

Zurich fondation de placement

Actions USA 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 investit dans des papiers et des droits de participation qui font partie du MSCI USA. Avec la réplication 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

- Réplication optimale de l'indice
- Systèmes propriétaires d'indexation et de risques
- Pas de risque de contrepartie par l'achat effectif d'actions et pas de prêt de titres
- Surveillance et vérification indépendante

Plus-value

- Commerce intelligent en cas de modifications des indices
- Maximisation des valeurs en «corporate events»
- Réduction des frais de transactions

Stratified Sampling Methode pour Small Cap Segment (Full Replication pour Large & Midcap)

- Optimisation du portefeuille pour réduire le Tracking Error, en prenant en compte les frais de transaction
- Restrictions des pondérations des valeurs unitaires par rapport à l'indice de référence

Manager

UBS SA, Global Asset Management

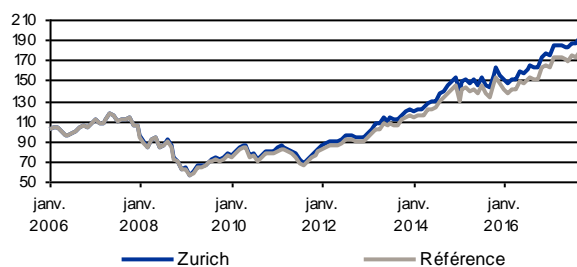
UBS SA, Global Asset Management propose aux particuliers, aux intermédiaires financiers et aux investisseurs institutionnels du monde entier des produits et des prestations de placement. Elle compte parmi les plus grands gestionnaires de fortune institutionnels au monde.

Actions USA Index

Le groupe de placement «Actions USA Index» investit dans des papiers et des droits de participation qui font partie du MSCI USA. 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

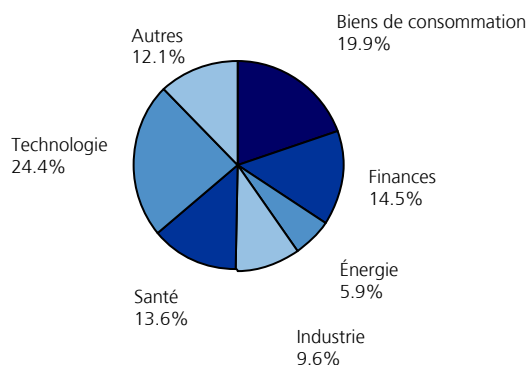
Manager	UBS AG
ISIN	CH0023842013
Bloomberg Ticker	ZAAKTUI SW
Référence	MSCI USA (NDDUUS)
Emission	01.2006
Exercice	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Monnaies investies	USD
Volume (en mio.)	226.20
Valeur d'inventaire	1,933.09
Frais de gestion	0.20%
TER (selon CAFI)	0.21%
Spread	0.05%
Achat / vente	Journalier
Nombre de débiteurs	624
Positions hors BM	0.00%

Informations supplémentaires sur www.zurich-fondation.ch

Monnaies étrangères (en %)

	Zurich
USD	98.99
CHF	1.01

Secteurs (en %)



Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	5.36	5.34
3 mois	8.14	8.03
Année en cours	14.54	14.23
1 an p.a.	24.21	23.76
5 ans p.a.	16.34	15.97
10 ans p.a.	5.60	5.27
Depuis le lancement	5.76	5.48

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	9.56	9.54
5 ans p.a.	11.96	11.96
10 ans p.a.	15.99	16.06
Depuis le lancement	15.27	15.33

Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0.35	0.33
Bêta	1.00	1.00
Tracking Error p.a.	0.16	-
Ratio d'information	1.81	-
Jensen's Alpha (en %)	0.30	-
Perte maximale (en %)	108.95	111.24
Période de reprise*	58	63

*) en mois

Principales positions (en %)

	Zurich
Apple Inc	3.78
Alphabet Inc	2.68
Microsoft Corp	2.62
Amazon.com Inc	1.93
Facebook Inc	1.83

Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis le
Sharpe Ratio	2.61	1.40	0.34	0.35
Bêta	1.00	1.00	1.00	1.00
Tracking Error p.a.	0.08	0.08	0.16	0.16
Tracking Error Ex Ante	0.02	-	-	-
Ratio d'information	5.94	4.95	2.07	1.81
Jensen's Alpha (en %)	0.40	0.36	0.36	0.30

Aperçu de rendements (nets en %, en CHF)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jui	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	YTD
2017	-0.94	5.48	0.05	0.50	-1.50	-0.41	2.78	-0.09	2.73	5.36			14.54
2016	-3.08	-3.01	2.70	0.57	5.60	-1.78	2.96	1.80	-1.26	0.06	6.71	1.62	13.08
2015	-10.06	9.01	0.93	-2.69	2.02	-2.82	4.89	-5.52	-1.66	9.19	4.63	-4.28	1.75
2014	-1.62	1.79	0.94	0.24	3.91	1.28	1.06	4.72	2.66	3.11	2.72	2.78	26.12
2013	4.74	3.80	5.25	0.00	5.46	-2.72	3.34	-2.45	0.15	4.56	2.60	1.02	28.44
2012	2.92	2.25	3.53	-0.22	0.46	1.26	4.39	-0.09	1.15	-2.73	0.10	-0.27	13.27
2011	3.19	2.20	-1.51	-2.19	-2.87	-2.96	-8.23	-3.37	4.50	6.37	4.21	3.69	1.98
2010	-1.60	4.83	3.92	3.97	-1.29	-11.69	3.71	-7.42	5.07	4.59	1.43	-0.26	3.70
2009	0.14	-9.80	5.84	9.58	-1.23	2.15	6.30	1.55	1.92	-3.21	3.82	4.97	22.68
2008	-10.00	-6.72	-5.56	10.43	1.81	-10.44	1.74	6.21	-7.20	-13.67	-3.65	-11.19	-40.86
2007	4.04	-3.95	0.99	3.04	5.06	-1.72	-4.87	1.88	0.34	0.85	-6.70	-0.36	-2.12

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.