

Swisscanto (CH) Index Commodity Fund FAH1 CHF

Autres | de distribution | Octobre 2024 - Communication à caractère promotionnel

Description du fonds

L'objectif du fonds de placement à reproduire des rendements et risques par rapport à l'indice de référence.

Les fluctuations de change entre les devises de cette catégorie de parts de fonds et celles des placements de ce fonds sont couvertes (couverture des devises des investissements)*.

Profil/Adéquation

Ce produit convient aux investisseurs qui

- disposent au moins d'un horizon de placement à moyen terme.
- participer à l'évolution du marché des matières premières et bénéficier des opportunités de rendement de l'indice de référence sous-jacent. Un rendement excédentaire par rapport à l'indice de référence ne peut être escompté.

Indicateur de risque

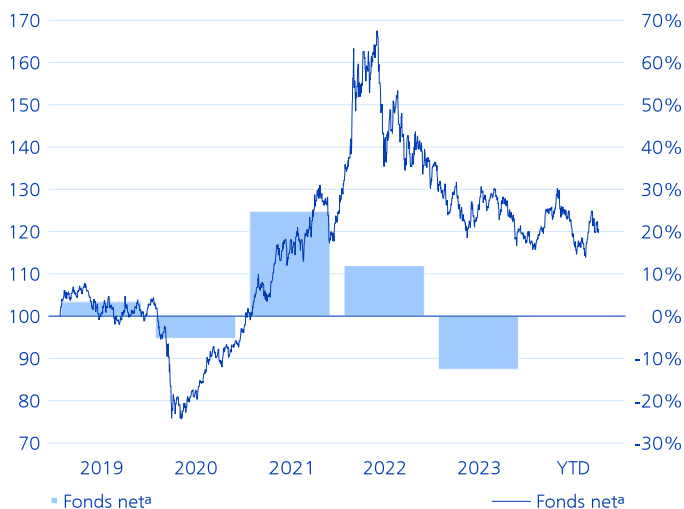
bas 1 2 3 4 5 6 7 haut

Données relatives au fonds

| | |
|--|---|
| NAV par part (31.10.2024) | CHF 95.63 |
| VNI max. sur 52 sem. (21.05.2024) | CHF 104.13 |
| VNI min. sur 52 sem. (10.09.2024) | CHF 91.06 |
| Domicile du fonds | Suisse |
| Monnaie de référence classe | CHF |
| Monnaie du fonds | CHF |
| Clôture exercice annuel | 28.02. |
| N° de valeur | 31562189 |
| ISIN-No | CH0315621893 |
| Bloomberg | SWCCOMF SW |
| Date de lanc. de la cat. de parts | 07.04.2016 |
| Date de lancement du fonds | 22.08.2011 |
| Première mesure de la performance | 01.05.2016 |
| Taille de la classe (en Mio) | CHF 20.16 |
| Actif net du fonds (en Mio) | CHF 202.93 |
| Parts en circulation | 210'815.302 |
| Méthode de placement | Réplication complète |
| Prêt de titres | Oui |
| Dernière distribution (21.06.2023) | CHF 3.85 |
| Benchmark | Bloomberg Commodity Index TR CHF Hedged in CHF |
| Comm. forfait. de gest. (fl. fee) p.a. | 0.40% |
| Total Expense Ratio p.a. | 0.40% |
| Frais d'émission en faveur du fonds | 0.07% |
| Frais de rachat en faveur du fonds | 0.07% |
| Société de gestion | Swisscanto Fondsleitung AG, Zurich |
| Gestion de portefeuille | Zürcher Kantonalbank |
| Banque dépositaire | Zürcher Kantonalbank |

Performance

Performance indexée et performance en %¹



Evolution de valeur indexée (échelle de gauche). Evolution de valeur en pourcentage par an (échelle de droite).

Performance en %²

| Depuis | 1m | 3m | 1a | 3a p.a. | 5a p.a. | Début p.a. |
|-------------------------|-------|------|-------|---------|---------|------------|
| Fonds net ^a | -2.33 | 1.70 | -5.49 | -2.22 | 3.27 | 0.14 |
| Fonds brut ^b | -2.30 | 1.81 | -5.11 | -1.83 | 3.69 | 0.60 |
| Benchmark | -2.28 | 1.79 | -4.90 | -1.32 | 3.98 | 0.83 |

Performance annuelle en %^{1,2}

| Année | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | YTD |
|-------------------------|------|-------|-------|-------|--------|-------|
| Fonds net ^a | 3.38 | -5.27 | 24.82 | 11.96 | -12.57 | -0.03 |
| Fonds brut ^b | 3.92 | -4.89 | 25.32 | 12.41 | -12.23 | 0.30 |
| Benchmark | 3.97 | -5.16 | 25.41 | 13.56 | -11.89 | 0.48 |

Montant de la distribution en monnaie de référence et en %^{1,2}

| Année | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | YTD |
|-------------------|------|------|------|------|------|------|
| Distribution | 3.60 | 1.40 | n.a. | 2.00 | 3.85 | n.a. |
| Distribution en % | 4.10 | 1.88 | n.a. | 1.74 | 3.20 | n.a. |

Montants absolus dans la monnaie de référence du fonds et en pourcentage.

Chiffres relatifs au risque

| annualisés/réalisés | 1a | 3a | 5a |
|----------------------|-------|--------|--------|
| Tracking error | 0.10% | 0.16% | 0.19% |
| Volatilité fonds | 9.44% | 15.58% | 16.28% |
| Volatilité benchmark | 9.40% | 15.57% | 16.31% |
| Sharpe Ratio | -0.76 | -0.19 | 0.19 |

Données de portefeuille

| | Fonds | BM |
|---------------------|-------|----|
| Nombre de positions | 24 | 24 |

¹ Année/période: Depuis la première mesure de la performance ou sur les cinq dernières années/périodes au plus.

² Les petits écarts peuvent apparaître en raison des arrondis.

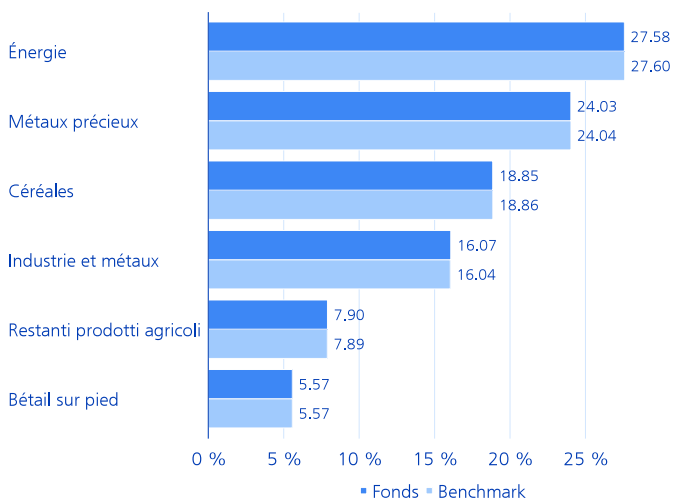
^a L'accroissement de valeur net indiqué s'entend après déduction de toutes les commissions de fonds régulières. Tous les coûts éventuels qui en découlent, et qui peuvent être directement prélevés sur la fortune du fonds, sont publiés dans le prospectus de vente du fonds.

^b L'accroissement de valeur brut indiqué représente l'évolution avant déduction de toutes les commissions de fonds régulières.

*Il peut se produire un effet d'over ou d'under hedge.

Breakdowns

Allocation par secteur en %



Positions principales en %

| | Fonds | BM |
|--------------------------------|-------|-------|
| Gold (NYM \$/ozt) | 18.08 | 18.11 |
| Natural Gas (NYM \$/btu) | 8.50 | 8.51 |
| Brent Crude (ICE \$/bbl) | 6.65 | 6.64 |
| Crude Oil (NYM \$/bbl) | 6.46 | 6.45 |
| Silver (NYM \$/ozt) | 5.95 | 5.93 |
| High Grade Copper (NYM \$/lbs) | 5.70 | 5.69 |
| Corn (CBT \$/bu) | 4.75 | 4.75 |
| LME Pri Alum Future | 4.46 | 4.46 |
| Soybeans (CBT \$/bu) | 4.39 | 4.40 |
| Coffee (NYF \$/lbs) | 3.78 | 3.77 |

Commentaire sur le fonds

Investisseurs visés - Désignation

Tous les investisseurs

Investisseurs visés - Description

La tranche F est proposée à tous les investisseurs. La deuxième lettre «A» précise que la tranche distribue ses dividendes. La désignation «H1» en troisième position précise que la tranche prévoit une couverture de change (hedging) (uniquement indiquée pour les tranches couvertes). Une commission forfaitaire de gestion est débitée.

Commission forfaitaire de gestion (CFG)

La CFG sert à rémunérer l'administration et la direction du fonds, l'Asset Management et, quand elle est rémunérée, la distribution du fonds ainsi que la banque dépositaire pour les services fournis.

Total Expense Ratio (TER)

Le TER représente les commissions imputées en continu à la fortune du fonds (charges d'exploitation) et s'exprime sous forme d'un pourcentage de la fortune du fonds. Le montant indiqué correspond au TER du dernier exercice écoulé et ne garantit pas un montant semblable à l'avenir.

Frais d'émission et de rachat en faveur du fonds ("crossing")

La factsheet mentionne les frais actuellement en vigueur et les frais maximum encourus. La direction du fonds crédite intégralement les frais d'émission et de rachat aux compartiments correspondants afin de protéger les investisseurs existants ou de couvrir les frais de transaction. Les frais d'émission et de rachat en faveur du fonds sont réduits dans la mesure où les émissions et les rachats peuvent être compensés entre eux lors d'un jour ouvrable bancaire (ou « crossing »). Cela permet éventuellement de réduire les frais. Voir le contrat de fonds pour de plus amples informations.

Swinging Single Pricing (SSP) Indirect

D'après les données de base sur les fonds, ce fonds n'affiche aucun Swinging Single Pricing (SSP). Il n'est cependant pas exclu qu'un investissement dans un fonds cible avec SSP indirect puisse être effectué.

Explication des risques généraux

Les placements comportent des risques, notamment de fluctuation de valeur et de rendement. Les placements en monnaies étrangères sont soumis aux fluctuations de change. Les risques de contrepartie et de contrepartie représentent également des risques importants. Nous vous renvoyons à la description détaillée des différents risques mentionnés dans le prospectus de vente.

Indicateur de risque

Les données historiques utilisées pour calculer la catégorie de risque et de rendement ne sont pas suffisamment fiables pour permettre de déduire le profil de risque futur. La catégorie de risque et de rendement indiquée peut très bien être soumise à des modifications. La catégorie de risque la plus faible ne peut être assimilée à un placement sans risque. Il n'y a ni garantie sur le capital ni protection du capital. Le risque de perte de capital est supporté par l'investisseur.

Hedging

NAV-Hedging: Les fluctuations de change entre les devises de cette catégorie de parts de fonds et celle de référence du fonds sont couvertes. L'objectif de la NAV Hedging est de transférer la performance de la devise du fonds dans la performance de la devise de la classe concernée. En raison des fluctuations de marché ou des considérations de coûts, il peut se produire un effet d'over ou d'under hedge.

Couverture des devises des investissements: Les fluctuations de change entre les devises de cette catégorie de parts de fonds et celles des placements de ce fonds sont couvertes. L'objectif du hedging de devise du portefeuille est de couvrir les devises d'investissement du fonds contre la devise de cette classe. En raison des fluctuations de marché ou des considérations de coûts, il peut se produire un effet d'over ou d'under hedge.

Allocations du portefeuille

Toutes les allocations se réfèrent aux capitaux investis du fonds ajustés à 100%. Les petits écarts des différences peuvent apparaître en raison des arrondis. La pondération du marché monétaire peut comprendre l'exposition synthétique de la stratégie de couverture des actions.

Tracking error

L'erreur de suivi décrit la volatilité des différences de rendement entre un fonds et son indice de référence. L'erreur de suivi est une mesure du risque actif du Portfolio Manager. Un fonds géré passivement affiche une erreur de suivi faible.

Volatilité

La volatilité est une mesure statistique du risque qui indique à quel point les rendements absolus d'un placement ou d'un portefeuille fluctuent en moyenne par an autour de leur valeur moyenne.

Sharpe Ratio

Le ratio de Sharpe est une mesure de la performance qui indique le rendement excédentaire corrigé du risque (différence entre le rendement du portefeuille et le rendement sans risque) par rapport au risque de placement encouru (volatilité).

Certification ISO

L'Asset Management de la Zürcher Kantonalbank possède la certification ISO 9001. La marque de garantie ISO 9001 certifie que les ayants droit possèdent un système de gestion remplissant les exigences d'un modèle normatif reconnu et certifié/évalué avec succès par l'Association Suisse pour Systèmes de qualité et de Management (SQS).

Rapports

- L'établissement du présent rapport se fonde sur les données de MSCI Inc. (www.msci.com).
- La répartition en fonction des secteurs et de la solvabilité est catégorisée en fonction du fournisseur d'indices.
- Copyright 2024 MSCI Inc. Tous droits réservés.

Mentions juridiques

Le présent document est destiné à des fins informatives et publicitaires. Il est destiné à la distribution en Suisse et ne s'adresse pas aux investisseurs d'autres pays. Il ne constitue pas une offre ou une recommandation d'achat, de détention ou de vente d'instruments financiers ou de fourniture de prestations, et ne constitue pas non plus la base d'un contrat ou d'une obligation de quelque nature que ce soit.

Le présent document n'est pas un prospectus ni une feuille d'information de base. Les produits et services décrits dans le présent document ne sont pas disponibles pour les US Persons conformément aux réglementations applicables. Le présent document contient des informations générales et ne tient pas compte des objectifs de placement personnels, de la situation financière ou des besoins particuliers d'une personne précise. Il convient de vérifier soigneusement la compatibilité des informations avec la situation personnelle avant de prendre une décision d'investissement. Pour l'évaluation des conséquences juridiques, réglementaires, fiscales et autres, il est recommandé de se faire conseiller par des spécialistes.

Le document a été établi par la Zürcher Kantonalbank avec la diligence d'usage en affaires et peut contenir des informations provenant de sources tierces soigneusement sélectionnées. La Zürcher Kantonalbank ne garantit ni l'exactitude ni l'exhaustivité des informations contenues dans ce document et décline toute responsabilité pour les dommages résultant de l'utilisation du document ou des informations qu'il contient.

Il est précisé que les éventuelles informations relatives à la performance historique ne constituent pas un indicateur de la performance actuelle ou future, et que les éventuelles données de performance indiquées lors de l'émission ou du rachat de parts de fonds peuvent ne pas tenir compte des commissions et frais prélevés.

Les seules sources d'information faisant foi pour l'acquisition de parts de fonds sont les documents actuels sur les fonds (p. ex. contrats de fonds, prospectus de vente, feuilles d'informations de base ainsi que rapports de gestion), qui peuvent être obtenus auprès de Swisssanto Direction de Fonds SA, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich. Ce document n'a pas été élaboré par le département «Analyse financière» au sens des «Directives visant à garantir l'indépendance de l'analyse financière» publiées par l'Association suisse des banquiers et, en conséquence, n'est pas soumis à ces directives.

© 2024 Zürcher Kantonalbank. Tous droits réservés.