



## IST Fondation d'investissement Groupes de placements

MARCHE MONETAIRE CHF (GM)	3
OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)	4
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF (OAF)	5
GOVERNO BOND (GB)	6
GOVERNO BOND HEDGED CHF (GBH)	8
OBLIGATIONS ETRANGERES (OA)	9
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF (OAH)	11
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF (GCH)	12
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS (OEM)	13
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF (WOB)	14
ACTIONS SUISSE SMI INDEX (ASI)	15
ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)	16
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES (ASE)	17
GLOBE INDEX (GI)	18
GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)	19
GLOBE INDEX SRI (GISRI)	20
EUROPE INDEX SRI (EISRI)	21
ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)	22
GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)	24
AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)	25
EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)	26
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)	27
IMMO OPTIMA SUISSE (IOS)	29
IMMO INVEST SUISSE (IIS)	30
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE (ISW)	31
IMMOBILIER SUISSE FOCUS (ISF)	32
GLOBAL REIT (GR)	33
MIXTA OPTIMA 15 (MO15)	34
MIXTA OPTIMA 25 (MO25)	35
MIXTA OPTIMA 35 (MO35)	37
MIXTA OPTIMA 75 (MO75)	38
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)	39
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)	40
ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)	41

## IST2 Fondation d'investissement Groupes de placements

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)	42
ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE (ASMV)	43
MIXTA OPTIMA 30 (MOB)	44
PRETS HYPOTHECAIRES RESIDENTIELS SUISSES (WHS)	45
GLOSSAIRE	46



## MARCHE MONETAIRE CHF (GM)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MARCHE MONETAIRE CHF III	2.06 %	0.18 %	0.14 %	1.92	3.61	0.08	0.36 %	0.00 %	-
FTSE CHF Eurodep 3m	1.55 %	0.06 %	-	-3.00	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MARCHE MONETAIRE CHF III	0.52 %	0.44 %	0.24 %	-2.75	1.17	1.22	0.60 %	-1.20 %	10.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.23 %	0.30 %	-	-4.87	-	-	-	-1.08 %	13.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MARCHE MONETAIRE CHF III	0.08 %	0.46 %	0.33 %	-3.53	0.78	1.19	0.61 %	-2.34 %	17.00
FTSE CHF Eurodep 3m	-0.18 %	0.28 %	-	-6.83	-	-	-	-2.66 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MARCHE MONETAIRE CHF III	-0.11 %	0.36 %	0.26 %	-5.12	1.43	1.08	0.56 %	-4.12 %	18.00
FTSE CHF Eurodep 3m	-0.48 %	0.22 %	-	-9.86	-	-	-	-6.37 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS SUISSES INDEX I	6.91 %	4.29 %	0.12 %	1.20	2.13	0.99	0.33 %	-0.90 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	6.95 %	4.29 %	0.12 %	1.21	2.48	0.99	0.37 %	-0.90 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	6.99 %	4.29 %	0.12 %	1.22	2.80	0.99	0.41 %	-0.89 %	2.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>6.64 %</i>	<i>4.34 %</i>	<i>-</i>	<i>1.13</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-0.93 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS SUISSES INDEX I	-2.18 %	5.70 %	0.24 %	-0.68	-0.36	1.01	-0.05 %	-14.74 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	-2.14 %	5.70 %	0.24 %	-0.67	-0.20	1.01	-0.01 %	-14.70 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	-2.10 %	5.70 %	0.24 %	-0.67	-0.03	1.01	0.03 %	-14.65 %	15.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>-2.09 %</i>	<i>5.63 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.67</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-14.47 %</i>	<i>15.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS SUISSES INDEX I	-1.19 %	5.63 %	0.22 %	-0.52	-0.50	1.02	-0.07 %	-17.68 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	-1.14 %	5.63 %	0.22 %	-0.51	-0.26	1.02	-0.02 %	-17.53 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	-1.10 %	5.63 %	0.22 %	-0.50	-0.08	1.02	0.02 %	-17.42 %	15.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>-1.08 %</i>	<i>5.54 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.50</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.17 %</i>	<i>15.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS SUISSES INDEX I	0.44 %	4.54 %	0.16 %	-0.28	-1.02	1.01	-0.16 %	-17.68 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	0.50 %	4.54 %	0.16 %	-0.27	-0.61	1.01	-0.09 %	-17.53 %	15.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	0.54 %	4.54 %	0.16 %	-0.26	-0.36	1.01	-0.05 %	-17.42 %	15.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>0.60 %</i>	<i>4.49 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.25</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.17 %</i>	<i>15.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## OBLIGATIONS ETRANGERES CHF (OAF)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF I	5.55 %	2.43 %	0.50 %	1.57	0.24	0.99	0.14 %	-0.31 %	1.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	5.61 %	2.43 %	0.50 %	1.59	0.36	0.99	0.21 %	-0.30 %	1.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	5.65 %	2.43 %	0.50 %	1.61	0.44	0.99	0.25 %	-0.30 %	1.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>5.42 %</i>	<i>2.29 %</i>	<i>-</i>	<i>1.61</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-0.34 %</i>	<i>1.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF I	-1.53 %	3.71 %	0.34 %	-0.87	0.08	0.99	0.01 %	-11.39 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	-1.47 %	3.71 %	0.34 %	-0.86	0.25	0.99	0.07 %	-11.33 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	-1.43 %	3.71 %	0.34 %	-0.85	0.37	0.99	0.11 %	-11.29 %	18.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>-1.56 %</i>	<i>3.71 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.88</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-11.16 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF I	-0.81 %	4.36 %	0.39 %	-0.58	-0.08	1.04	0.05 %	-12.81 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	-0.75 %	4.36 %	0.39 %	-0.56	0.08	1.04	0.11 %	-12.64 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	-0.71 %	4.36 %	0.39 %	-0.55	0.19	1.04	0.15 %	-12.53 %	18.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>-0.77 %</i>	<i>4.19 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.59</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF I	0.14 %	3.26 %	0.49 %	-0.48	-0.30	1.01	-0.13 %	-12.81 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.20 %	3.26 %	0.49 %	-0.46	-0.17	1.01	-0.07 %	-12.64 %	18.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.24 %	3.26 %	0.49 %	-0.45	-0.09	1.01	-0.03 %	-12.53 %	18.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.29 %</i>	<i>3.18 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.45</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## GOVERNO BOND (GB)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-1.91 %	6.16 %	0.33 %	-0.59	-2.20	1.01	-0.68 %	-7.54 %	5.00
GOVERNO BOND II	-1.85 %	6.16 %	0.33 %	-0.58	-2.01	1.01	-0.62 %	-7.50 %	5.00
GOVERNO BOND III	-1.81 %	6.16 %	0.33 %	-0.57	-1.90	1.01	-0.58 %	-7.48 %	5.00
<i>JPM Customised</i>	-1.19 %	5.20 %	-	-0.56	-	-	-	-6.87 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-8.13 %	6.53 %	0.40 %	-1.50	-0.95	0.99	-0.42 %	-26.91 %	5.00
GOVERNO BOND II	-8.08 %	6.53 %	0.40 %	-1.50	-0.80	0.99	-0.37 %	-26.80 %	5.00
GOVERNO BOND III	-8.04 %	6.53 %	0.40 %	-1.49	-0.70	0.99	-0.33 %	-26.73 %	5.00
<i>JPM Customised</i>	-7.78 %	6.56 %	-	-1.44	-	-	-	-26.08 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-4.35 %	5.85 %	0.40 %	-1.03	-0.61	1.00	-0.24 %	-28.06 %	5.00
GOVERNO BOND II	-4.28 %	5.85 %	0.40 %	-1.02	-0.44	1.00	-0.17 %	-27.86 %	5.00
GOVERNO BOND III	-4.24 %	5.86 %	0.40 %	-1.01	-0.32	1.00	-0.13 %	-27.72 %	5.00
<i>JPM Customised</i>	-4.11 %	5.84 %	-	-0.99	-	-	-	-27.27 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-1.16 %	6.58 %	0.39 %	-0.44	-1.08	1.00	-0.41 %	-28.06 %	5.00
GOVERNO BOND II	-1.07 %	6.58 %	0.39 %	-0.42	-0.83	1.01	-0.31 %	-27.86 %	5.00
GOVERNO BOND III	-1.02 %	6.58 %	0.39 %	-0.41	-0.70	1.01	-0.26 %	-27.72 %	5.00
<i>JPM Customised</i>	-0.74 %	6.54 %	-	-0.38	-	-	-	-27.27 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## GOVERNO BOND (GB)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-1.91 %	6.16 %	1.67 %	-0.59	0.76	0.88	0.68 %	-7.54 %	5.00
GOVERNO BOND II	-1.85 %	6.16 %	1.67 %	-0.58	0.80	0.88	0.74 %	-7.50 %	5.00
GOVERNO BOND III	-1.81 %	6.16 %	1.67 %	-0.57	0.82	0.88	0.78 %	-7.48 %	5.00
JPM GBI	-3.18 %	5.99 %	-	-0.82	-	-	-	-7.94 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-8.13 %	6.53 %	1.73 %	-1.50	-0.46	1.04	-0.42 %	-26.91 %	5.00
GOVERNO BOND II	-8.08 %	6.53 %	1.73 %	-1.50	-0.43	1.04	-0.37 %	-26.80 %	5.00
GOVERNO BOND III	-8.04 %	6.53 %	1.73 %	-1.49	-0.41	1.04	-0.33 %	-26.73 %	5.00
JPM GBI	-7.37 %	6.07 %	-	-1.49	-	-	-	-24.43 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-4.35 %	5.85 %	1.55 %	-1.03	-0.14	1.00	-0.21 %	-28.06 %	5.00
GOVERNO BOND II	-4.28 %	5.85 %	1.55 %	-1.02	-0.09	1.00	-0.14 %	-27.86 %	5.00
GOVERNO BOND III	-4.24 %	5.86 %	1.55 %	-1.01	-0.06	1.00	-0.10 %	-27.72 %	5.00
JPM GBI	-4.14 %	5.65 %	-	-1.03	-	-	-	-26.99 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND I	-1.16 %	6.58 %	1.95 %	-0.44	-0.36	1.01	-0.68 %	-28.06 %	5.00
GOVERNO BOND II	-1.07 %	6.58 %	1.95 %	-0.42	-0.31	1.02	-0.59 %	-27.86 %	5.00
GOVERNO BOND III	-1.02 %	6.58 %	1.95 %	-0.41	-0.29	1.02	-0.53 %	-27.72 %	5.00
JPM GBI	-0.45 %	6.19 %	-	-0.35	-	-	-	-26.99 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## GOVERNO BOND HEDGED CHF (GBH)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND HEDGED CHF II	-1.73 %	5.24 %	0.34 %	-0.66	-1.45	1.05	-0.34 %	-6.04 %	5.00
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-1.68 %	5.24 %	0.34 %	-0.65	-1.31	1.05	-0.30 %	-6.01 %	5.00
JPM Customised Hedged CHF	-1.23 %	5.23 %	-	-0.56	-	-	-	-5.39 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND HEDGED CHF II	-5.86 %	6.31 %	0.47 %	-1.20	-0.53	0.99	-0.32 %	-21.61 %	5.00
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-5.82 %	6.31 %	0.47 %	-1.19	-0.44	0.99	-0.27 %	-21.53 %	5.00
JPM Customised Hedged CHF	-5.63 %	6.37 %	-	-1.15	-	-	-	-21.06 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND HEDGED CHF II	-2.89 %	5.60 %	0.44 %	-0.82	-0.52	0.99	-0.27 %	-23.28 %	5.00
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-2.84 %	5.60 %	0.44 %	-0.81	-0.41	0.99	-0.23 %	-23.17 %	5.00
JPM Customised Hedged CHF	-2.67 %	5.66 %	-	-0.77	-	-	-	-22.79 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GOVERNO BOND HEDGED CHF II	-0.54 %	4.77 %	0.45 %	-0.47	-0.79	1.00	-0.35 %	-23.28 %	5.00
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-0.49 %	4.77 %	0.44 %	-0.46	-0.68	1.00	-0.30 %	-23.17 %	5.00
JPM Customised Hedged CHF	-0.19 %	4.75 %	-	-0.40	-	-	-	-22.79 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## OBLIGATIONS ETRANGERES (OA)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	1.94 %	5.69 %	0.33 %	0.04	3.10	1.05	1.05 %	-5.41 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	2.00 %	5.69 %	0.33 %	0.05	3.28	1.05	1.11 %	-5.38 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	2.04 %	5.69 %	0.33 %	0.06	3.40	1.05	1.15 %	-5.36 %	5.00
<i>Bloomberg Customized</i>	<i>0.93 %</i>	<i>5.78 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.14</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.71 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-7.37 %	7.27 %	0.66 %	-1.25	0.16	1.04	0.48 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-7.32 %	7.27 %	0.66 %	-1.24	0.25	1.04	0.53 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-7.28 %	7.27 %	0.66 %	-1.23	0.31	1.04	0.57 %	-26.07 %	5.00
<i>Bloomberg Customized</i>	<i>-7.46 %</i>	<i>6.95 %</i>	<i>-</i>	<i>-1.32</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-25.95 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-3.52 %	6.65 %	0.76 %	-0.78	0.32	1.05	0.51 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-3.45 %	6.65 %	0.76 %	-0.77	0.42	1.05	0.58 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-3.41 %	6.65 %	0.76 %	-0.77	0.48	1.05	0.63 %	-26.07 %	5.00
<i>Bloomberg Customized</i>	<i>-3.74 %</i>	<i>6.28 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.87</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-25.95 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-0.59 %	6.74 %	0.63 %	-0.34	0.19	1.01	0.14 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.48 %	6.74 %	0.63 %	-0.33	0.37	1.01	0.26 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.43 %	6.74 %	0.63 %	-0.32	0.45	1.01	0.31 %	-26.07 %	5.00
<i>Bloomberg Customized</i>	<i>-0.70 %</i>	<i>6.62 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.36</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-25.95 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## OBLIGATIONS ETRANGERES (OA)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	1.94 %	5.69 %	2.45 %	0.04	2.12	0.80	4.12 %	-5.41 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	2.00 %	5.69 %	2.45 %	0.05	2.15	0.80	4.18 %	-5.38 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	2.04 %	5.69 %	2.45 %	0.06	2.16	0.80	4.23 %	-5.36 %	5.00
JPM GBI	-3.18 %	5.99 %	-	-0.82	-	-	-	-7.94 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-7.37 %	7.27 %	3.60 %	-1.25	0.00	1.04	0.37 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-7.32 %	7.27 %	3.60 %	-1.24	0.02	1.04	0.43 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-7.28 %	7.27 %	3.60 %	-1.23	0.03	1.04	0.46 %	-26.07 %	5.00
JPM GBI	-7.37 %	6.07 %	-	-1.49	-	-	-	-24.43 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-3.52 %	6.65 %	4.48 %	-0.78	0.14	0.88	-0.09 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-3.45 %	6.65 %	4.48 %	-0.77	0.15	0.88	-0.01 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-3.41 %	6.65 %	4.48 %	-0.77	0.16	0.88	0.03 %	-26.07 %	5.00
JPM GBI	-4.14 %	5.65 %	-	-1.03	-	-	-	-26.99 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES I	-0.59 %	6.74 %	3.82 %	-0.34	-0.05	0.90	-0.36 %	-26.26 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.48 %	6.74 %	3.82 %	-0.33	-0.02	0.90	-0.24 %	-26.15 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.43 %	6.74 %	3.82 %	-0.32	0.00	0.90	-0.19 %	-26.07 %	5.00
JPM GBI	-0.45 %	6.19 %	-	-0.35	-	-	-	-26.99 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF (OAH)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF I	1.61 %	4.45 %	0.45 %	-0.02	2.20	0.95	0.96 %	-3.65 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	1.67 %	4.45 %	0.45 %	-0.01	2.34	0.95	1.02 %	-3.62 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	1.71 %	4.45 %	0.45 %	0.00	2.43	0.95	1.06 %	-3.59 %	2.00
<i>Bloomberg Customized Hedged CHF</i>	<i>0.61 %</i>	<i>4.66 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.24</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-4.11 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF I	-4.84 %	6.59 %	0.69 %	-0.99	0.18	1.00	0.12 %	-19.73 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-4.78 %	6.59 %	0.69 %	-0.98	0.27	1.00	0.18 %	-19.62 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-4.74 %	6.59 %	0.69 %	-0.98	0.32	1.00	0.21 %	-19.54 %	5.00
<i>Bloomberg Customized Hedged CHF</i>	<i>-4.95 %</i>	<i>6.55 %</i>	<i>-</i>	<i>-1.02</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.68 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF I	-2.04 %	5.94 %	0.77 %	-0.63	0.29	1.02	0.28 %	-20.59 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-1.97 %	5.94 %	0.77 %	-0.62	0.38	1.02	0.36 %	-20.46 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-1.93 %	5.94 %	0.77 %	-0.61	0.44	1.02	0.40 %	-20.36 %	5.00
<i>Bloomberg Customized Hedged CHF</i>	<i>-2.26 %</i>	<i>5.79 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.68</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF I	0.00 %	4.71 %	0.62 %	-0.36	0.07	1.01	0.07 %	-20.59 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	0.11 %	4.71 %	0.62 %	-0.34	0.26	1.01	0.18 %	-20.46 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	0.16 %	4.71 %	0.62 %	-0.33	0.34	1.01	0.23 %	-20.36 %	5.00
<i>Bloomberg Customized Hedged CHF</i>	<i>-0.05 %</i>	<i>4.61 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.38</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF (GCH)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	1.44 %	6.04 %	0.78 %	-0.05	0.20	1.09	0.16 %	-5.98 %	2.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	1.32 %	5.38 %	-	-0.07	-	-	-	-5.50 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	-4.15 %	7.91 %	0.59 %	-0.74	0.39	1.03	0.41 %	-20.63 %	5.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	-4.35 %	7.63 %	-	-0.79	-	-	-	-20.66 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	-3.98 %	7.44 %	0.67 %	-0.76	0.10	1.04	0.26 %	-21.32 %	5.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	-4.02 %	7.15 %	-	-0.80	-	-	-	-20.92 %	5.00

Période d'observation: 01.09.2020 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## OBLIGATIONS EMERGING MARKETS (OEM)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS I	3.30 %	6.78 %	1.71 %	0.23	-0.09	0.81	0.20 %	-2.75 %	4.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	3.35 %	6.79 %	1.71 %	0.24	-0.06	0.81	0.25 %	-2.72 %	4.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	3.40 %	6.78 %	1.72 %	0.25	-0.03	0.81	0.30 %	-2.71 %	4.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>3.43 %</i>	<i>6.41 %</i>	<i>-</i>	<i>0.27</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.11 %</i>	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS I	-2.63 %	7.48 %	1.37 %	-0.58	0.30	1.00	0.41 %	-17.57 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	-2.58 %	7.48 %	1.37 %	-0.57	0.34	1.00	0.47 %	-17.51 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	-2.54 %	7.48 %	1.37 %	-0.57	0.37	1.00	0.50 %	-17.46 %	18.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>-3.03 %</i>	<i>7.34 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.65</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-18.11 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS I	-1.60 %	9.40 %	1.36 %	-0.35	0.23	1.05	0.45 %	-21.68 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	-1.54 %	9.41 %	1.36 %	-0.34	0.27	1.05	0.52 %	-21.55 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	-1.50 %	9.41 %	1.37 %	-0.34	0.30	1.05	0.55 %	-21.46 %	18.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>-1.86 %</i>	<i>8.85 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.40</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-22.44 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS I	-0.50 %	9.79 %	1.42 %	-0.23	-0.24	1.05	-0.29 %	-21.68 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	-0.43 %	9.79 %	1.42 %	-0.22	-0.19	1.05	-0.22 %	-21.55 %	18.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	-0.39 %	9.79 %	1.43 %	-0.21	-0.16	1.05	-0.18 %	-21.46 %	18.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>-0.12 %</i>	<i>9.25 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.20</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-22.44 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF (WOB)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF I	2.44 %	4.61 %	2.32 %	0.16	-0.42	0.88	-0.73 %	-7.27 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	2.49 %	4.60 %	2.32 %	0.17	-0.40	0.88	-0.67 %	-7.26 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	2.53 %	4.61 %	2.32 %	0.18	-0.38	0.88	-0.63 %	-7.25 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	3.37 %	4.91 %	-	0.33	-	-	-	-7.66 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF I	-4.52 %	8.13 %	1.90 %	-0.76	-0.17	0.91	-0.76 %	-20.36 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	-4.46 %	8.13 %	1.90 %	-0.76	-0.14	0.91	-0.70 %	-20.24 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	-4.43 %	8.13 %	1.90 %	-0.75	-0.12	0.91	-0.67 %	-20.16 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	-4.27 %	8.69 %	-	-0.69	-	-	-	-21.30 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF I	0.70 %	8.74 %	1.98 %	-0.12	-0.26	0.91	-0.49 %	-21.07 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	0.78 %	8.74 %	1.98 %	-0.11	-0.22	0.91	-0.41 %	-20.95 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	0.82 %	8.74 %	1.98 %	-0.10	-0.20	0.91	-0.37 %	-20.86 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	1.14 %	9.38 %	-	-0.06	-	-	-	-21.30 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF I	0.81 %	6.97 %	1.61 %	-0.13	-0.15	0.91	-0.26 %	-21.07 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	0.92 %	6.97 %	1.61 %	-0.11	-0.09	0.91	-0.15 %	-20.95 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	0.99 %	6.97 %	1.61 %	-0.10	-0.04	0.91	-0.08 %	-20.86 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	1.01 %	7.48 %	-	-0.10	-	-	-	-21.30 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS SUISSE SMI INDEX (ASI)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SMI INDEX I	8.56 %	9.70 %	0.02 %	0.70	-11.50	1.00	-0.22 %	-8.81 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	8.61 %	9.70 %	0.02 %	0.71	-9.30	1.00	-0.17 %	-8.79 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	8.65 %	9.70 %	0.02 %	0.71	-7.27	1.00	-0.13 %	-8.77 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	8.67 %	9.70 %	0.02 %	0.71	-6.34	1.00	-0.11 %	-8.77 %	4.00
<i>SMI TR</i>	<i>8.78 %</i>	<i>9.71 %</i>	<i>-</i>	<i>0.72</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-8.73 %</i>	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SMI INDEX I	4.84 %	12.64 %	0.02 %	0.25	-11.38	1.00	-0.20 %	-18.09 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	4.88 %	12.64 %	0.02 %	0.25	-9.03	1.00	-0.16 %	-18.07 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	4.93 %	12.64 %	0.02 %	0.25	-6.66	1.00	-0.11 %	-18.04 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	4.94 %	12.64 %	0.02 %	0.25	-6.21	1.00	-0.11 %	-18.04 %	18.00
<i>SMI TR</i>	<i>5.04 %</i>	<i>12.64 %</i>	<i>-</i>	<i>0.26</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.98 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SMI INDEX I	7.46 %	12.57 %	0.02 %	0.45	-9.79	1.00	-0.23 %	-18.09 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	7.50 %	12.57 %	0.02 %	0.46	-7.76	1.00	-0.18 %	-18.07 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	7.56 %	12.57 %	0.02 %	0.46	-5.70	1.00	-0.12 %	-18.04 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	7.57 %	12.57 %	0.02 %	0.46	-5.43	1.00	-0.12 %	-18.04 %	18.00
<i>SMI TR</i>	<i>7.68 %</i>	<i>12.57 %</i>	<i>-</i>	<i>0.47</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.98 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SMI INDEX I	6.39 %	12.19 %	0.03 %	0.38	-10.28	1.00	-0.29 %	-18.09 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	6.49 %	12.19 %	0.02 %	0.39	-9.61	1.00	-0.19 %	-18.07 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	6.56 %	12.19 %	0.02 %	0.40	-6.69	1.00	-0.12 %	-18.04 %	18.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	6.56 %	12.19 %	0.02 %	0.40	-6.52	1.00	-0.12 %	-18.04 %	18.00
<i>SMI TR</i>	<i>6.68 %</i>	<i>12.19 %</i>	<i>-</i>	<i>0.41</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.98 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	4.14 %	9.02 %	0.81 %	0.27	-2.39	0.97	-1.88 %	-10.27 %	5.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	4.21 %	9.02 %	0.81 %	0.27	-2.32	0.97	-1.81 %	-10.24 %	5.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	4.25 %	9.02 %	0.81 %	0.28	-2.27	0.97	-1.77 %	-10.22 %	5.00
<i>SPI</i>	<i>6.16 %</i>	<i>9.41 %</i>	<i>-</i>	<i>0.47</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-9.66 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	2.95 %	12.11 %	1.09 %	0.10	-0.38	0.95	-0.26 %	-18.43 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	3.01 %	12.11 %	1.08 %	0.11	-0.32	0.95	-0.20 %	-18.39 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	3.05 %	12.11 %	1.08 %	0.11	-0.29	0.95	-0.16 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>3.29 %</i>	<i>12.72 %</i>	<i>-</i>	<i>0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	6.23 %	12.27 %	1.12 %	0.37	-0.32	0.97	-0.18 %	-18.43 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	6.29 %	12.27 %	1.11 %	0.37	-0.27	0.97	-0.11 %	-18.39 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	6.34 %	12.27 %	1.11 %	0.37	-0.23	0.97	-0.07 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.56 %</i>	<i>12.61 %</i>	<i>-</i>	<i>0.38</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	6.48 %	11.68 %	1.13 %	0.41	-0.09	0.97	0.11 %	-18.43 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	6.53 %	11.68 %	1.13 %	0.41	-0.04	0.97	0.17 %	-18.39 %	18.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	6.60 %	11.68 %	1.13 %	0.42	0.01	0.97	0.23 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.53 %</i>	<i>12.05 %</i>	<i>-</i>	<i>0.40</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES (ASE)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES I	-2.74 %	11.76 %	1.88 %	-0.38	-2.07	1.11	-4.01 %	-14.50 %	5.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	-2.67 %	11.76 %	1.88 %	-0.37	-2.03	1.11	-3.94 %	-14.47 %	5.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	-2.58 %	11.76 %	1.88 %	-0.36	-1.99	1.11	-3.85 %	-14.43 %	5.00
<i>SPI EXTRA</i>	1.32 %	10.94 %	-	-0.04	-	-	-	-11.96 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES I	-1.85 %	16.08 %	1.99 %	-0.22	-0.01	1.07	0.07 %	-31.29 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	-1.79 %	16.08 %	1.99 %	-0.22	0.03	1.07	0.14 %	-31.25 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	-1.69 %	16.08 %	1.99 %	-0.21	0.07	1.07	0.23 %	-31.21 %	18.00
<i>SPI EXTRA</i>	-1.69 %	14.96 %	-	-0.23	-	-	-	-30.06 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES I	5.37 %	16.14 %	2.39 %	0.22	0.05	1.00	0.10 %	-31.29 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	5.45 %	16.15 %	2.40 %	0.23	0.08	1.00	0.19 %	-31.25 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	5.57 %	16.15 %	2.40 %	0.24	0.13	1.00	0.31 %	-31.21 %	18.00
<i>SPI EXTRA</i>	5.25 %	15.90 %	-	0.22	-	-	-	-30.06 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES I	7.45 %	14.74 %	2.41 %	0.39	0.16	1.03	0.20 %	-31.29 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	7.57 %	14.74 %	2.41 %	0.40	0.21	1.03	0.31 %	-31.25 %	18.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	7.72 %	14.74 %	2.41 %	0.41	0.27	1.03	0.46 %	-31.21 %	18.00
<i>SPI EXTRA</i>	7.10 %	14.12 %	-	0.38	-	-	-	-30.06 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## GLOBE INDEX (GI)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX I	24.20 %	10.40 %	0.10 %	2.15	2.65	1.00	0.29 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX II	24.25 %	10.40 %	0.10 %	2.16	3.04	1.00	0.34 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX III	24.34 %	10.40 %	0.10 %	2.17	3.76	1.00	0.43 %	-4.61 %	2.00
GLOBE INDEX G	24.36 %	10.40 %	0.10 %	2.17	3.90	1.00	0.45 %	-4.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	23.87 %	10.60 %	-	2.08	-	-	-	-4.68 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX I	7.32 %	14.67 %	0.09 %	0.38	1.80	1.00	0.18 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	7.36 %	14.67 %	0.09 %	0.38	2.23	1.00	0.22 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	7.44 %	14.67 %	0.09 %	0.39	3.02	1.00	0.30 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	7.46 %	14.67 %	0.09 %	0.39	3.19	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	7.14 %	14.66 %	-	0.37	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX I	10.18 %	16.73 %	0.09 %	0.50	2.14	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.23 %	16.73 %	0.09 %	0.51	2.65	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.31 %	16.73 %	0.09 %	0.51	3.40	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.33 %	16.73 %	0.09 %	0.51	3.65	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.96 %	16.73 %	-	0.49	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX I	9.95 %	14.66 %	0.08 %	0.56	2.46	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.01 %	14.66 %	0.08 %	0.56	3.15	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.08 %	14.67 %	0.08 %	0.57	3.93	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.12 %	14.67 %	0.08 %	0.57	4.32	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.74 %	14.67 %	-	0.54	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	22.30 %	9.85 %	0.15 %	2.08	2.84	1.00	0.45 %	-8.68 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	22.40 %	9.85 %	0.15 %	2.09	3.38	1.00	0.54 %	-8.66 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	22.42 %	9.85 %	0.15 %	2.09	3.51	1.00	0.57 %	-8.66 %	2.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	21.79 %	9.76 %	-	2.05	-	-	-	-8.79 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	7.40 %	15.69 %	0.14 %	0.36	1.41	1.00	0.20 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	7.45 %	15.69 %	0.15 %	0.36	1.67	1.00	0.24 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	7.51 %	15.69 %	0.14 %	0.37	2.12	1.00	0.31 %	-23.08 %	17.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	7.20 %	15.66 %	-	0.35	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	10.43 %	16.99 %	0.15 %	0.51	1.46	1.00	0.22 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	10.46 %	16.99 %	0.15 %	0.51	1.62	1.00	0.25 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	10.54 %	16.99 %	0.15 %	0.52	2.16	1.00	0.33 %	-23.08 %	17.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	10.20 %	16.98 %	-	0.50	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	8.38 %	14.80 %	0.14 %	0.45	1.28	1.00	0.20 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	8.39 %	14.80 %	0.14 %	0.45	1.37	1.00	0.22 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	8.48 %	14.80 %	0.14 %	0.45	1.96	1.00	0.30 %	-23.08 %	17.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	8.18 %	14.81 %	-	0.43	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## GLOBE INDEX SRI (GISRI)

### Indicateurs de risque

<b>1 année</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX SRI III	21.01 %	11.03 %	0.06 %	1.74	2.72	1.00	0.22 %	-5.60 %	2.00
MSCI World ex Switzerland SRI	20.83 %	11.25 %	-	1.69	-	-	-	-5.67 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>3 années</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX SRI III	7.32 %	15.64 %	0.08 %	0.36	1.96	1.00	0.20 %	-22.63 %	17.00
MSCI World ex Switzerland SRI	7.13 %	15.69 %	-	0.34	-	-	-	-22.84 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>Depuis le lancement</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBE INDEX SRI III	11.08 %	16.49 %	0.08 %	0.57	2.07	1.00	0.22 %	-22.63 %	17.00
MSCI World ex Switzerland SRI	10.89 %	16.53 %	-	0.55	-	-	-	-22.84 %	18.00

Période d'observation: 14.10.2020 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## EUROPE INDEX SRI (EISRI)

### Indicateurs de risque

<b>1 année</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE INDEX SRI III	17.55 %	12.01 %	0.08 %	1.31	-0.29	1.00	-0.02 %	-7.15 %	2.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	17.57 %	12.00 %	-	1.32	-	-	-	-7.10 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>3 années</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE INDEX SRI III	6.43 %	16.17 %	0.09 %	0.29	-0.37	1.00	-0.02 %	-28.50 %	17.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	6.45 %	16.21 %	-	0.29	-	-	-	-28.55 %	17.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>Depuis le lancement</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE INDEX SRI III	10.67 %	18.65 %	0.09 %	0.48	-0.76	1.00	-0.04 %	-28.50 %	17.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	10.74 %	18.69 %	-	0.48	-	-	-	-28.55 %	17.00

Période d'observation: 14.10.2020 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	10.91 %	8.23 %	7.12 %	1.11	-1.54	0.67	-5.60 %	-3.55 %	3.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	10.97 %	8.23 %	7.12 %	1.12	-1.53	0.67	-5.53 %	-3.53 %	3.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	11.02 %	8.23 %	7.12 %	1.13	-1.53	0.67	-5.49 %	-3.52 %	3.00
MSCI World ex-CH ndr	23.87 %	10.60 %	-	2.08	-	-	-	-4.68 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	5.02 %	11.79 %	7.59 %	0.28	-0.35	0.69	-0.43 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.08 %	11.79 %	7.59 %	0.28	-0.34	0.69	-0.37 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.13 %	11.79 %	7.59 %	0.29	-0.33	0.69	-0.33 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	7.14 %	14.66 %	-	0.37	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	4.82 %	14.47 %	7.38 %	0.21	-0.72	0.78	-3.30 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	4.89 %	14.47 %	7.38 %	0.22	-0.71	0.78	-3.23 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	4.94 %	14.47 %	7.38 %	0.22	-0.70	0.78	-3.18 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.96 %	16.73 %	-	0.49	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	5.78 %	12.52 %	6.10 %	0.32	-0.67	0.78	-2.17 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.87 %	12.52 %	6.10 %	0.33	-0.66	0.78	-2.09 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.92 %	12.52 %	6.10 %	0.33	-0.65	0.78	-2.04 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.74 %	14.67 %	-	0.54	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	10.91 %	8.23 %	3.21 %	1.11	0.41	1.14	0.22 %	-3.55 %	3.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	10.97 %	8.23 %	3.21 %	1.12	0.43	1.14	0.28 %	-3.53 %	3.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	11.02 %	8.23 %	3.21 %	1.13	0.44	1.14	0.33 %	-3.52 %	3.00
MSCI World Min Vol NR	9.58 %	7.89 %	-	0.99	-	-	-	-3.18 %	3.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	5.02 %	11.79 %	3.38 %	0.28	0.49	1.09	1.46 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.08 %	11.79 %	3.38 %	0.28	0.51	1.09	1.52 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.13 %	11.79 %	3.38 %	0.29	0.52	1.09	1.57 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	3.41 %	10.39 %	-	0.16	-	-	-	-11.38 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	4.82 %	14.47 %	4.37 %	0.21	0.27	1.18	0.58 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	4.89 %	14.47 %	4.37 %	0.22	0.29	1.18	0.65 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	4.94 %	14.47 %	4.37 %	0.22	0.30	1.18	0.69 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	3.87 %	11.87 %	-	0.18	-	-	-	-16.95 %	15.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	5.78 %	12.52 %	4.40 %	0.32	-0.42	1.10	-2.68 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.87 %	12.52 %	4.40 %	0.33	-0.40	1.10	-2.59 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.92 %	12.52 %	4.40 %	0.33	-0.39	1.10	-2.54 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	7.88 %	10.74 %	-	0.57	-	-	-	-16.95 %	15.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL SMALL MID CAPS I	10.23 %	12.09 %	2.14 %	0.70	-1.85	1.06	-5.37 %	-11.23 %	4.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	10.30 %	12.09 %	2.14 %	0.71	-1.82	1.06	-5.31 %	-11.21 %	4.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	10.34 %	12.09 %	2.14 %	0.71	-1.80	1.06	-5.26 %	-11.20 %	4.00
MSCI AC World SC ndr	14.83 %	12.03 %	-	1.08	-	-	-	-9.28 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL SMALL MID CAPS I	-2.43 %	16.14 %	3.78 %	-0.26	-0.69	0.99	-2.59 %	-29.66 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	-2.37 %	16.15 %	3.78 %	-0.25	-0.67	0.99	-2.53 %	-29.57 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	-2.33 %	16.15 %	3.78 %	-0.25	-0.66	0.99	-2.49 %	-29.50 %	5.00
MSCI AC World SC ndr	0.15 %	15.84 %	-	-0.10	-	-	-	-21.61 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL SMALL MID CAPS I	4.38 %	18.03 %	4.51 %	0.15	-0.41	0.89	-1.03 %	-29.66 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	4.44 %	18.03 %	4.51 %	0.15	-0.40	0.89	-0.97 %	-29.57 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	4.48 %	18.03 %	4.51 %	0.15	-0.39	0.89	-0.93 %	-29.50 %	5.00
MSCI AC World SC ndr	5.86 %	19.73 %	-	0.21	-	-	-	-30.25 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL SMALL MID CAPS I	6.91 %	15.52 %	3.81 %	0.33	-0.09	0.90	0.45 %	-29.66 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	6.96 %	15.52 %	3.81 %	0.34	-0.08	0.90	0.50 %	-29.57 %	5.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	7.05 %	15.53 %	3.82 %	0.34	-0.06	0.90	0.58 %	-29.50 %	5.00
MSCI AC World SC ndr	6.97 %	16.76 %	-	0.31	-	-	-	-30.25 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AMERICA SMALL MID CAPS III	15.32 %	16.66 %	2.31 %	0.81	-1.58	1.03	-4.92 %	-12.40 %	4.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	15.33 %	16.66 %	2.31 %	0.81	-1.58	1.03	-4.91 %	-12.40 %	4.00
Russell 2500 TR	19.73 %	16.80 %	-	1.07	-	-	-	-10.56 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AMERICA SMALL MID CAPS III	1.40 %	18.70 %	4.14 %	-0.02	-0.03	0.98	-0.08 %	-24.91 %	5.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	1.41 %	18.70 %	4.14 %	-0.02	-0.03	0.98	-0.07 %	-24.90 %	5.00
Russell 2500 TR	1.48 %	18.54 %	-	-0.01	-	-	-	-21.71 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AMERICA SMALL MID CAPS III	6.45 %	20.50 %	4.73 %	0.23	-0.33	0.92	-0.80 %	-29.66 %	10.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	6.49 %	20.50 %	4.73 %	0.23	-0.32	0.92	-0.76 %	-29.64 %	10.00
Russell 2500 TR	7.71 %	21.70 %	-	0.27	-	-	-	-30.52 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AMERICA SMALL MID CAPS III	8.49 %	18.08 %	4.21 %	0.37	-0.18	0.93	-0.04 %	-29.66 %	10.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	8.57 %	18.08 %	4.22 %	0.38	-0.17	0.93	0.04 %	-29.64 %	10.00
Russell 2500 TR	9.05 %	18.99 %	-	0.38	-	-	-	-30.52 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE SMALL MID CAPS I	2.64 %	15.35 %	5.05 %	0.06	-0.97	1.05	-5.67 %	-15.72 %	5.00
EUROPE SMALL MID CAPS II	2.72 %	15.35 %	5.05 %	0.06	-0.96	1.05	-5.59 %	-15.69 %	5.00
EUROPE SMALL MID CAPS III	2.76 %	15.35 %	5.05 %	0.07	-0.95	1.05	-5.55 %	-15.67 %	5.00
<i>MSCI Europe Small Cap NR</i>	<i>8.01 %</i>	<i>13.08 %</i>	-	<i>0.65</i>	-	-	-	<i>-12.00 %</i>	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE SMALL MID CAPS I	-8.57 %	20.42 %	6.23 %	-0.50	-0.81	1.04	-4.81 %	-46.54 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS II	-8.51 %	20.42 %	6.24 %	-0.50	-0.80	1.04	-4.75 %	-46.51 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS III	-8.47 %	20.42 %	6.24 %	-0.50	-0.79	1.04	-4.71 %	-46.48 %	18.00
<i>MSCI Europe Small Cap NR</i>	<i>-3.53 %</i>	<i>18.64 %</i>	-	<i>-0.28</i>	-	-	-	<i>-37.72 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE SMALL MID CAPS I	2.14 %	21.68 %	6.65 %	0.02	-0.20	0.95	-1.01 %	-46.54 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS II	2.20 %	21.68 %	6.65 %	0.02	-0.19	0.95	-0.95 %	-46.51 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS III	2.25 %	21.68 %	6.65 %	0.02	-0.18	0.95	-0.91 %	-46.48 %	18.00
<i>MSCI Europe Small Cap NR</i>	<i>3.23 %</i>	<i>21.74 %</i>	-	<i>0.07</i>	-	-	-	<i>-37.72 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
EUROPE SMALL MID CAPS I	5.40 %	18.07 %	5.45 %	0.20	0.14	0.94	1.16 %	-46.54 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS II	5.49 %	18.08 %	5.45 %	0.21	0.15	0.94	1.25 %	-46.51 %	18.00
EUROPE SMALL MID CAPS III	5.56 %	18.08 %	5.46 %	0.21	0.16	0.94	1.32 %	-46.48 %	18.00
<i>MSCI Europe Small Cap NR</i>	<i>4.41 %</i>	<i>18.40 %</i>	-	<i>0.15</i>	-	-	-	<i>-37.72 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	14.20 %	9.10 %	5.49 %	1.36	1.21	0.70	9.05 %	-3.88 %	4.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	14.26 %	9.10 %	5.49 %	1.37	1.22	0.70	9.11 %	-3.86 %	4.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	14.31 %	9.10 %	5.49 %	1.38	1.23	0.70	9.16 %	-3.85 %	4.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>6.63 %</i>	<i>12.07 %</i>	<i>-</i>	<i>0.41</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-7.79 %</i>	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	0.73 %	11.92 %	7.64 %	-0.08	0.90	0.69	4.63 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	0.79 %	11.92 %	7.64 %	-0.08	0.91	0.69	4.69 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	0.83 %	11.92 %	7.64 %	-0.07	0.92	0.69	4.73 %	-17.78 %	18.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>-6.43 %</i>	<i>14.88 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.55</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-30.69 %</i>	<i>17.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	2.86 %	15.33 %	7.41 %	0.07	0.30	0.83	2.41 %	-28.65 %	11.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	2.93 %	15.33 %	7.41 %	0.08	0.31	0.83	2.48 %	-28.61 %	11.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	2.97 %	15.33 %	7.41 %	0.08	0.31	0.83	2.52 %	-28.58 %	11.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>0.19 %</i>	<i>16.58 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.09</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-30.69 %</i>	<i>17.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.86 %	13.99 %	6.30 %	0.15	0.06	0.84	0.94 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.94 %	13.99 %	6.30 %	0.16	0.07	0.84	1.01 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.97 %	13.99 %	6.30 %	0.16	0.07	0.84	1.05 %	-32.22 %	12.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>3.15 %</i>	<i>15.08 %</i>	<i>-</i>	<i>0.09</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-30.69 %</i>	<i>17.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	14.20 %	9.10 %	3.04 %	1.36	2.56	1.04	8.01 %	-3.88 %	4.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	14.26 %	9.10 %	3.04 %	1.37	2.58	1.04	8.07 %	-3.86 %	4.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	14.31 %	9.10 %	3.04 %	1.38	2.59	1.04	8.12 %	-3.85 %	4.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	6.03 %	7.94 %	-	0.73	-	-	-	-4.71 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	0.73 %	11.92 %	4.99 %	-0.08	0.61	1.10	3.25 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	0.79 %	11.92 %	4.99 %	-0.08	0.62	1.10	3.31 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	0.83 %	11.92 %	4.99 %	-0.07	0.63	1.10	3.35 %	-17.78 %	18.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	-2.14 %	9.89 %	-	-0.39	-	-	-	-16.39 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	2.86 %	15.33 %	5.95 %	0.07	0.53	1.20	3.15 %	-28.65 %	11.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	2.93 %	15.33 %	5.95 %	0.08	0.54	1.20	3.21 %	-28.61 %	11.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	2.97 %	15.33 %	5.95 %	0.08	0.54	1.20	3.25 %	-28.58 %	11.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	0.05 %	11.96 %	-	-0.14	-	-	-	-23.34 %	12.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.86 %	13.99 %	5.98 %	0.15	0.18	1.14	0.76 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.94 %	13.99 %	5.98 %	0.16	0.20	1.14	0.83 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.97 %	13.99 %	5.98 %	0.16	0.20	1.14	0.87 %	-32.22 %	12.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	2.93 %	11.17 %	-	0.11	-	-	-	-23.34 %	12.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## IMMO OPTIMA SUISSE (IOS)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO OPTIMA SUISSE I	12.47 %	10.63 %	0.64 %	1.01	1.11	1.04	0.36 %	-5.87 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	12.54 %	10.63 %	0.64 %	1.01	1.21	1.04	0.42 %	-5.84 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	12.58 %	10.63 %	0.64 %	1.02	1.27	1.04	0.47 %	-5.82 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>11.72 %</i>	<i>10.66 %</i>	<i>-</i>	<i>0.93</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.81 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO OPTIMA SUISSE I	1.42 %	9.73 %	0.71 %	-0.03	1.58	0.99	1.12 %	-16.91 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	1.48 %	9.73 %	0.71 %	-0.02	1.67	0.99	1.18 %	-16.80 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	1.52 %	9.73 %	0.71 %	-0.02	1.73	0.99	1.22 %	-16.73 %	5.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>0.29 %</i>	<i>9.79 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.15</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO OPTIMA SUISSE I	4.86 %	9.77 %	0.74 %	0.32	0.41	1.00	0.32 %	-16.91 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	4.93 %	9.77 %	0.74 %	0.33	0.50	1.00	0.39 %	-16.80 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	4.98 %	9.77 %	0.74 %	0.33	0.57	1.00	0.44 %	-16.73 %	5.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>4.54 %</i>	<i>9.75 %</i>	<i>-</i>	<i>0.29</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO OPTIMA SUISSE I	5.57 %	8.61 %	0.69 %	0.45	0.28	1.00	0.20 %	-16.91 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	5.65 %	8.61 %	0.69 %	0.45	0.39	1.00	0.28 %	-16.80 %	5.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	5.73 %	8.61 %	0.69 %	0.46	0.50	1.00	0.35 %	-16.73 %	5.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.37 %</i>	<i>8.57 %</i>	<i>-</i>	<i>0.42</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves





## IMMO INVEST SUISSE (IIS)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO INVEST SUISSE I	1.47 %	0.58 %	0.68 %	-0.41	-0.66	-0.69	-0.09 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	1.58 %	0.60 %	0.68 %	-0.23	-0.52	-0.68	0.01 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	1.67 %	0.62 %	0.68 %	-0.08	-0.39	-0.68	0.10 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	1.78 %	0.64 %	0.68 %	0.09	-0.23	-0.69	0.21 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	1.93 %	0.63 %	-	0.33	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO INVEST SUISSE I	3.59 %	0.87 %	0.78 %	2.15	-0.54	0.68	0.30 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	3.70 %	0.87 %	0.78 %	2.27	-0.41	0.68	0.41 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	3.79 %	0.87 %	0.78 %	2.38	-0.29	0.68	0.49 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.90 %	0.87 %	0.78 %	2.51	-0.15	0.68	0.61 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.03 %	0.63 %	-	3.63	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO INVEST SUISSE I	4.41 %	0.93 %	0.88 %	2.87	-0.09	0.62	0.96 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	4.51 %	0.93 %	0.88 %	2.98	0.03	0.62	1.07 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	4.61 %	0.93 %	0.88 %	3.08	0.13	0.63	1.16 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.73 %	0.93 %	0.88 %	3.21	0.26	0.63	1.27 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.49 %	0.61 %	-	4.49	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMO INVEST SUISSE I	5.05 %	1.05 %	1.01 %	3.15	0.11	0.63	1.32 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	5.16 %	1.05 %	1.01 %	3.25	0.21	0.63	1.43 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	5.26 %	1.05 %	1.01 %	3.35	0.31	0.63	1.53 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.36 %	1.05 %	1.01 %	3.44	0.40	0.62	1.63 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.93 %	0.58 %	-	5.47	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE (ISW)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE I	1.83 %	1.78 %	1.65 %	0.06	-0.06	2.31	-0.38 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	1.93 %	0.63 %	-	0.33	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE I	3.25 %	1.21 %	1.14 %	1.26	-0.66	0.71	-0.12 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.03 %	0.63 %	-	3.63	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE I	3.40 %	1.03 %	1.01 %	1.63	-1.04	0.55	0.15 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.49 %	0.61 %	-	4.49	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE I	3.54 %	1.20 %	1.15 %	1.51	-1.14	0.68	-0.35 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.93 %	0.60 %	-	5.33	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.10.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## IMMOBILIER SUISSE FOCUS (ISF)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER SUISSE FOCUS III	4.34 %	1.68 %	1.44 %	1.56	1.64	-1.99	3.06 %	0.00 %	-
KGAST-Index	1.93 %	0.63 %	-	0.33	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER SUISSE FOCUS III	4.84 %	1.77 %	1.83 %	1.76	0.43	0.22	2.61 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.03 %	0.63 %	-	3.63	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER SUISSE FOCUS III	5.37 %	1.91 %	1.90 %	1.90	0.44	0.52	2.22 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.49 %	0.61 %	-	4.49	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
IMMOBILIER SUISSE FOCUS III	7.51 %	4.03 %	3.87 %	1.43	0.64	2.33	-1.69 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.93 %	0.58 %	-	5.47	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## GLOBAL REIT (GR)

## Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL REIT I	7.21 %	14.80 %	2.89 %	0.37	0.15	1.14	-0.50 %	-12.40 %	2.00
GLOBAL REIT II	7.27 %	14.80 %	2.90 %	0.37	0.17	1.14	-0.43 %	-12.37 %	2.00
GPR 250 World Net CHF	6.99 %	14.22 %	-	0.37	-	-	-	-9.90 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL REIT I	-0.74 %	16.77 %	2.27 %	-0.15	0.62	1.03	1.43 %	-31.54 %	5.00
GLOBAL REIT II	-0.68 %	16.77 %	2.28 %	-0.14	0.65	1.03	1.49 %	-31.46 %	5.00
GPR 250 World Net CHF	-2.07 %	16.17 %	-	-0.23	-	-	-	-32.15 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL REIT I	-1.24 %	18.33 %	2.58 %	-0.16	0.19	0.98	0.49 %	-31.54 %	5.00
GLOBAL REIT II	-1.17 %	18.33 %	2.58 %	-0.16	0.22	0.98	0.55 %	-31.46 %	5.00
GPR 250 World Net CHF	-1.79 %	18.49 %	-	-0.19	-	-	-	-32.15 %	5.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
GLOBAL REIT I	0.86 %	17.81 %	2.44 %	-0.05	0.26	0.99	0.65 %	-31.54 %	5.00
GLOBAL REIT II	0.93 %	17.81 %	2.44 %	-0.04	0.28	0.99	0.71 %	-31.46 %	5.00
GPR 250 World Net CHF	0.20 %	17.82 %	-	-0.08	-	-	-	-32.15 %	5.00

Période d'observation: 01.12.2017 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 15 II	4.55 %	2.34 %	0.80 %	1.20	-1.22	1.11	-1.44 %	-1.78 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	4.60 %	2.34 %	0.80 %	1.23	-1.15	1.11	-1.39 %	-1.77 %	1.00
MO15 Customised	5.58 %	2.63 %	-	1.46	-	-	-	-1.32 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 15 II	-0.47 %	4.46 %	1.04 %	-0.49	0.02	0.89	-0.19 %	-10.95 %	18.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.44 %	4.46 %	1.03 %	-0.48	0.05	0.89	-0.16 %	-10.95 %	18.00
MO15 Customised	-0.52 %	4.89 %	-	-0.46	-	-	-	-11.43 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 15 II	1.15 %	4.55 %	1.11 %	-0.13	-0.11	0.93	-0.14 %	-10.95 %	18.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.17 %	4.55 %	1.11 %	-0.12	-0.09	0.93	-0.12 %	-10.95 %	18.00
MO15 Customised	1.26 %	4.77 %	-	-0.10	-	-	-	-11.43 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 15 II	2.20 %	3.70 %	1.13 %	0.13	-0.38	0.92	-0.35 %	-10.95 %	18.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.20 %	3.70 %	1.13 %	0.13	-0.37	0.92	-0.34 %	-10.95 %	18.00
MO15 Customised	2.62 %	3.86 %	-	0.23	-	-	-	-11.43 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	4.68 %	2.80 %	0.79 %	1.05	-1.72	1.08	-1.80 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.75 %	2.81 %	0.79 %	1.07	-1.65	1.08	-1.74 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.80 %	2.80 %	0.79 %	1.09	-1.58	1.08	-1.69 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	6.13 %	3.02 %	-	1.45	-	-	-	-2.26 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	0.29 %	5.32 %	1.09 %	-0.27	-0.06	0.92	-0.15 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.36 %	5.32 %	1.09 %	-0.26	0.00	0.92	-0.09 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.41 %	5.32 %	1.09 %	-0.25	0.04	0.92	-0.04 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	0.34 %	5.68 %	-	-0.24	-	-	-	-11.81 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	1.97 %	5.67 %	1.19 %	0.04	-0.20	0.97	-0.22 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.05 %	5.67 %	1.19 %	0.06	-0.13	0.97	-0.14 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.10 %	5.67 %	1.19 %	0.07	-0.09	0.97	-0.09 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	2.21 %	5.69 %	-	0.08	-	-	-	-11.81 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	3.18 %	4.89 %	1.25 %	0.30	-0.09	1.00	-0.12 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.29 %	4.89 %	1.25 %	0.32	-0.01	1.00	-0.01 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.34 %	4.89 %	1.26 %	0.33	0.03	1.00	0.04 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	3.29 %	4.72 %	-	0.33	-	-	-	-11.81 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	4.68 %	2.80 %	1.43 %	1.05	-2.10	1.02	-3.35 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.75 %	2.81 %	1.43 %	1.07	-2.06	1.02	-3.29 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.80 %	2.80 %	1.43 %	1.09	-2.03	1.02	-3.23 %	-2.79 %	2.00
LPP 25 (2000)	7.92 %	3.69 %	-	1.67	-	-	-	-1.65 %	1.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	0.29 %	5.32 %	2.34 %	-0.27	0.54	0.77	0.71 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.36 %	5.32 %	2.34 %	-0.26	0.57	0.77	0.77 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.41 %	5.32 %	2.34 %	-0.25	0.59	0.77	0.82 %	-11.11 %	18.00
LPP 25 (2000)	-1.05 %	6.49 %	-	-0.43	-	-	-	-15.55 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	1.97 %	5.67 %	2.08 %	0.04	0.46	0.84	0.91 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.05 %	5.67 %	2.08 %	0.06	0.50	0.84	0.99 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.10 %	5.67 %	2.08 %	0.07	0.52	0.84	1.04 %	-11.11 %	18.00
LPP 25 (2000)	0.95 %	6.36 %	-	-0.12	-	-	-	-15.55 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 25 I	3.18 %	4.89 %	1.78 %	0.30	0.45	0.89	0.92 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.29 %	4.89 %	1.78 %	0.32	0.51	0.89	1.03 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.34 %	4.89 %	1.78 %	0.33	0.54	0.89	1.08 %	-11.11 %	18.00
LPP 25 (2000)	2.33 %	5.16 %	-	0.12	-	-	-	-15.55 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves





## MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 35 I	5.47 %	3.42 %	0.77 %	1.09	-1.99	1.07	-2.04 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.53 %	3.42 %	0.76 %	1.11	-1.92	1.07	-1.98 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.58 %	3.42 %	0.76 %	1.13	-1.85	1.07	-1.93 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	7.11 %	3.63 %	-	1.48	-	-	-	-3.00 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 35 I	0.48 %	6.37 %	1.11 %	-0.19	-0.25	0.94	-0.31 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	0.54 %	6.37 %	1.11 %	-0.18	-0.19	0.94	-0.25 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	0.59 %	6.37 %	1.11 %	-0.18	-0.15	0.94	-0.20 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	0.73 %	6.70 %	-	-0.15	-	-	-	-13.35 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 35 I	2.36 %	6.76 %	1.21 %	0.09	-0.43	0.98	-0.50 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.44 %	6.76 %	1.21 %	0.11	-0.36	0.98	-0.42 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.49 %	6.76 %	1.21 %	0.11	-0.32	0.98	-0.37 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	2.89 %	6.82 %	-	0.17	-	-	-	-13.35 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 35 I	3.48 %	5.86 %	1.14 %	0.30	-0.44	0.98	-0.48 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.58 %	5.86 %	1.14 %	0.32	-0.35	0.98	-0.37 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.64 %	5.86 %	1.14 %	0.33	-0.31	0.98	-0.32 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	3.99 %	5.84 %	-	0.39	-	-	-	-13.35 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(Quote-part en actions et participations à des sociétés dépassée selon l'OPP 2)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 75 II	7.84 %	5.93 %	0.89 %	1.03	-2.43	1.04	-2.74 %	-6.34 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	7.89 %	5.93 %	0.89 %	1.04	-2.38	1.04	-2.69 %	-6.33 %	3.00
MO75 Customised	10.22 %	6.28 %	-	1.35	-	-	-	-5.61 %	3.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 75 II	1.98 %	9.85 %	1.40 %	0.03	-1.03	0.96	-1.39 %	-17.83 %	18.00
MIXTA OPTIMA 75 III	2.01 %	9.88 %	1.24 %	0.03	-1.14	0.96	-1.37 %	-17.82 %	18.00
MO75 Customised	3.44 %	10.16 %	-	0.17	-	-	-	-16.69 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 75 II	3.99 %	10.43 %	1.57 %	0.22	-0.60	0.93	-0.68 %	-17.83 %	18.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.01 %	10.44 %	1.47 %	0.22	-0.62	0.93	-0.67 %	-17.82 %	18.00
MO75 Customised	4.89 %	11.11 %	-	0.28	-	-	-	-16.69 %	18.00

Période d'observation: 01.12.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	3.83 %	4.95 %	-	-	-	-	-	-2.80 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	3.86 %	4.95 %	-	-	-	-	-	-2.79 %	3.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	3.72 %	-	-	-	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	3.75 %	-	-	-	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	3.25 %	3.82 %	-	-0.67	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	3.27 %	3.82 %	-	-0.66	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	2.75 %	3.31 %	-	-0.93	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	2.76 %	3.30 %	-	-0.93	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.12.2015 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 5.85 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	-0.03 %	4.79 %	-	-	-	-	-	-3.14 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.04 %	4.79 %	-	-	-	-	-	-3.13 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.08 %	4.79 %	-	-	-	-	-	-3.13 %	4.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	0.75 %	-	-	-	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.83 %	-	-	-	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.86 %	-	-	-	-	-	-	-5.35 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	0.47 %	3.82 %	-	-0.33	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.56 %	3.81 %	-	-0.30	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.60 %	3.81 %	-	-0.29	-	-	-	-5.35 %	8.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	-0.09 %	3.37 %	-	-0.54	-	-	-	-9.63 %	17.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.00 %	3.36 %	-	-0.51	-	-	-	-9.21 %	46.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.05 %	3.36 %	-	-0.49	-	-	-	-9.10 %	46.00

Période d'observation: 17.02.2016 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)

### Indicateurs de risque

Depuis le lancement	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ILS SIDE POCKET 2 CHF <i>Lancé le 31.01.2024</i>	-31.80 %	21.75 %	-	-	-	-	-	-6.18 %	-
ILS SIDE POCKET 2 CHF <i>Lancé le 31.01.2024</i>	-40.19 %	28.89 %	-	-	-	-	-	-8.21 %	-

Période d'observation: 01.02.2024 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)

### Indicateurs de risque

<b>1 année</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	4.14 %	9.02 %	0.81 %	0.27	-2.39	0.97	-1.88 %	-10.26 %	5.00
<i>SPI</i>	<i>6.16 %</i>	<i>9.41 %</i>	<i>-</i>	<i>0.47</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-9.66 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>3 années</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	2.94 %	12.11 %	1.09 %	0.10	-0.38	0.95	-0.26 %	-18.43 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>3.29 %</i>	<i>12.72 %</i>	<i>-</i>	<i>0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>5 années</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	6.23 %	12.26 %	1.12 %	0.37	-0.32	0.97	-0.18 %	-18.43 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.56 %</i>	<i>12.61 %</i>	<i>-</i>	<i>0.38</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>10 années</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS SUISSES SPI PLUS I	6.48 %	11.67 %	1.13 %	0.41	-0.09	0.97	0.11 %	-18.43 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.53 %</i>	<i>12.05 %</i>	<i>-</i>	<i>0.40</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

## ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE (ASMV)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ II	2.45 %	7.97 %	4.26 %	0.09	-0.89	0.68	-2.28 %	-8.02 %	5.00
ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE III	2.49 %	7.97 %	4.26 %	0.10	-0.88	0.68	-2.24 %	-8.00 %	5.00
<i>SPI</i>	<i>6.16 %</i>	<i>9.41 %</i>	-	<i>0.47</i>	-	-	-	<i>-9.66 %</i>	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ II	1.71 %	10.87 %	3.38 %	0.00	-0.53	0.83	-1.31 %	-16.86 %	18.00
ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE III	1.75 %	10.87 %	3.38 %	0.00	-0.52	0.83	-1.27 %	-16.84 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>3.29 %</i>	<i>12.72 %</i>	-	<i>0.12</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ II	5.17 %	11.41 %	3.08 %	0.30	-0.48	0.88	-0.80 %	-16.86 %	18.00
ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE III	5.22 %	11.41 %	3.08 %	0.30	-0.47	0.88	-0.76 %	-16.84 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.56 %</i>	<i>12.61 %</i>	-	<i>0.38</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ II	6.87 %	11.06 %	2.86 %	0.46	0.06	0.89	0.85 %	-16.86 %	18.00
ACTIONS SUISSES MINIMUM VARIANCE III	6.91 %	11.07 %	2.86 %	0.47	0.07	0.89	0.89 %	-16.84 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.53 %</i>	<i>12.05 %</i>	-	<i>0.40</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

### Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 30 I	5.89 %	3.06 %	1.37 %	1.36	-1.36	0.80	-0.72 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.95 %	3.06 %	1.37 %	1.38	-1.32	0.80	-0.66 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	7.83 %	4.04 %	-	1.51	-	-	-	-3.62 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 30 I	0.19 %	5.78 %	2.03 %	-0.26	0.17	0.77	0.00 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.22 %	5.78 %	2.03 %	-0.26	0.19	0.77	0.04 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	-0.28 %	7.42 %	-	-0.27	-	-	-	-16.11 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 30 I	2.25 %	6.53 %	1.84 %	0.08	-0.11	0.84	-0.01 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.28 %	6.53 %	1.84 %	0.08	-0.10	0.84	0.01 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	2.37 %	7.59 %	-	0.09	-	-	-	-16.11 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MIXTA OPTIMA 30 I	3.11 %	5.64 %	1.52 %	0.25	-0.42	0.87	-0.35 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.13 %	5.64 %	1.52 %	0.25	-0.41	0.87	-0.34 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	3.72 %	6.27 %	-	0.32	-	-	-	-16.11 %	18.00

Période d'observation: 01.04.2014 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves





## PRETS HYPOTHECAIRES RESIDENTIELS SUISSES (WHS)

### Indicateurs de risque

<b>1 année</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	9.05 %	3.96 %	1.75 %	1.85	1.03	1.03	1.74 %	-0.53 %	1.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	7.14 %	4.77 %	-	1.13	-	-	-	-0.86 %	2.00

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

<b>Depuis le lancement</b>	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	-12.37 %	12.58 %	6.69 %	-1.14	-1.53	1.60	-8.08 %	-35.78 %	13.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	-2.04 %	6.94 %	-	-0.54	-	-	-	-14.22 %	18.00

Période d'observation: 02.11.2021 au 31.03.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.71 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

Chiffre-clé	Calcul	Description
Volatilité	$\sqrt{\text{Variance}}$	Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne
Ratio de Sharpe	$\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$	Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru
Tracking error	Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark)	Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif) Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion
Ratio d'information	$\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$	Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru
Coefficient bêta	$\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$	Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché
Alpha de Jensen	$\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$	Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque
Perte relative maximale (cumulée)	$\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$	Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période
Délai de récupération	Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale	Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée
Duration modifiée	$\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$	Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt