FWI Global SmartBeta Actions ESG

factsheet **09|20**

FWI Fondation de placement

Caractéristique

Devise	CHF
ISIN	CH0247608802
Numéro de valeur	24760880
Bloomberg-ID	AWGSAHC
Intervalle d'évaluation	quotidienne
Emission/Rachat	quotidienne jusqu'à 12h
Date de lancement	30.09.2014
Universe	MSCI World ex CH Total Return Net Index, in CHF
Gestion	AXA Rosenberg IM Ltd, London
Banque de dépôt	Bank Julius Bär & Co. AG
Auditeur	PricewaterhouseCoopers AG

Données de référence

NAV (par 30.9.2020)	CHF 1'598.84
Fortune	CHF 39'196'514
Nombre de droits	24'515.57
Distribution	capitalisation

Tarif

TER KGAST 2019	0.26%*

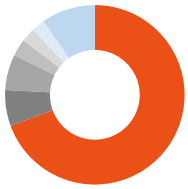
** Frais de base, détails voir dans le règlement tarifaire de la FWI*

10 principaux positions	en %
Microsoft Corp	3.01
Apple Inc	2.95
Amazon.com Inc	1.62
Alphabet Inc	1.52
Facebook Inc	1.18
Procter Gamble Co	1.16
Johnson Johnson	1.06
Adobe Inc	1.02
Visa Inc	1.01
PepsiCo Inc	0.91

Répartition par secteur

- 20.4% Autres
- 18.0% Techno. de l'inform.
- 14.6% Secteur financier
- 14.3% Santé
- 13.4% Industrie
- 11.4% Biens de cons. non cycl.
- 8.1% Autres

Répartition par pays

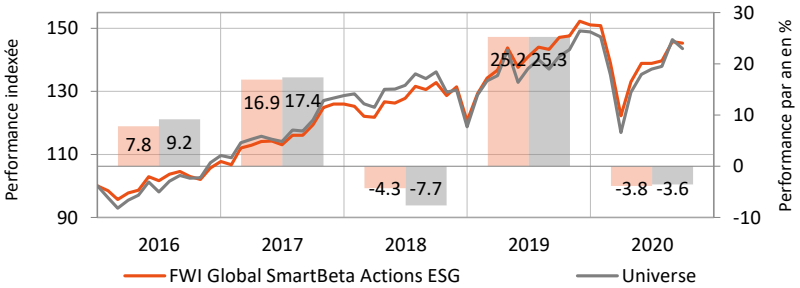


- 69.4% États-Unis d'Amérique
- 6.5% Canada
- 6.4% Japon
- 3.1% Royaume-Uni
- 2.6% France
- 2.4% Allemagne
- 9.7% Autres

Politique de placement

FWI Global SmartBeta Actions est une stratégie qui vise à capter plus efficacement le bêta des actions en évitant les défauts de la réplication indicielle et des indices alternatifs. Le processus de placement se concentre sur des titres de faible volatilité et à croissance bénéficiaire stable au travers d'analyses financières quantitatives à plusieurs volets (filtre systématique). Une large diversification permet d'éviter les concentrations de risques dans les très grandes capitalisations et les petites capitalisations. Il n'y a pas de restrictions en ce qui concerne l'allocation dans des pays ou des secteurs individuels. Par ailleurs, des critères ESG intégrés dans le processus d'investissement dans ce groupe de placement influencent directement la décision de placement.

Performance nette (en CHF)



Performance en %	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.	création p.a.
Portefeuille	-0.34	4.59	-3.85	-1.25	6.76	9.43	8.01
Universe	-1.95	4.74	-3.55	1.70	5.87	9.20	6.88

Nombres statistique en %	Portefeuille	Universe
Volatilité 1 an	18.46	21.38
Volatilité 3 ans	14.14	16.48
Tracking Error 1 Jahr	4.03	
Tracking Error 3 Jahre	3.68	
Value at Risk (niveau de confiance 95%)	8.59	
Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)	-0.07	0.08
Corrélation 1 an	0.99	1.00

Indicateurs ESG	Portefeuille	Universe
CO2 émission (tonnes / Mio. USD chiffre d'affaires)	146.1	212.1
intensité de l'eau (m3 / Mio. USD chiffre d'affaires)	9'661.0	18'432.0
Environmental Score	6.5	6.1
Social Score	5.3	5.0
Governance Score	5.4	5.2
ESG Score	6.7	5.9

Répartition par devise

- 70.5% USD
- 8.8% EUR
- 6.5% CAD
- 6.5% JPY
- 7.7% Autres

Informations générales: la vente de parts du groupe de placement repose sur les documents d'émission déterminants dans leur version en vigueur, en association avec le dernier rapport annuel ou, s'il est disponible, le dernier rapport semestriel du groupe de placement. Clause de non-responsabilité: le présent document a été établi par 1741 Fund Solutions AG (ci-après: «1741»). 1741 n'accorde aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité en cas de perte ou de dommages de quelque nature que ce soit, découlant directement ou indirectement de l'utilisation du présent document ou des informations qu'il contient. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de sa rédaction et peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Sauf mention contraire, l'ensemble des chiffres n'a pas été vérifié. Finalité informative uniquement: le présent document vise uniquement à informer son destinataire et ne constitue ni un conseil en placement, ni une offre ou une recommandation d'acheter des instruments financiers. Il ne dispense pas le destinataire de procéder à sa propre évaluation. Groupe cible: le présent document et les informations qu'il contient s'adressent exclusivement aux caisses de pension suisses. Par conséquent, ni le présent document, ni des copies de celui-ci ne peuvent être envoyés ou emportés aux États-Unis ou remis à des ressortissants américains, conformément à la Regulation S du US Securities Act de 1933. Restriction d'utilisation: ce document s'adresse expressément aux personnes dont la nationalité, le domicile ou d'autres motifs leur permettent d'accéder à de telles informations en vertu des lois en vigueur. En cas de doute, nous vous recommandons de contacter un point de vente ou un établissement bancaire local. Performance: chaque placement comporte des risques et en particulier des risques de fluctuations de la valeur et du rendement. Les placements sont volatils et un investissement peut également entraîner la perte totale des capitaux investis et d'éventuels rendements. De plus, les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais prélevés lors des émissions et/ou rachats. En outre, il est impossible de garantir que la performance de l'indice de référence sera atteinte, voire dépassée. Une évolution positive de la valeur par le passé ou l'indication d'une telle évolution ne saurait garantir l'évolution positive de la valeur à l'avenir. Les investissements dans des devises étrangères peuvent pâtir de fluctuations monétaires. Il existe également un risque que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Distribution en Suisse: en Suisse, ce groupe de placement ne peut être distribué qu'aux caisses de pension.

Fondation de placement Winterthur FWI, Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur, T +41 (0)52 202 02 30, F +41 (0)52 202 02 40, fwi-fondation.ch