



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 SUISSES 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
ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)	20
GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)	22
AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)	23
EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)	24
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)	25
IMMO OPTIMA SUISSE (IOS)	27
IMMO INVEST SUISSE (IIS)	28
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE (ISW)	29
IMMOBILIER SUISSE FOCUS (ISF)	30
GLOBAL REIT (GR)	31
MIXTA OPTIMA 15 (MO15)	32
MIXTA OPTIMA 25 (MO25)	33
MIXTA OPTIMA 35 (MO35)	35
MIXTA OPTIMA 75 (MO75)	36
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)	37
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)	38
ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)	39

IST2 Fondation d'investissement Groupes de placements

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)	40
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES (ASD)	41
MIXTA OPTIMA 30 (MOB)	42
PRETS HYPOTHECAIRES RESIDENTIELS SUISSES (WHS)	43
IMMO INVEST SUISSE 2 (IIS2)	44
GLOSSAIRE	45



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	0.44 %	0.17 %	0.19 %	2.85	2.14	0.70	0.43 %	-0.04 %	1.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.03 %	0.01 %	-	6.54	-	-	-	-0.04 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	1.13 %	0.37 %	0.35 %	3.13	0.80	0.75	0.50 %	-0.37 %	3.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.86 %	0.19 %	-	4.62	-	-	-	-0.04 %	-

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	0.49 %	0.42 %	0.32 %	1.25	0.69	1.04	0.21 %	-1.36 %	10.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.27 %	0.26 %	-	1.14	-	-	-	-1.27 %	15.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-0.01 %	0.39 %	0.30 %	0.07	0.95	0.97	0.28 %	-3.87 %	39.00
FTSE CHF Eurodep 3m	-0.30 %	0.25 %	-	-1.04	-	-	-	-5.43 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-0.31 %	3.34 %	0.07 %	-0.08	-1.14	0.99	-0.08 %	-1.63 %	1.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	-0.27 %	3.34 %	0.07 %	-0.07	-0.56	0.99	-0.04 %	-1.62 %	1.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	-0.23 %	3.34 %	0.07 %	-0.06	0.04	0.99	0.00 %	-1.61 %	1.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-0.23 %	3.34 %	-	-0.06	-	-	-	-1.63 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.42 %	3.57 %	0.12 %	1.24	0.56	1.00	0.07 %	-1.93 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	4.46 %	3.57 %	0.12 %	1.25	0.88	1.00	0.11 %	-1.92 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	4.50 %	3.57 %	0.13 %	1.27	1.20	1.00	0.15 %	-1.90 %	2.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	4.35 %	3.57 %	-	1.22	-	-	-	-1.93 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-0.68 %	4.94 %	0.19 %	-0.13	-0.19	1.01	-0.03 %	-15.11 %	36.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	-0.64 %	4.94 %	0.19 %	-0.12	0.02	1.01	0.01 %	-15.04 %	36.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	-0.60 %	4.94 %	0.19 %	-0.11	0.23	1.01	0.05 %	-14.97 %	36.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-0.64 %	4.89 %	-	-0.12	-	-	-	-14.76 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	0.18 %	4.57 %	0.16 %	0.05	-0.68	1.01	-0.12 %	-17.68 %	36.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	0.24 %	4.57 %	0.16 %	0.06	-0.32	1.01	-0.06 %	-17.53 %	36.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	0.28 %	4.57 %	0.16 %	0.07	-0.07	1.01	-0.02 %	-17.42 %	36.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	0.30 %	4.51 %	-	0.07	-	-	-	-17.17 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	0.61 %	1.82 %	0.09 %	0.36	1.55	1.01	0.14 %	-0.71 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.67 %	1.82 %	0.09 %	0.39	2.18	1.01	0.20 %	-0.70 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.71 %	1.82 %	0.09 %	0.41	2.61	1.01	0.24 %	-0.69 %	-
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.46 %</i>	<i>1.83 %</i>	<i>-</i>	<i>0.27</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-0.68 %</i>	<i>-</i>

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	3.62 %	1.97 %	0.29 %	1.84	0.41	0.98	0.18 %	-0.95 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	3.68 %	1.97 %	0.29 %	1.87	0.61	0.98	0.24 %	-0.94 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	3.72 %	1.97 %	0.29 %	1.89	0.75	0.98	0.28 %	-0.94 %	2.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>3.50 %</i>	<i>1.98 %</i>	<i>-</i>	<i>1.77</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.07 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-0.04 %	3.12 %	0.27 %	0.00	0.04	0.99	0.01 %	-11.39 %	37.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.02 %	3.12 %	0.27 %	0.02	0.26	0.99	0.07 %	-11.33 %	36.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.06 %	3.12 %	0.27 %	0.03	0.41	0.99	0.11 %	-11.29 %	32.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>-0.05 %</i>	<i>3.12 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.01</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-11.16 %</i>	<i>39.00</i>

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	0.27 %	3.28 %	0.43 %	0.09	-0.10	1.02	-0.05 %	-12.81 %	39.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.33 %	3.28 %	0.43 %	0.11	0.06	1.02	0.01 %	-12.64 %	39.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.37 %	3.28 %	0.43 %	0.12	0.15	1.02	0.05 %	-12.53 %	39.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.31 %</i>	<i>3.18 %</i>	<i>-</i>	<i>0.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>39.00</i>

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-4.51 %	5.25 %	0.20 %	-0.85	-0.50	1.01	-0.07 %	-5.85 %	-
GOVERNO BOND II	-4.46 %	5.25 %	0.20 %	-0.84	-0.21	1.01	-0.01 %	-5.80 %	-
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-4.42 %	5.00 %	-	-0.87	-	-	-	-5.79 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	-1.62 %	4.82 %	0.36 %	-0.33	-0.87	1.03	-0.28 %	-7.73 %	26.00
GOVERNO BOND II	-1.56 %	4.82 %	0.36 %	-0.31	-0.70	1.03	-0.22 %	-7.69 %	26.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-1.30 %	4.68 %	-	-0.27	-	-	-	-7.14 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-5.84 %	5.69 %	0.40 %	-1.02	-0.49	1.00	-0.16 %	-26.91 %	26.00
GOVERNO BOND II	-5.78 %	5.69 %	0.40 %	-1.01	-0.34	1.00	-0.10 %	-26.80 %	26.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-5.65 %	5.65 %	-	-0.99	-	-	-	-26.08 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-2.10 %	5.61 %	0.38 %	-0.37	-0.91	1.00	-0.34 %	-28.06 %	26.00
GOVERNO BOND II	-2.01 %	5.61 %	0.38 %	-0.35	-0.69	1.00	-0.25 %	-27.86 %	26.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-1.76 %	5.59 %	-	-0.31	-	-	-	-27.27 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-4.51 %	5.25 %	1.39 %	-0.85	1.75	0.73	0.51 %	-5.85 %	-
GOVERNO BOND II	-4.46 %	5.25 %	1.39 %	-0.84	1.79	0.73	0.57 %	-5.80 %	-
JPM GBI	-6.85 %	5.91 %	-	-1.14	-	-	-	-8.49 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	-1.62 %	4.82 %	1.41 %	-0.33	0.91	0.90	0.99 %	-7.73 %	26.00
GOVERNO BOND II	-1.56 %	4.82 %	1.41 %	-0.31	0.96	0.90	1.05 %	-7.69 %	26.00
JPM GBI	-2.90 %	5.15 %	-	-0.55	-	-	-	-10.40 %	-

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-5.84 %	5.69 %	1.54 %	-1.02	-0.01	0.99	-0.06 %	-26.91 %	26.00
GOVERNO BOND II	-5.78 %	5.69 %	1.54 %	-1.01	0.03	0.99	-0.01 %	-26.80 %	26.00
JPM GBI	-5.82 %	5.52 %	-	-1.04	-	-	-	-26.25 %	-

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-2.10 %	5.61 %	1.74 %	-0.37	-0.08	0.96	-0.20 %	-28.06 %	26.00
GOVERNO BOND II	-2.01 %	5.61 %	1.74 %	-0.35	-0.03	0.97	-0.12 %	-27.86 %	26.00
JPM GBI	-1.97 %	5.53 %	-	-0.35	-	-	-	-28.74 %	-

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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 III	-0.83 %	3.55 %	0.19 %	-0.22	-0.63	0.99	-0.12 %	-1.51 %	-
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-0.71 %	2.99 %	-	-0.22	-	-	-	-1.50 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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 III	-0.61 %	4.87 %	0.36 %	-0.12	-0.64	1.05	-0.22 %	-6.01 %	26.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-0.37 %	4.63 %	-	-0.07	-	-	-	-5.39 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 III	-4.64 %	5.45 %	0.42 %	-0.84	-0.27	1.00	-0.12 %	-22.94 %	26.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-4.53 %	5.45 %	-	-0.82	-	-	-	-22.57 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 III	-1.36 %	4.69 %	0.41 %	-0.28	-0.53	1.00	-0.22 %	-23.17 %	26.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-1.14 %	4.68 %	-	-0.24	-	-	-	-22.79 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-2.08 %	5.18 %	0.29 %	-0.39	1.06	1.02	0.35 %	-3.75 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-2.02 %	5.18 %	0.29 %	-0.38	1.26	1.02	0.41 %	-3.72 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-1.98 %	5.18 %	0.29 %	-0.37	1.40	1.02	0.45 %	-3.71 %	5.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-2.38 %	4.82 %	-	-0.48	-	-	-	-3.88 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	0.71 %	4.67 %	0.42 %	0.16	1.35	1.05	0.55 %	-6.33 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	0.77 %	4.67 %	0.42 %	0.17	1.50	1.05	0.61 %	-6.28 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	0.81 %	4.67 %	0.42 %	0.18	1.59	1.05	0.65 %	-6.26 %	5.00
<i>Bloomberg Customised</i>	0.15 %	4.43 %	-	0.04	-	-	-	-6.63 %	15.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-4.76 %	6.08 %	0.56 %	-0.77	0.26	1.04	0.33 %	-26.26 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-4.70 %	6.08 %	0.56 %	-0.76	0.37	1.04	0.39 %	-26.15 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-4.66 %	6.08 %	0.57 %	-0.76	0.44	1.04	0.43 %	-26.07 %	26.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-4.88 %	5.82 %	-	-0.83	-	-	-	-25.95 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-1.02 %	5.78 %	0.60 %	-0.17	0.22	1.04	0.16 %	-26.26 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.92 %	5.79 %	0.60 %	-0.15	0.38	1.04	0.26 %	-26.15 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.87 %	5.79 %	0.60 %	-0.14	0.46	1.04	0.31 %	-26.07 %	26.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-1.14 %	5.55 %	-	-0.20	-	-	-	-25.95 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-2.08 %	5.18 %	1.96 %	-0.39	2.55	0.61	2.14 %	-3.75 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-2.02 %	5.18 %	1.96 %	-0.38	2.58	0.61	2.20 %	-3.72 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-1.98 %	5.18 %	1.96 %	-0.37	2.60	0.61	2.24 %	-3.71 %	5.00
JPM GBI	-6.85 %	5.91 %	-	-1.14	-	-	-	-8.49 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	0.71 %	4.67 %	2.15 %	0.16	1.70	0.82	3.11 %	-6.33 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	0.77 %	4.67 %	2.15 %	0.17	1.73	0.82	3.17 %	-6.28 %	5.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	0.81 %	4.67 %	2.15 %	0.18	1.75	0.82	3.21 %	-6.26 %	5.00
JPM GBI	-2.90 %	5.15 %	-	-0.55	-	-	-	-10.40 %	-

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-4.76 %	6.08 %	3.00 %	-0.77	0.37	0.96	0.83 %	-26.26 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-4.70 %	6.08 %	3.00 %	-0.76	0.39	0.96	0.88 %	-26.15 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-4.66 %	6.08 %	3.00 %	-0.76	0.40	0.96	0.92 %	-26.07 %	26.00
JPM GBI	-5.82 %	5.52 %	-	-1.04	-	-	-	-26.25 %	-

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-1.02 %	5.78 %	3.65 %	-0.17	0.25	0.83	0.62 %	-26.26 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.92 %	5.79 %	3.65 %	-0.15	0.28	0.83	0.71 %	-26.15 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.87 %	5.79 %	3.65 %	-0.14	0.29	0.83	0.76 %	-26.07 %	26.00
JPM GBI	-1.97 %	5.53 %	-	-0.35	-	-	-	-28.74 %	-

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	0.04 %	3.23 %	0.33 %	0.02	0.71	1.04	0.24 %	-1.28 %	7.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	0.10 %	3.23 %	0.33 %	0.04	0.90	1.04	0.30 %	-1.27 %	7.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	0.14 %	3.23 %	0.33 %	0.05	1.02	1.04	0.34 %	-1.27 %	7.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-0.20 %</i>	<i>3.01 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.05</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.23 %</i>	<i>9.00</i>

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	1.12 %	4.46 %	0.50 %	0.26	0.95	0.99	0.48 %	-3.99 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	1.18 %	4.46 %	0.50 %	0.27	1.07	0.99	0.54 %	-3.95 %	2.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	1.22 %	4.46 %	0.50 %	0.28	1.15	0.99	0.58 %	-3.92 %	2.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>0.64 %</i>	<i>4.46 %</i>	<i>-</i>	<i>0.15</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-4.43 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-3.57 %	5.55 %	0.61 %	-0.63	0.20	1.00	0.12 %	-20.59 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-3.51 %	5.55 %	0.61 %	-0.62	0.29	1.00	0.17 %	-20.46 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-3.47 %	5.55 %	0.61 %	-0.62	0.36	1.00	0.21 %	-20.36 %	26.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-3.68 %</i>	<i>5.51 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.66</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>26.00</i>

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-0.53 %	4.72 %	0.63 %	-0.10	0.21	1.02	0.13 %	-20.59 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-0.43 %	4.72 %	0.62 %	-0.08	0.36	1.02	0.23 %	-20.46 %	26.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-0.38 %	4.72 %	0.62 %	-0.07	0.44	1.02	0.28 %	-20.36 %	26.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-0.65 %</i>	<i>4.60 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.13</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>26.00</i>

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	2.32 %	3.70 %	0.42 %	0.63	-0.37	1.05	-0.28 %	-1.13 %	2.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	2.48 %	3.40 %	-	0.73	-	-	-	-0.91 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	2.15 %	5.73 %	0.58 %	0.38	0.34	1.06	0.07 %	-6.47 %	2.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	1.97 %	5.39 %	-	0.37	-	-	-	-6.07 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 CORPORATES IG HEDGED CHF III	-2.77 %	6.60 %	0.53 %	-0.41	0.16	1.03	0.16 %	-21.32 %	26.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	-2.84 %	6.38 %	-	-0.44	-	-	-	-20.92 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	-2.21 %	6.50 %	0.60 %	-0.33	0.10	1.04	0.12 %	-21.32 %	26.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	-2.25 %	6.25 %	-	-0.35	-	-	-	-20.92 %	26.00

Période d'observation: 01.09.2020 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	4.65 %	6.95 %	0.59 %	0.67	0.63	0.98	0.48 %	-4.70 %	6.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	4.70 %	6.95 %	0.58 %	0.68	0.72	0.98	0.54 %	-4.68 %	6.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	4.74 %	6.96 %	0.58 %	0.68	0.79	0.98	0.58 %	-4.68 %	6.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	4.26 %	6.96 %	-	0.61	-	-	-	-4.51 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	3.70 %	5.49 %	1.28 %	0.68	-0.19	1.03	-0.38 %	-4.70 %	6.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	3.76 %	5.49 %	1.28 %	0.69	-0.14	1.03	-0.33 %	-4.68 %	6.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	3.80 %	5.49 %	1.28 %	0.70	-0.11	1.03	-0.29 %	-4.68 %	6.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	3.96 %	5.17 %	-	0.77	-	-	-	-4.51 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-1.12 %	6.68 %	1.21 %	-0.16	-0.04	1.01	-0.05 %	-17.57 %	39.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	-1.07 %	6.68 %	1.21 %	-0.15	0.00	1.01	0.01 %	-17.51 %	39.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	-1.03 %	6.68 %	1.21 %	-0.15	0.04	1.01	0.05 %	-17.46 %	39.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	-1.07 %	6.52 %	-	-0.16	-	-	-	-18.11 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	1.16 %	9.06 %	1.31 %	0.13	-0.21	1.06	-0.41 %	-21.68 %	39.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	1.23 %	9.07 %	1.32 %	0.14	-0.16	1.06	-0.34 %	-21.55 %	39.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	1.27 %	9.07 %	1.32 %	0.14	-0.13	1.06	-0.30 %	-21.46 %	39.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	1.48 %	8.49 %	-	0.18	-	-	-	-22.44 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	10.89 %	5.52 %	2.21 %	1.96	0.91	1.24	0.01 %	-3.29 %	-
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	10.95 %	5.52 %	2.21 %	1.98	0.94	1.24	0.08 %	-3.28 %	-
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	11.00 %	5.52 %	2.22 %	1.98	0.96	1.24	0.12 %	-3.27 %	-
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>8.76 %</i>	<i>6.00 %</i>	<i>-</i>	<i>1.45</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.80 %</i>	<i>-</i>

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	6.12 %	6.74 %	1.92 %	0.91	0.03	0.96	0.30 %	-7.27 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	6.18 %	6.74 %	1.92 %	0.92	0.06	0.96	0.36 %	-7.26 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	6.22 %	6.74 %	1.92 %	0.92	0.08	0.96	0.41 %	-7.25 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>6.05 %</i>	<i>6.71 %</i>	<i>-</i>	<i>0.90</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-7.66 %</i>	<i>10.00</i>

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	-0.20 %	7.42 %	1.89 %	-0.02	-0.06	0.94	-0.09 %	-21.07 %	24.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	-0.14 %	7.42 %	1.89 %	-0.01	-0.03	0.94	-0.03 %	-20.95 %	24.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	-0.10 %	7.42 %	1.89 %	-0.01	-0.01	0.94	0.01 %	-20.86 %	24.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>-0.11 %</i>	<i>7.63 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.01</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>39.00</i>

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	1.52 %	7.14 %	1.71 %	0.22	-0.23	0.93	-0.22 %	-21.07 %	24.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	1.62 %	7.14 %	1.72 %	0.23	-0.17	0.93	-0.12 %	-20.95 %	24.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	1.68 %	7.14 %	1.72 %	0.24	-0.14	0.93	-0.06 %	-20.86 %	24.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>1.88 %</i>	<i>7.50 %</i>	<i>-</i>	<i>0.25</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>39.00</i>

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



ACTIONS SUISSES 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	17.81 %	14.38 %	0.11 %	1.23	-1.71	1.00	-0.26 %	-6.29 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	17.86 %	14.38 %	0.02 %	1.23	-9.29	1.00	-0.18 %	-6.27 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	17.91 %	14.38 %	0.02 %	1.24	-6.33	1.00	-0.12 %	-6.25 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	17.95 %	14.38 %	0.02 %	1.24	-4.37	1.00	-0.09 %	-6.24 %	4.00
<i>SMI TR</i>	<i>18.03 %</i>	<i>14.38 %</i>	-	<i>1.25</i>	-	-	-	-6.21 %	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	10.55 %	10.62 %	0.06 %	0.99	-3.23	1.00	-0.23 %	-8.81 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	10.60 %	10.61 %	0.02 %	1.00	-9.44	1.00	-0.17 %	-8.79 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	10.65 %	10.61 %	0.02 %	1.00	-6.92	1.00	-0.12 %	-8.77 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	10.68 %	10.61 %	0.02 %	1.00	-4.81	1.00	-0.10 %	-8.77 %	4.00
<i>SMI TR</i>	<i>10.78 %</i>	<i>10.61 %</i>	-	<i>1.01</i>	-	-	-	-8.73 %	<i>4.00</i>

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	7.38 %	12.08 %	0.05 %	0.61	-3.96	1.00	-0.21 %	-18.09 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	7.43 %	12.08 %	0.02 %	0.62	-9.60	1.00	-0.16 %	-18.07 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	7.48 %	12.08 %	0.02 %	0.62	-7.00	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	7.49 %	12.08 %	0.02 %	0.62	-5.46	1.00	-0.10 %	-18.04 %	20.00
<i>SMI TR</i>	<i>7.59 %</i>	<i>12.08 %</i>	-	<i>0.63</i>	-	-	-	-17.98 %	<i>20.00</i>

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	7.30 %	11.77 %	0.04 %	0.62	-5.94	1.00	-0.27 %	-18.09 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	7.38 %	11.77 %	0.02 %	0.63	-9.28	1.00	-0.19 %	-18.07 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	7.44 %	11.77 %	0.02 %	0.63	-6.81	1.00	-0.13 %	-18.04 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	7.45 %	11.77 %	0.02 %	0.63	-5.95	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
<i>SMI TR</i>	<i>7.56 %</i>	<i>11.77 %</i>	-	<i>0.64</i>	-	-	-	-17.98 %	<i>20.00</i>

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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 II	19.95 %	13.51 %	1.38 %	1.47	1.32	0.94	3.26 %	-3.67 %	4.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	19.99 %	13.51 %	1.38 %	1.47	1.35	0.94	3.31 %	-3.66 %	4.00
<i>SPI</i>	17.76 %	13.67 %	-	1.29	-	-	-	-3.91 %	7.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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 II	9.92 %	9.70 %	1.22 %	1.02	0.00	0.96	0.49 %	-10.24 %	5.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	9.97 %	9.70 %	1.21 %	1.03	0.03	0.96	0.53 %	-10.22 %	5.00
<i>SPI</i>	9.88 %	10.08 %	-	0.98	-	-	-	-9.66 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 II	6.92 %	11.39 %	1.23 %	0.61	0.31	0.95	0.76 %	-18.39 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	6.96 %	11.39 %	1.23 %	0.61	0.34	0.95	0.80 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	6.45 %	11.87 %	-	0.54	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 II	7.29 %	11.19 %	1.11 %	0.65	0.05	0.97	0.33 %	-18.39 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	7.35 %	11.19 %	1.11 %	0.66	0.09	0.97	0.38 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	7.20 %	11.50 %	-	0.63	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	13.58 %	13.50 %	0.97 %	1.00	-2.96	1.04	-3.98 %	-3.76 %	3.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	13.66 %	13.50 %	0.97 %	1.01	-2.89	1.04	-3.90 %	-3.75 %	3.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	13.76 %	13.50 %	0.97 %	1.01	-2.79	1.04	-3.80 %	-3.73 %	3.00
<i>SPI EXTRA</i>	16.92 %	12.75 %	-	1.32	-	-	-	-3.35 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	6.89 %	11.28 %	1.66 %	0.61	-1.10	1.07	-2.71 %	-14.50 %	10.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	6.97 %	11.28 %	1.66 %	0.62	-1.06	1.07	-2.63 %	-14.47 %	10.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	7.06 %	11.28 %	1.66 %	0.63	-1.01	1.07	-2.54 %	-14.43 %	10.00
<i>SPI EXTRA</i>	8.95 %	10.43 %	-	0.86	-	-	-	-11.96 %	7.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.67 %	14.01 %	1.78 %	0.19	-0.52	1.06	-1.28 %	-31.29 %	39.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	2.74 %	14.01 %	1.78 %	0.20	-0.48	1.06	-1.20 %	-31.25 %	39.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	2.84 %	14.01 %	1.78 %	0.20	-0.43	1.06	-1.11 %	-31.21 %	39.00
<i>SPI EXTRA</i>	3.73 %	13.16 %	-	0.28	-	-	-	-30.06 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	7.14 %	14.07 %	2.27 %	0.51	0.07	1.03	-0.06 %	-31.29 %	39.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	7.25 %	14.07 %	2.28 %	0.52	0.11	1.03	0.04 %	-31.25 %	39.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	7.38 %	14.07 %	2.28 %	0.53	0.17	1.03	0.18 %	-31.21 %	39.00
<i>SPI EXTRA</i>	7.03 %	13.55 %	-	0.52	-	-	-	-30.06 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.76 %	16.39 %	0.12 %	0.35	1.17	1.00	0.15 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	5.81 %	16.38 %	0.04 %	0.35	4.39	1.00	0.19 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	5.88 %	16.39 %	0.04 %	0.36	6.26	1.00	0.26 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	5.90 %	16.39 %	0.04 %	0.36	6.66	1.00	0.28 %	-13.60 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	5.62 %	17.01 %	-	0.33	-	-	-	-13.65 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	15.46 %	11.12 %	0.09 %	1.39	2.23	1.00	0.22 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	15.51 %	11.13 %	0.07 %	1.39	3.63	1.00	0.26 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	15.60 %	11.13 %	0.07 %	1.40	4.71	1.00	0.34 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	15.61 %	11.13 %	0.07 %	1.40	4.93	1.00	0.36 %	-13.60 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	15.23 %	11.11 %	-	1.37	-	-	-	-13.65 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	10.02 %	13.54 %	0.09 %	0.74	1.90	1.00	0.19 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	10.06 %	13.55 %	0.08 %	0.74	2.77	1.00	0.23 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	10.14 %	13.55 %	0.08 %	0.75	3.73	1.00	0.31 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	10.16 %	13.55 %	0.08 %	0.75	3.94	1.00	0.33 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	9.83 %	13.54 %	-	0.73	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	9.89 %	14.08 %	0.09 %	0.70	2.21	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.94 %	14.08 %	0.08 %	0.71	3.03	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.01 %	14.08 %	0.08 %	0.71	3.86	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.04 %	14.08 %	0.08 %	0.71	4.19	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.68 %	14.08 %	-	0.69	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	13.98 %	14.57 %	0.12 %	0.95	0.16	1.00	0.05 %	-7.18 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	14.09 %	14.58 %	0.12 %	0.96	1.03	1.00	0.16 %	-7.16 %	2.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	13.95 %	14.85 %	-	0.93	-	-	-	-7.18 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	16.76 %	10.62 %	0.13 %	1.57	1.49	1.00	0.20 %	-8.68 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	16.88 %	10.62 %	0.13 %	1.58	2.27	1.00	0.32 %	-8.66 %	2.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	16.54 %	10.61 %	-	1.55	-	-	-	-8.79 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	9.93 %	13.42 %	0.13 %	0.74	1.23	1.00	0.16 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	10.04 %	13.42 %	0.13 %	0.75	2.01	1.00	0.27 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	9.76 %	13.40 %	-	0.73	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 HEDGED CHF II	9.74 %	13.87 %	0.13 %	0.70	1.16	1.00	0.17 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	9.85 %	13.87 %	0.13 %	0.71	1.93	1.00	0.28 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	9.57 %	13.87 %	-	0.69	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.50 %	11.10 %	8.06 %	0.49	-0.10	0.57	2.29 %	-7.85 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.56 %	11.10 %	8.06 %	0.50	-0.09	0.57	2.36 %	-7.84 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.61 %	11.10 %	8.06 %	0.50	-0.09	0.57	2.40 %	-7.84 %	7.00
MSCI World ex-CH ndr	5.62 %	17.01 %	-	0.33	-	-	-	-13.65 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	7.90 %	8.48 %	7.39 %	0.93	-0.94	0.57	-0.76 %	-7.85 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	7.97 %	8.48 %	7.39 %	0.94	-0.93	0.57	-0.70 %	-7.84 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.01 %	8.48 %	7.39 %	0.94	-0.92	0.57	-0.66 %	-7.84 %	7.00
MSCI World ex-CH ndr	15.23 %	11.11 %	-	1.37	-	-	-	-13.65 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	8.37 %	11.32 %	7.30 %	0.74	-0.26	0.70	1.46 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.43 %	11.32 %	7.30 %	0.75	-0.25	0.70	1.52 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.47 %	11.32 %	7.30 %	0.75	-0.24	0.70	1.56 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	9.83 %	13.54 %	-	0.73	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	6.41 %	11.83 %	6.39 %	0.54	-0.54	0.75	-0.84 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.49 %	11.83 %	6.39 %	0.55	-0.53	0.75	-0.76 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.54 %	11.83 %	6.39 %	0.55	-0.53	0.75	-0.71 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.68 %	14.08 %	-	0.69	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.50 %	11.10 %	4.08 %	0.49	2.22	0.90	8.54 %	-7.85 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	5.56 %	11.10 %	4.08 %	0.50	2.23	0.90	8.60 %	-7.84 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	5.61 %	11.10 %	4.09 %	0.50	2.24	0.90	8.64 %	-7.84 %	7.00
MSCI World Min Vol NR	-3.37 %	10.94 %	-	-0.30	-	-	-	-9.90 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	7.90 %	8.48 %	3.62 %	0.93	1.01	0.93	4.10 %	-7.85 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	7.97 %	8.48 %	3.62 %	0.94	1.02	0.93	4.17 %	-7.84 %	7.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.01 %	8.48 %	3.62 %	0.94	1.04	0.93	4.21 %	-7.84 %	7.00
MSCI World Min Vol NR	4.08 %	8.25 %	-	0.50	-	-	-	-9.90 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	8.37 %	11.32 %	3.49 %	0.74	1.22	1.04	4.21 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.43 %	11.32 %	3.49 %	0.75	1.24	1.04	4.28 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.47 %	11.32 %	3.49 %	0.75	1.25	1.04	4.32 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	3.99 %	10.36 %	-	0.39	-	-	-	-11.38 %	18.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	6.41 %	11.83 %	3.81 %	0.54	0.31	1.10	0.59 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.49 %	11.83 %	3.81 %	0.55	0.33	1.10	0.67 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.54 %	11.83 %	3.81 %	0.55	0.34	1.10	0.72 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	5.30 %	10.26 %	-	0.52	-	-	-	-16.95 %	15.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-2.33 %	15.06 %	2.48 %	-0.15	-2.72	0.96	-6.82 %	-15.65 %	8.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	-2.27 %	15.06 %	2.48 %	-0.15	-2.70	0.96	-6.76 %	-15.64 %	8.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	-2.24 %	15.06 %	2.48 %	-0.14	-2.69	0.96	-6.72 %	-15.63 %	8.00
MSCI AC World SC ndr	4.66 %	15.43 %	-	0.30	-	-	-	-14.46 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.80 %	13.28 %	2.33 %	0.36	-1.61	1.00	-4.00 %	-15.65 %	8.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	4.86 %	13.28 %	2.33 %	0.37	-1.59	1.00	-3.94 %	-15.64 %	8.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	4.90 %	13.28 %	2.33 %	0.37	-1.57	1.00	-3.90 %	-15.63 %	8.00
MSCI AC World SC ndr	8.84 %	13.13 %	-	0.67	-	-	-	-14.46 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	0.69 %	14.68 %	3.32 %	0.05	-1.25	0.97	-4.15 %	-29.66 %	26.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	0.75 %	14.68 %	3.32 %	0.05	-1.23	0.97	-4.09 %	-29.57 %	26.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	0.79 %	14.68 %	3.32 %	0.06	-1.22	0.97	-4.05 %	-29.50 %	26.00
MSCI AC World SC ndr	4.97 %	14.68 %	-	0.34	-	-	-	-21.61 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	4.93 %	15.12 %	3.77 %	0.33	-0.54	0.90	-1.17 %	-29.66 %	26.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	4.99 %	15.12 %	3.77 %	0.33	-0.53	0.90	-1.11 %	-29.57 %	26.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	5.05 %	15.12 %	3.77 %	0.33	-0.51	0.90	-1.05 %	-29.50 %	26.00
MSCI AC World SC ndr	6.80 %	16.43 %	-	0.41	-	-	-	-30.25 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	-6.68 %	22.70 %	2.75 %	-0.29	-1.78	0.95	-4.78 %	-21.37 %	8.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	-6.67 %	22.70 %	2.75 %	-0.29	-1.78	0.95	-4.78 %	-21.37 %	8.00
MSCI USA Small Cap TR	-1.99 %	23.82 %	-	-0.08	-	-	-	-21.39 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	5.44 %	17.48 %	2.59 %	0.31	-1.01	0.97	-2.51 %	-21.48 %	8.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	5.45 %	17.48 %	2.59 %	0.31	-1.01	0.97	-2.50 %	-21.47 %	8.00
MSCI USA Small Cap TR	8.18 %	17.79 %	-	0.46	-	-	-	-22.53 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	3.34 %	17.97 %	3.73 %	0.19	-0.46	0.97	-1.52 %	-24.91 %	13.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	3.36 %	17.97 %	3.73 %	0.19	-0.46	0.97	-1.50 %	-24.90 %	13.00
MSCI USA Small Cap TR	5.04 %	18.22 %	-	0.28	-	-	-	-22.53 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	6.25 %	17.88 %	4.13 %	0.35	-0.45	0.92	-0.98 %	-29.66 %	10.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	6.31 %	17.88 %	4.13 %	0.35	-0.43	0.92	-0.92 %	-29.64 %	10.00
MSCI USA Small Cap TR	7.90 %	19.08 %	-	0.41	-	-	-	-30.52 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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 III	1.01 %	17.36 %	5.31 %	0.06	-2.35	1.16	-16.79 %	-8.87 %	8.00
MSCI Europe Small Cap NR	15.37 %	14.69 %	-	1.11	-	-	-	-1.86 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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 III	3.37 %	13.18 %	5.12 %	0.26	-1.07	0.99	-5.82 %	-16.80 %	5.00
MSCI Europe Small Cap NR	9.31 %	12.31 %	-	0.76	-	-	-	-15.24 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 III	-4.08 %	17.25 %	6.01 %	-0.23	-1.10	1.02	-6.86 %	-46.48 %	39.00
MSCI Europe Small Cap NR	2.73 %	15.92 %	-	0.17	-	-	-	-37.72 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 III	3.55 %	17.77 %	5.74 %	0.20	-0.22	0.94	-0.86 %	-46.48 %	39.00
MSCI Europe Small Cap NR	4.68 %	17.90 %	-	0.26	-	-	-	-37.72 %	39.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	6.26 %	13.71 %	5.87 %	0.46	-1.62	0.66	-4.80 %	-8.98 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.33 %	13.71 %	5.87 %	0.46	-1.61	0.66	-4.74 %	-8.97 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.37 %	13.71 %	5.87 %	0.46	-1.61	0.66	-4.70 %	-8.96 %	5.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	16.76 %	16.84 %	-	0.99	-	-	-	-7.29 %	3.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	10.82 %	9.35 %	6.11 %	1.15	-0.04	0.66	3.83 %	-8.98 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	10.89 %	9.35 %	6.11 %	1.16	-0.03	0.66	3.90 %	-8.97 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	10.93 %	9.35 %	6.10 %	1.17	-0.02	0.66	3.94 %	-8.96 %	5.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	10.53 %	12.35 %	-	0.85	-	-	-	-10.16 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	5.61 %	11.20 %	7.36 %	0.50	0.41	0.69	4.28 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	5.68 %	11.20 %	7.36 %	0.51	0.42	0.69	4.35 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	5.72 %	11.21 %	7.36 %	0.51	0.43	0.69	4.39 %	-17.78 %	18.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	1.94 %	13.64 %	-	0.14	-	-	-	-30.69 %	38.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	5.51 %	13.18 %	6.28 %	0.42	-0.12	0.82	0.68 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	5.58 %	13.18 %	6.28 %	0.42	-0.11	0.82	0.74 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	5.62 %	13.18 %	6.28 %	0.43	-0.10	0.82	0.78 %	-32.22 %	12.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	5.91 %	14.50 %	-	0.41	-	-	-	-30.69 %	38.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	6.26 %	13.71 %	2.98 %	0.46	2.44	1.19	7.27 %	-8.98 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.33 %	13.71 %	2.98 %	0.46	2.46	1.19	7.34 %	-8.97 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.37 %	13.71 %	2.98 %	0.46	2.47	1.19	7.38 %	-8.96 %	5.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	-0.85 %	9.40 %	-	1.42	-	-	-	-7.52 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	10.82 %	9.35 %	3.47 %	1.15	1.66	1.13	5.33 %	-8.98 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	10.89 %	9.35 %	3.47 %	1.16	1.68	1.13	5.40 %	-8.97 %	5.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	10.93 %	9.35 %	3.47 %	1.17	1.69	1.13	5.44 %	-8.96 %	5.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	4.87 %	7.76 %	-	0.63	-	-	-	-7.52 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	5.61 %	11.20 %	4.47 %	0.50	0.85	1.13	3.51 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	5.68 %	11.20 %	4.47 %	0.51	0.86	1.13	3.58 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	5.72 %	11.21 %	4.47 %	0.51	0.87	1.13	3.62 %	-17.78 %	18.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	1.86 %	9.17 %	-	0.21	-	-	-	-16.39 %	24.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	5.51 %	13.18 %	5.46 %	0.42	0.40	1.17	1.45 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	5.58 %	13.18 %	5.46 %	0.42	0.41	1.17	1.51 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	5.62 %	13.18 %	5.46 %	0.43	0.42	1.17	1.55 %	-32.22 %	12.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	3.46 %	10.33 %	-	0.34	-	-	-	-23.34 %	12.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	8.86 %	9.63 %	0.65 %	0.92	-2.47	1.02	-1.97 %	-2.50 %	1.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	8.93 %	9.63 %	0.65 %	0.92	-2.37	1.02	-1.91 %	-2.49 %	1.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	8.97 %	9.63 %	0.65 %	0.93	-2.31	1.02	-1.86 %	-2.48 %	1.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>10.62 %</i>	<i>9.50 %</i>	<i>-</i>	<i>1.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.43 %</i>	<i>1.00</i>

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	11.07 %	7.83 %	0.79 %	1.41	0.14	1.02	-0.07 %	-5.87 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	11.14 %	7.83 %	0.79 %	1.42	0.21	1.02	-0.01 %	-5.84 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	11.18 %	7.83 %	0.79 %	1.42	0.26	1.02	0.04 %	-5.82 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>10.96 %</i>	<i>7.66 %</i>	<i>-</i>	<i>1.43</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.81 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	4.99 %	8.74 %	0.78 %	0.57	0.64	0.99	0.58 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	5.06 %	8.74 %	0.78 %	0.58	0.72	0.99	0.65 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	5.10 %	8.74 %	0.78 %	0.59	0.77	0.99	0.69 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>4.46 %</i>	<i>8.81 %</i>	<i>-</i>	<i>0.51</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	6.09 %	8.21 %	0.75 %	0.74	0.09	1.00	0.07 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	6.16 %	8.21 %	0.75 %	0.75	0.18	1.00	0.14 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	6.23 %	8.21 %	0.75 %	0.76	0.26	1.00	0.21 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>6.02 %</i>	<i>8.17 %</i>	<i>-</i>	<i>0.74</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.64 %	1.81 %	0.81 %	3.11	0.75	0.93	1.00 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SUISSE II	5.74 %	1.84 %	0.82 %	3.12	0.87	0.93	1.08 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SUISSE III	5.84 %	1.86 %	0.82 %	3.13	0.97	0.93	1.16 %	0.00 %	-
KGAST-Index	5.00 %	1.49 %	-	3.36	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	3.44 %	0.80 %	0.66 %	4.34	-0.24	0.80	0.55 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	3.54 %	0.80 %	0.66 %	4.46	-0.09	0.81	0.64 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	3.64 %	0.80 %	0.66 %	4.57	0.05	0.81	0.73 %	-0.08 %	1.00
KGAST-Index	3.60 %	0.58 %	-	6.27	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	4.18 %	0.88 %	0.77 %	4.79	-0.12	0.76	0.92 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	4.28 %	0.88 %	0.77 %	4.90	0.01	0.77	1.01 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	4.37 %	0.88 %	0.76 %	5.01	0.12	0.77	1.10 %	-0.08 %	1.00
KGAST-Index	4.27 %	0.59 %	-	7.31	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	4.86 %	1.01 %	0.99 %	4.81	0.08	0.57	2.16 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	4.97 %	1.02 %	0.99 %	4.91	0.19	0.57	2.26 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	5.07 %	1.01 %	0.99 %	5.01	0.28	0.57	2.36 %	-0.14 %	1.00
KGAST-Index	4.77 %	0.58 %	-	8.30	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	4.46 %	1.54 %	0.77 %	2.91	-0.67	0.96	-0.34 %	0.00 %	-
KGAST-Index	5.00 %	1.49 %	-	3.36	-	-	-	0.00 %	-
Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	3.32 %	1.18 %	1.07 %	2.82	-0.26	0.90	0.09 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	3.60 %	0.58 %	-	6.27	-	-	-	-0.02 %	1.00
Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	3.53 %	1.04 %	0.97 %	3.43	-0.74	0.69	0.57 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.27 %	0.59 %	-	7.31	-	-	-	-0.02 %	1.00
Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 RESIDENTIEL SUISSE I	3.61 %	0.98 %	0.94 %	3.72	-1.19	0.60	0.76 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.77 %	0.58 %	-	8.30	-	-	-	-0.02 %	1.00
Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel									

Taux sans risque: -0.04 % (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	4.59 %	1.79 %	1.44 %	2.56	-0.28	0.02	4.53 %	0.00 %	-
KGAST-Index	5.00 %	1.49 %	-	3.36	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.37 %	1.15 %	1.32 %	3.82	0.56	-0.15	4.97 %	0.00 %	-
KGAST-Index	3.60 %	0.58 %	-	6.27	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	4.70 %	1.53 %	1.61 %	3.07	0.25	0.15	4.08 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.27 %	0.59 %	-	7.31	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	6.24 %	3.34 %	3.22 %	1.87	0.44	1.69	-1.87 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.77 %	0.58 %	-	8.30	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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 II	-2.54 %	13.12 %	2.65 %	-0.19	-0.43	0.94	-1.15 %	-9.74 %	6.00
GPR 250 World Net CHF	-1.46 %	13.50 %	-	-0.10	-	-	-	-9.82 %	6.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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 II	0.80 %	13.30 %	2.66 %	0.06	-0.55	1.03	-1.61 %	-19.56 %	10.00
GPR 250 World Net CHF	2.33 %	12.63 %	-	0.19	-	-	-	-17.36 %	10.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 II	0.94 %	14.81 %	2.44 %	0.07	-0.16	1.01	-0.40 %	-31.46 %	26.00
GPR 250 World Net CHF	1.34 %	14.52 %	-	0.09	-	-	-	-32.15 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 II	0.18 %	16.46 %	2.51 %	0.01	-0.07	0.98	-0.12 %	-31.46 %	26.00
GPR 250 World Net CHF	0.30 %	16.52 %	-	0.02	-	-	-	-32.15 %	26.00

Période d'observation: 01.12.2017 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	3.27 %	2.33 %	0.60 %	1.41	0.57	0.90	0.66 %	-1.20 %	4.00
MIXTA OPTIMA 15 III	3.32 %	2.33 %	0.60 %	1.43	0.66	0.90	0.71 %	-1.19 %	4.00
MO15 Customised	2.91 %	2.69 %	-	1.09	-	-	-	-0.99 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.25 %	2.73 %	0.73 %	1.56	-0.80	0.96	-0.41 %	-1.78 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	4.30 %	2.73 %	0.73 %	1.58	-0.74	0.96	-0.36 %	-1.77 %	1.00
MO15 Customised	4.86 %	2.74 %	-	1.78	-	-	-	-1.32 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	1.12 %	3.72 %	0.93 %	0.31	-0.12	0.89	0.04 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.15 %	3.73 %	0.93 %	0.32	-0.09	0.89	0.07 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	1.21 %	4.08 %	-	0.31	-	-	-	-11.43 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	2.18 %	3.57 %	1.05 %	0.62	-0.13	0.92	0.04 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.20 %	3.57 %	1.05 %	0.62	-0.12	0.92	0.06 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	2.31 %	3.70 %	-	0.63	-	-	-	-11.43 %	26.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	4.49 %	3.41 %	0.55 %	1.32	-0.14	0.99	-0.02 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.56 %	3.41 %	0.55 %	1.34	-0.03	0.99	0.05 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.61 %	3.41 %	0.55 %	1.35	0.06	0.99	0.10 %	-2.05 %	4.00
MO25 Customised	4.57 %	3.72 %	-	1.23	-	-	-	-1.87 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.81 %	3.42 %	0.69 %	1.41	-1.22	0.99	-0.84 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.87 %	3.42 %	0.69 %	1.43	-1.13	0.99	-0.78 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.92 %	3.42 %	0.69 %	1.44	-1.06	0.99	-0.73 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	5.69 %	3.37 %	-	1.69	-	-	-	-2.26 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.14 %	4.53 %	0.95 %	0.48	-0.15	0.93	0.04 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.20 %	4.53 %	0.95 %	0.49	-0.09	0.93	0.10 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.25 %	4.53 %	0.95 %	0.50	-0.03	0.93	0.15 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.27 %	4.80 %	-	0.48	-	-	-	-11.81 %	24.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	3.11 %	4.63 %	1.08 %	0.68	-0.09	1.00	-0.09 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.21 %	4.63 %	1.08 %	0.70	0.00	1.00	0.00 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.26 %	4.63 %	1.08 %	0.71	0.05	1.00	0.05 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.21 %	4.51 %	-	0.72	-	-	-	-11.81 %	24.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	4.49 %	3.41 %	1.25 %	1.32	1.47	0.88	2.21 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.56 %	3.41 %	1.25 %	1.34	1.52	0.88	2.27 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.61 %	3.41 %	1.25 %	1.35	1.56	0.88	2.33 %	-2.05 %	4.00
LPP 25 (2000)	2.60 %	3.82 %	-	0.69	-	-	-	-1.97 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.81 %	3.42 %	1.56 %	1.41	-0.67	0.85	-0.17 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.87 %	3.42 %	1.56 %	1.43	-0.63	0.85	-0.11 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.92 %	3.42 %	1.56 %	1.44	-0.60	0.85	-0.05 %	-2.79 %	2.00
LPP 25 (2000)	5.88 %	3.65 %	-	1.61	-	-	-	-1.97 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.14 %	4.53 %	2.02 %	0.48	0.50	0.78	1.32 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.20 %	4.53 %	2.02 %	0.49	0.53	0.78	1.38 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.25 %	4.53 %	2.02 %	0.50	0.55	0.78	1.43 %	-11.11 %	26.00
LPP 25 (2000)	1.06 %	5.41 %	-	0.20	-	-	-	-15.55 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	3.11 %	4.63 %	1.82 %	0.68	0.44	0.87	1.14 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.21 %	4.63 %	1.82 %	0.70	0.49	0.87	1.24 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.26 %	4.63 %	1.82 %	0.71	0.52	0.87	1.29 %	-11.11 %	26.00
LPP 25 (2000)	2.26 %	4.93 %	-	0.47	-	-	-	-15.55 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.55 %	4.35 %	0.57 %	1.27	-0.08	0.95	0.26 %	-2.65 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.61 %	4.35 %	0.57 %	1.29	0.02	0.95	0.32 %	-2.64 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.66 %	4.35 %	0.57 %	1.30	0.11	0.95	0.37 %	-2.63 %	4.00
MO35 Customised	5.59 %	4.83 %	-	1.16	-	-	-	-2.75 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	5.61 %	4.14 %	0.71 %	1.36	-1.23	0.99	-0.88 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.68 %	4.14 %	0.71 %	1.37	-1.15	0.99	-0.81 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.73 %	4.14 %	0.71 %	1.38	-1.08	0.99	-0.76 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	6.55 %	4.12 %	-	1.59	-	-	-	-3.00 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.63 %	5.48 %	0.96 %	0.49	-0.28	0.94	-0.10 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.70 %	5.48 %	0.96 %	0.50	-0.22	0.94	-0.03 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.75 %	5.48 %	0.96 %	0.51	-0.17	0.94	0.02 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	2.89 %	5.73 %	-	0.51	-	-	-	-13.35 %	24.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	3.55 %	5.53 %	1.07 %	0.65	-0.27	0.99	-0.25 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.64 %	5.53 %	1.07 %	0.66	-0.19	0.99	-0.15 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.69 %	5.53 %	1.07 %	0.67	-0.14	0.99	-0.10 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.84 %	5.50 %	-	0.70	-	-	-	-13.35 %	24.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	10.28 %	8.24 %	1.04 %	1.24	-0.52	0.91	0.47 %	-4.61 %	4.00
MIXTA OPTIMA 75 III	10.33 %	8.24 %	1.04 %	1.25	-0.47	0.91	0.52 %	-4.60 %	4.00
MO75 Customised	10.83 %	9.02 %	-	1.20	-	-	-	-5.17 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	8.63 %	6.71 %	1.00 %	1.29	-1.25	0.97	-1.10 %	-6.34 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	8.68 %	6.71 %	1.00 %	1.29	-1.21	0.97	-1.04 %	-6.33 %	3.00
MO75 Customised	9.99 %	6.81 %	-	1.46	-	-	-	-5.61 %	3.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 75 II	4.96 %	8.63 %	1.32 %	0.58	-0.91	0.95	-0.93 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.99 %	8.65 %	1.22 %	0.58	-0.96	0.96	-0.92 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	6.19 %	8.97 %	-	0.69	-	-	-	-16.69 %	20.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	5.01 %	9.36 %	1.43 %	0.54	-0.64	0.93	-0.50 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.04 %	9.37 %	1.35 %	0.54	-0.65	0.94	-0.48 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.91 %	9.94 %	-	0.60	-	-	-	-16.69 %	20.00

Période d'observation: 01.12.2019 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	10.28 %	3.64 %	-	1.35	-	-	-	-1.01 %	2.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	10.31 %	3.64 %	-	1.36	-	-	-	-1.01 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	9.65 %	3.52 %	-	1.23	-	-	-	-2.80 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	9.69 %	3.52 %	-	1.24	-	-	-	-2.79 %	3.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	6.41 %	4.05 %	-	0.27	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	6.44 %	4.05 %	-	0.28	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	4.48 %	3.34 %	-	-0.25	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	4.49 %	3.34 %	-	-0.24	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 5.28 % (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	4.99 %	2.64 %	-	1.89	-	-	-	-1.38 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	5.09 %	2.64 %	-	1.93	-	-	-	-1.36 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	5.12 %	2.65 %	-	1.93	-	-	-	-1.37 %	3.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	4.74 %	3.44 %	-	1.38	-	-	-	-3.14 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	4.83 %	3.44 %	-	1.41	-	-	-	-3.13 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	4.87 %	3.44 %	-	1.42	-	-	-	-3.13 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.68 %	3.93 %	-	0.69	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	2.77 %	3.92 %	-	0.71	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	2.81 %	3.92 %	-	0.72	-	-	-	-5.35 %	8.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	1.18 %	3.30 %	-	0.37	-	-	-	-9.63 %	24.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	1.28 %	3.30 %	-	0.40	-	-	-	-9.21 %	53.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	1.32 %	3.30 %	-	0.41	-	-	-	-9.10 %	53.00

Période d'observation: 17.02.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)

Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-8.09 %	18.02 %	-	-0.44	-	-	-	-22.65 %	4.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	5.12 %	18.52 %	-	-0.01	-	-	-	-17.09 %	4.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-21.26 %	20.21 %	-	-1.05	-	-	-	-40.74 %	4.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-17.74 %	21.10 %	-	-1.09	-	-	-	-36.10 %	4.00

Période d'observation: 01.02.2024 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	19.87 %	13.51 %	1.38 %	1.46	1.28	0.94	3.19 %	-3.68 %	4.00
SPI	17.76 %	13.67 %	-	1.29	-	-	-	-3.91 %	7.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	9.85 %	9.70 %	1.21 %	1.01	-0.05	0.96	0.42 %	-10.26 %	5.00
SPI	9.88 %	10.08 %	-	0.98	-	-	-	-9.66 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	6.85 %	11.39 %	1.23 %	0.60	0.25	0.95	0.69 %	-18.43 %	28.00
SPI	6.45 %	11.87 %	-	0.54	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	7.23 %	11.18 %	1.11 %	0.65	-0.01	0.97	0.26 %	-18.43 %	28.00
SPI	7.20 %	11.50 %	-	0.63	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES (ASD)

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 STRATÉGIE DIVIDENDES II	14.62 %	12.92 %	2.70 %	1.13	-1.06	0.83	-0.19 %	-4.07 %	7.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	14.67 %	12.92 %	2.70 %	1.13	-1.04	0.83	-0.15 %	-4.07 %	7.00
<i>SPI</i>	17.76 %	13.67 %	-	1.29	-	-	-	-3.91 %	7.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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 STRATÉGIE DIVIDENDES II	8.20 %	8.17 %	3.41 %	1.00	-0.52	0.77	0.59 %	-8.02 %	7.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	8.24 %	8.17 %	3.41 %	1.01	-0.50	0.77	0.63 %	-8.00 %	7.00
<i>SPI</i>	9.88 %	10.08 %	-	0.98	-	-	-	-9.66 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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 STRATÉGIE DIVIDENDES II	5.59 %	10.38 %	3.19 %	0.54	-0.32	0.85	0.13 %	-16.86 %	28.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	5.63 %	10.38 %	3.19 %	0.54	-0.31	0.85	0.18 %	-16.84 %	28.00
<i>SPI</i>	6.45 %	11.87 %	-	0.54	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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 STRATÉGIE DIVIDENDES II	7.08 %	10.35 %	2.85 %	0.68	-0.10	0.87	0.79 %	-16.86 %	28.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	7.12 %	10.35 %	2.85 %	0.69	-0.08	0.87	0.83 %	-16.84 %	28.00
<i>SPI</i>	7.20 %	11.50 %	-	0.63	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	5.06 %	3.91 %	0.73 %	1.29	0.08	0.93	0.42 %	-2.26 %	4.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.13 %	3.91 %	0.73 %	1.31	0.17	0.93	0.48 %	-2.25 %	4.00
MO30 Customised	4.99 %	4.27 %	-	1.17	-	-	-	-2.39 %	5.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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	5.59 %	3.63 %	1.01 %	1.54	-0.79	0.84	0.24 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.66 %	3.63 %	1.01 %	1.56	-0.73	0.84	0.30 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	6.40 %	4.25 %	-	1.51	-	-	-	-3.62 %	2.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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	2.46 %	4.99 %	1.64 %	0.50	0.15	0.79	0.80 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.50 %	4.99 %	1.64 %	0.51	0.18	0.79	0.84 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	2.12 %	6.22 %	-	0.35	-	-	-	-16.11 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 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	3.18 %	5.34 %	1.47 %	0.60	-0.24	0.87	0.16 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.20 %	5.34 %	1.47 %	0.60	-0.22	0.87	0.18 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.49 %	6.00 %	-	0.59	-	-	-	-16.11 %	36.00

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



PRETS HYPOTHECAIRES RESIDENTIELS SUISSES (WHS)

Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	-0.44 %	2.76 %	0.88 %	-0.14	-0.68	0.97	-0.60 %	-1.41 %	-
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	0.16 %	3.48 %	-	0.06	-	-	-	-1.46 %	1.00

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 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
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	5.65 %	5.49 %	3.10 %	1.03	0.26	1.25	-0.43 %	-5.40 %	4.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	4.84 %	3.69 %	-	1.32	-	-	-	-1.84 %	3.00

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 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
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	-5.94 %	9.76 %	5.33 %	-0.61	-1.11	1.53	-6.21 %	-35.78 %	34.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	0.17 %	5.68 %	-	0.04	-	-	-	-14.22 %	37.00

Période d'observation: 02.11.2021 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



IMMO INVEST SUISSE 2 (IIS2)

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
IMMO INVEST SUISSE 2 III <i>Lancé le 30.05.2025</i>	5.40 %	1.86 %	-	-	-	1.34	-2.43 %	0.00 %	-
KGAST-Index	5.84 %	1.72 %	-	-	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 31.05.2025 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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	Déviati on 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	$\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$	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