

Pictet-Ethos CH - Swiss Sustainable Equities, I dy



Ouvert à tout investisseur (à partir de CHF 1 million)

Factsheet - 31.12.2017

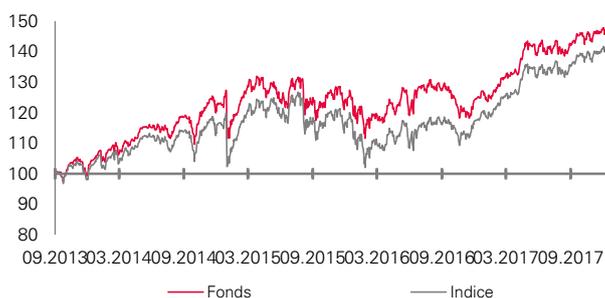
Références

ISIN CH0019087243
 Bloomberg PICSUEI:SW
 N° de valeur 1908724

Ce fonds vise à saisir le potentiel supérieur à long terme des sociétés intégrant des stratégies de durabilité dans leur modèle économique. Pour atteindre cet objectif, il s'appuie sur les ratings environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) élaborés par Ethos. L'évaluation ESG des sociétés est complétée par un filtre qui tient compte de l'empreinte carbone de chaque titre en portefeuille. La gestion financière du fonds est assurée par Pictet Asset Management sur la base d'une approche quantitative. De surcroît, le fonds exerce systématiquement ses droits de vote selon les lignes directrices de vote d'Ethos. Parallèlement, un dialogue continu est engagé sur les questions ESG avec les instances dirigeantes des sociétés comprises dans le fonds.

Performance et positionnement du compartiment

Performance



La performance historique réalisée ne constitue pas un indicateur des résultats actuels ou futurs.

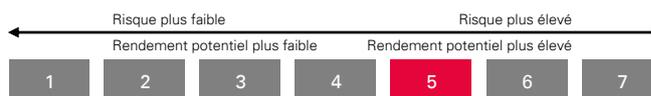
Top 10 positions

	Fonds	Indice	Différence
Nestlé N	23.8%	19.3%	4.5%
Novartis N	19.7%	15.0%	4.7%
Roche PS	15.8%	12.8%	3.0%
UBS GROUP N	5.6%	5.1%	0.5%
ABB N	4.7%	3.5%	1.2%
Zurich Insurance N	4.6%	3.3%	1.3%
Richemont N	4.3%	3.4%	0.9%
Swiss Re N	2.7%	2.2%	0.5%
SGS N	2.0%	1.0%	1.0%
Schindler PS	1.9%	0.7%	1.3%

Caractéristiques générales

Indice de référence	SPI - Total Return
Encours du fonds	CHF 116'612'985
Valeur nette d'inventaire (VNI)	CHF 165.27
Calcul de la VNI	Quotidien, "forward pricing"
Investissement minimum initial	-
Spread (en faveur du fonds)	Maximum 0.05%
Délai de souscription / rachat	12h00
Date valeur	Jour de souscription + 2 jours ouvrables
Date de création	16 septembre 2013
Dividende	Distribution annuelle
Dernière distribution (29 mars 2017)	CHF 2.90
Banque dépositaire	Banque Pictet & Cie SA
Gestionnaire	Pictet Asset Management SA
ESG & Carbon Ratings	Ethos Services SA
Exercice des droits de vote	Ethos Services SA
Pays d'enregistrement	Suisse
Statut juridique	Fonds de placement suisse - Art. 25, 70 LPCC
Monnaie de référence	CHF
Clôture de l'exercice	31 décembre

Niveau de risque



Points clés

- Compartiment en actions suisses géré activement
- Evaluations extra-financières suivant une méthodologie "best-in-class" effectuées par Ethos (Ethos ESG Rating & Ethos Carbon Rating)
- Analyse financière quantitative et gestion active effectuées par Pictet Asset Management
- Exercice systématique des droits de vote selon les lignes directrices de vote d'Ethos
- Dialogue actionnarial (engagement) avec les instances dirigeantes des sociétés comprises dans le fonds

	Fonds Cumulée	Indice Cumulée	Fonds Annualisé	Indice Annualisé
1 mois	0.05%	0.72%	-	-
3 mois	1.98%	2.91%	-	-
YTD	17.52%	19.92%	-	-
3 ans	19.67%	21.39%	6.17%	6.67%
5 ans	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Lancement (16.09.2013)	46.72%	40.95%	9.34%	8.32%

	Par année civile	
2016	-1.30%	-1.41%
2015	3.18%	2.68%
2014	17.44%	13.00%

Répartition par secteur

	Fonds	Indice	Différence
Santé	35.9%	31.6%	4.3%
Biens de consommation	28.0%	26.0%	2.1%
Finance	15.7%	20.8%	-5.1%
Industrie	15.4%	15.6%	-0.3%
Matériaux de base	2.5%	2.2%	0.4%
Télécommunications	0.9%	1.2%	-0.3%
Technologie	0.3%	1.7%	-1.4%
Services aux consommateurs	0.0%	0.8%	-0.8%
Services aux collectivités	0.0%	0.1%	-0.1%
Pétrole et gaz	0.0%	0.0%	0.0%
Liquidités	1.2%	0.0%	1.2%
Total	100.0%	100.0%	

Informations techniques

Nombre de positions	32
Tracking error ex ante	1.97%
Tracking error*	3.28%
Volatilité du fonds*	10.88%
Volatilité de l'indice*	12.13%
Sharpe ratio*	0.581
Jensen alpha*	0.62%
Beta ex post*	0.865
Information ratio*	-0.083

Frais de gestion

Total Expense Ratio (TER)	0.63% (31.12.2017)
* Rabais à partir d'un investissement de CHF 10 millions	
Management fees	0.450%
Administration & Custody fees	0.150%
Frais totaux	0.600%

* Statistiques historiques du risque calculées sur 3 ans annualisés (au 30.11.2017)

