SA	17.40
Novartis AG	15.27
Roche Holding AG	11.25
UBS Group AG	4.99
Cie Financiere Richemont SA	4.52

Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis le
Sharpe Ratio	4.28	1.11	0.26	0.36
Bêta	0.97	1.01	1.01	0.95
Tracking Error p.a.	1.41	1.44	1.81	2.58
Tracking Error Ex Ante	1.82	-	-	-
Ratio d'information	1.09	0.04	0.04	0.30
Jensen's Alpha (en %)	2.17	-0.06	0.04	0.97

Aperçu de rendements (nets en %, en CHF)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jui	Août	Sep	Oct	Nov	Déc	YTD
2017	1.60	3.14	2.96	3.92	2.14	-1.18	2.44	-1.52	2.39	1.61			18.78
2016	-5.75	-4.47	0.94	2.76	2.95	-3.28	2.24	1.20	-0.09	-2.38	1.28	4.03	-1.11
2015	-7.46	8.37	3.03	1.07	1.96	-5.08	6.67	-5.65	-3.48	5.35	0.91	-1.69	2.62
2014	-0.30	4.26	0.21	1.03	2.47	-1.30	-1.44	3.36	1.51	-1.11	2.88	-1.47	10.33
2013	8.03	3.33	3.36	2.61	1.15	-3.08	2.49	-0.88	3.60	2.99	1.30	-0.10	27.31
2012	1.98	3.39	2.39	-0.50	-4.75	3.20	3.99	-0.02	2.14	1.90	2.58	0.53	17.85
2011	0.77	2.36	-2.30	3.75	-0.21	-6.15	-7.54	-5.74	-0.91	4.20	-1.78	4.16	-9.87
2010	-0.83	3.51	3.70	-2.37	-4.30	-2.57	1.99	-0.97	2.09	3.09	-2.45	3.12	3.60
2009	-4.78	-11.59	5.83	8.17	2.20	-0.15	10.34	5.05	2.54	-2.72	-0.24	4.53	18.56
2008	-8.67	0.18	-3.36	4.84	0.97	-6.86	2.74	2.13	-7.85	-9.74	-4.26	-3.53	-29.74
2007	4.46	-3.52	2.81	5.86	0.41	-2.41	-3.32	-1.17	0.76	1.59	-3.30	-3.55	-1.96

¹ 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.

² 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.