

ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inforn	nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	7.87 %	11.60 %	7.17 %	0.64	-0.46	0.65	0.67 %	-7.85 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	7.94 %	11.60 %	7.17 %	0.65	-0.46	0.65	0.74 %	-7.84 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	7.98 %	11.60 %	7.17 %	0.65	-0.45	0.65	0.78 %	-7.84 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	10.81 %	17.25 %	-	0.60	-	-	-	-13.65 %	5.00
Période d'observation: 01.10.2024 au 30.09.2025 Pé	riode de base: mensuel								
3 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inforn	nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	8.72 %	10.67 %	7.29 %	0.78	-0.88	0.68	-1.97 %	-9.20 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.78 %	10.67 %	7.29 %	0.78	-0.87	0.68	-1.90 %	-9.15 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.82 %	10.67 %	7.29 %	0.79	-0.87	0.68	-1.86 %	-9.12 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	15.47 %	12.89 %	-	1.17	-	-	=	-13.65 %	5.00
Période d'observation: 01.10.2022 au 30.09.2025 Pé	riode de base: mensuel								
1 011040 4 00501 Valiotti 0111012022 44 5010512025 1 C									
5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inforn	nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
		Volatilité	Tracking Error 7.33 %	Sharpe Ratio Inform	nation Ratio -0.41	Coefficient bêta 0.70	Alpha de Jensen 0.59 %		
5 années	Rdmt			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	cumulée	récupération
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	Rdmt 8.70 %	11.79 %	7.33 %	0.70	-0.41	0.70	0.59 %	cumulée -10.49 %	récupération 18.00
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	Rdmt 8.70 % 8.77 %	11.79 % 11.80 %	7.33 % 7.33 %	0.70 0.71	-0.41 -0.40	0.70 0.70	0.59 % 0.66 %	cumulée -10.49 % -10.45 %	récupération 18.00 18.00
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II ACTIONS GLOBAL LOW VOL III MSCI World ex-CH ndr	Rdmt 8.70 % 8.77 % 8.81 %	11.79 % 11.80 % 11.80 %	7.33 % 7.33 %	0.70 0.71 0.71	-0.41 -0.40	0.70 0.70	0.59 % 0.66 % 0.70 %	cumulée -10.49 % -10.45 % -10.43 %	récupération 18.00 18.00 18.00
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II ACTIONS GLOBAL LOW VOL III MSCI World ex-CH ndr	Rdmt 8.70 % 8.77 % 8.81 % 11.35 %	11.79 % 11.80 % 11.80 %	7.33 % 7.33 %	0.70 0.71 0.71	-0.41 -0.40 -0.39	0.70 0.70	0.59 % 0.66 % 0.70 %	cumulée -10.49 % -10.45 % -10.43 %	récupération 18.00 18.00 18.00
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II ACTIONS GLOBAL LOW VOL III MSCI World ex-CH ndr Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2025 Pé	Rdmt 8.70 % 8.77 % 8.81 % 11.35 % Priode de base: mensuel	11.79 % 11.80 % 11.80 % 14.43 %	7.33 % 7.33 % 7.33 % -	0.70 0.71 0.71 <i>0.76</i>	-0.41 -0.40 -0.39	0.70 0.70 0.70	0.59 % 0.66 % 0.70 %	cumulée -10.49 % -10.45 % -10.43 % -19.42 % Perte max.	récupération 18.00 18.00 18.00 17.00 Délai de
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II ACTIONS GLOBAL LOW VOL III MSCI World ex-CH ndr Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2025 Pé	Rdmt 8.70 % 8.77 % 8.81 % 11.35 % Priode de base: mensuel Rdmt	11.79 % 11.80 % 11.80 % 14.43 % Volatilité	7.33 % 7.33 % 7.33 % - - Tracking Error	0.70 0.71 0.71 0.76 Sharpe Ratio Inform	-0.41 -0.40 -0.39 -	0.70 0.70 0.70 - Coefficient bêta	0.59 % 0.66 % 0.70 % 	cumulée -10.49 % -10.45 % -10.43 % -19.42 % Perte max. cumulée	récupération 18.00 18.00 18.00 17.00 Délai de récupération
5 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I ACTIONS GLOBAL LOW VOL II ACTIONS GLOBAL LOW VOL III MSCI World ex-CH ndr Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2025 Pé 10 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	Rdmt 8.70 % 8.77 % 8.81 % 11.35 % Friode de base: mensuel Rdmt 6.95 %	11.79 % 11.80 % 11.80 % 14.43 % Volatilité 12.07 %	7.33 % 7.33 % 7.33 % 7.33 % 	0.70 0.71 0.71 0.76 Sharpe Ratio Inform	-0.41 -0.40 -0.39 - nation Ratio -0.56	0.70 0.70 0.70 - - Coefficient bêta 0.75	0.59 % 0.66 % 0.70 % - Alpha de Jensen -0.89 %	cumulée -10.49 % -10.45 % -10.43 % -19.42 % Perte max. cumulée -23.99 %	récupération 18.00 18.00 18.00 17.00 Délai de récupération 12.00

Période d'observation: 01.10.2015 au 30.09.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.38 % (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 Inform	nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	7.87 %	11.60 %	3.87 %	0.64	1.81	0.93	7.17 %	-7.85 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	7.94 %	11.60 %	3.87 %	0.65	1.83	0.93	7.23 %	-7.84 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	7.98 %	11.60 %	3.87 %	0.65	1.84	0.93	7.27 %	-7.84 %	5.00
	0.70.0/	11 42 0/	_	0.03	_	-	_	-9.21 %	2.00
MSCI World Min Vol NR	0.73 %	11.42 %		0.03					
	ériode de base: mensuel	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inforr	nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
Période d'observation: 01.10.2024 au 30.09.2025 P	ériode de base: mensuel				nation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen 2.90 %	Perte max.	
Période d'observation: 01.10.2024 au 30.09.2025 P 3 années	ériode de base: mensuel	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inforr				Perte max. cumulée	récupération
Période d'observation: 01.10.2024 au 30.09.2025 P 3 années ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	rériode de base: mensuel Rdmt 8.72 %	Volatilité 10.67 %	Tracking Error 3.81 %	Sharpe Ratio Inform	0.80	1.05	2.90 %	Perte max. cumulée -9.20 %	récupération 5.00

5 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Inform	mation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	8.70 %	11.79 %	3.47 %	0.70	1.17	1.06	3.92 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.77 %	11.80 %	3.47 %	0.71	1.19	1.06	3.98 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.81 %	11.80 %	3.47 %	0.71	1.20	1.06	4.03 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	4.53 %	10.64 %	-	0.39	-	-	-	-11.38 %	18.00

Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2025 Période de base; mensuel

10 années	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio Infor	mation Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ACTIONS GLOBAL LOW VOL I	6.95 %	12.07 %	3.76 %	0.54	0.21	1.10	0.11 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	7.03 %	12.07 %	3.76 %	0.55	0.23	1.10	0.20 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	7.08 %	12.07 %	3.76 %	0.55	0.24	1.10	0.24 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	6.24 %	10.45 %	-	0.56	-	-	-	-16.95 %	15.00

Période d'observation: 01.10.2015 au 30.09.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.38 % (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	Rendement annuel du portefeuille – taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque 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	Rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark Indice de déviation	Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru
Coefficient bêta	Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark Variance du rendement du benchmark	Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché
Alpha de Jensen	Rendement annuel du portefeuille – taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque) – β x (rendement annuel du benchmark – taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque)	Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque
Perte relative maximale (cumulée)	Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours – valeur maximale avant la chute 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	Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle Valeur actuelle de l'obligation	Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt