



## ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND (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 HIGH DIVIDEND I   | 20.80 %        | 9.10 %         | 6.22 %         | 2.37         | -0.69             | 0.61             | 5.80 %          | -3.35 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II  | 20.92 %        | 9.10 %         | 6.22 %         | 2.38         | -0.68             | 0.61             | 5.91 %          | -3.34 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III | 20.98 %        | 9.10 %         | 6.22 %         | 2.39         | -0.67             | 0.61             | 5.97 %          | -3.34 %            | 2.00                  |
| <i>MSCI World ex-CH ndr</i>      | <i>25.27 %</i> | <i>12.18 %</i> | <i>-</i>       | <i>2.13</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-7.15 %</i>     | <i>5.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2019 au 31.12.2019 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 HIGH DIVIDEND I   | 8.66 %         | 8.93 %         | 4.58 %         | 1.07         | -0.49             | 0.71             | 1.27 %          | -8.45 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II  | 8.77 %         | 8.93 %         | 4.58 %         | 1.08         | -0.47             | 0.71             | 1.38 %          | -8.43 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III | 8.83 %         | 8.93 %         | 4.58 %         | 1.09         | -0.46             | 0.71             | 1.43 %          | -8.41 %            | 2.00                  |
| <i>MSCI World ex-CH ndr</i>      | <i>10.73 %</i> | <i>11.73 %</i> | <i>-</i>       | <i>0.99</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-12.75 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2017 au 31.12.2019 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 HIGH DIVIDEND I   | 6.61 %        | 10.55 %        | 4.95 %         | 0.71         | -0.39             | 0.75             | 0.68 %          | -8.51 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II  | 6.71 %        | 10.55 %        | 4.95 %         | 0.72         | -0.37             | 0.75             | 0.79 %          | -8.45 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III | 6.77 %        | 10.55 %        | 4.95 %         | 0.72         | -0.36             | 0.75             | 0.84 %          | -8.42 %            | 3.00                  |
| <i>MSCI World ex-CH ndr</i>      | <i>8.24 %</i> | <i>13.27 %</i> | <i>-</i>       | <i>0.69</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-12.75 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2015 au 31.12.2019 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 |
|----------------------------------|----------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND I   | 8.40 %         | 9.35 %         | 4.62 %         | 0.99         | -0.72             | 0.76             | -0.28 %         | -8.52 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II  | 8.50 %         | 9.35 %         | 4.62 %         | 1.00         | -0.70             | 0.76             | -0.18 %         | -8.45 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III | 8.55 %         | 9.35 %         | 4.62 %         | 1.01         | -0.69             | 0.76             | -0.13 %         | -8.42 %            | 3.00                  |
| <i>MSCI World ex-CH ndr</i>      | <i>11.75 %</i> | <i>11.31 %</i> | <i>-</i>       | <i>1.11</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-12.75 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2012 au 31.12.2019 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.90 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



## ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND (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 HIGH DIVIDEND I      | 20.80 %        | 9.10 %        | 6.43 %         | 2.37         | 0.29              | 0.62             | 10.00 %         | -3.35 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II     | 20.92 %        | 9.10 %        | 6.44 %         | 2.38         | 0.30              | 0.62             | 10.12 %         | -3.34 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III    | 20.98 %        | 9.10 %        | 6.44 %         | 2.39         | 0.31              | 0.62             | 10.18 %         | -3.34 %            | 2.00                  |
| <i>S&amp;P Dev. High Income NTR</i> | <i>17.98 %</i> | <i>9.07 %</i> | <i>-</i>       | <i>2.54</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-7.00 %</i>     | <i>3.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2019 au 31.12.2019 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 HIGH DIVIDEND I      | 8.66 %        | 8.93 %         | 5.22 %         | 1.07         | 0.53              | 0.71             | 5.10 %          | -8.45 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II     | 8.77 %        | 8.93 %         | 5.22 %         | 1.08         | 0.55              | 0.71             | 5.21 %          | -8.43 %            | 2.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III    | 8.83 %        | 8.93 %         | 5.22 %         | 1.09         | 0.56              | 0.71             | 5.26 %          | -8.41 %            | 2.00                  |
| <i>S&amp;P Dev. High Income NTR</i> | <i>5.38 %</i> | <i>11.14 %</i> | <i>-</i>       | <i>0.56</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-11.74 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2017 au 31.12.2019 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 HIGH DIVIDEND I      | 6.61 %        | 10.55 %        | 4.92 %         | 0.71         | 0.17              | 0.78             | 2.62 %          | -8.51 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II     | 6.71 %        | 10.55 %        | 4.92 %         | 0.72         | 0.19              | 0.78             | 2.73 %          | -8.45 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III    | 6.77 %        | 10.55 %        | 4.92 %         | 0.72         | 0.20              | 0.78             | 2.78 %          | -8.42 %            | 3.00                  |
| <i>S&amp;P Dev. High Income NTR</i> | <i>5.38 %</i> | <i>12.53 %</i> | <i>-</i>       | <i>0.50</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-11.74 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2015 au 31.12.2019 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 |
|-------------------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND I      | 8.40 %        | 9.35 %         | 4.12 %         | 0.99         | -0.14             | 0.80             | 1.55 %          | -8.52 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND II     | 8.50 %        | 9.35 %         | 4.12 %         | 1.00         | -0.12             | 0.80             | 1.65 %          | -8.45 %            | 3.00                  |
| ACTIONS GLOBAL HIGH DIVIDEND III    | 8.55 %        | 9.35 %         | 4.12 %         | 1.01         | -0.10             | 0.80             | 1.70 %          | -8.42 %            | 3.00                  |
| <i>S&amp;P Dev. High Income NTR</i> | <i>8.77 %</i> | <i>10.81 %</i> | <i>-</i>       | <i>0.89</i>  | <i>-</i>          | <i>-</i>         | <i>-</i>        | <i>-11.74 %</i>    | <i>4.00</i>           |

Période d'observation: 01.01.2012 au 31.12.2019 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.90 % (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)<br>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   |