



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
EUROPE INDEX SRI (EISRI)	20
ACTIONS GLOBAL LOW VOL (AGHD)	21
GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)	23
AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)	24
EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)	25
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)	26
IMMO OPTIMA SUISSE (IOS)	28
IMMO INVEST SUISSE (IIS)	29
IMMOBILIER RESIDENTIEL SUISSE (ISW)	30
IMMOBILIER SUISSE FOCUS (ISF)	31
GLOBAL REIT (GR)	32
MIXTA OPTIMA 15 (MO15)	33
MIXTA OPTIMA 25 (MO25)	34
MIXTA OPTIMA 35 (MO35)	36
MIXTA OPTIMA 75 (MO75)	37
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)	38
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)	39
ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)	40

IST2 Fondation d'investissement Groupes de placements

ACTIONS SUISSES SPI PLUS (ASPI)	41
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES (ASD)	42
MIXTA OPTIMA 30 (MOB)	43
PRETS HYPOTHECAIRES RESIDENTIELS SUISSES (WHS)	44
IMMO INVEST SUISSE 2 (IIS2)	45
GLOSSAIRE	46



MARCHE MONETAIRE CHF (GM)

Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
MARCHE MONETAIRE CHF III	1.13 %	0.19 %	0.21 %	2.45	2.79	0.83	0.57 %	0.00 %	-
FTSE CHF Eurodep 3m	0.53 %	0.03 %	-	-3.47	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	1.22 %	0.38 %	0.37 %	1.48	0.96	0.64	0.43 %	-0.37 %	3.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.86 %	0.19 %	-	1.08	-	-	-	-0.08 %	4.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	0.45 %	0.42 %	0.32 %	-0.47	0.80	0.99	0.25 %	-1.46 %	11.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.20 %	0.28 %	-	-1.62	-	-	-	-1.65 %	18.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-0.04 %	0.40 %	0.31 %	-1.73	0.96	0.97	0.27 %	-4.03 %	33.00
FTSE CHF Eurodep 3m	-0.34 %	0.25 %	-	-3.93	-	-	-	-5.88 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	2.90 %	3.77 %	0.10 %	0.73	1.17	1.00	0.11 %	-1.93 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	2.94 %	3.77 %	0.10 %	0.74	1.58	1.00	0.15 %	-1.92 %	2.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	2.98 %	3.77 %	0.10 %	0.75	2.00	1.00	0.19 %	-1.90 %	2.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>2.78 %</i>	<i>3.77 %</i>	<i>-</i>	<i>0.70</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.93 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.42 %	5.18 %	0.22 %	0.53	0.53	1.01	0.10 %	-5.89 %	11.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	3.46 %	5.18 %	0.22 %	0.54	0.71	1.01	0.14 %	-5.87 %	11.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	3.51 %	5.18 %	0.22 %	0.55	0.89	1.01	0.19 %	-5.85 %	11.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>3.30 %</i>	<i>5.14 %</i>	<i>-</i>	<i>0.51</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-6.02 %</i>	<i>11.00</i>

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-0.52 %	4.96 %	0.19 %	-0.24	-0.19	1.01	-0.03 %	-15.11 %	30.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	-0.48 %	4.96 %	0.19 %	-0.23	0.03	1.01	0.01 %	-15.04 %	30.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	-0.44 %	4.96 %	0.19 %	-0.22	0.24	1.01	0.05 %	-14.97 %	30.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>-0.48 %</i>	<i>4.91 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.23</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-14.76 %</i>	<i>30.00</i>

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	0.21 %	4.61 %	0.16 %	-0.10	-0.74	1.01	-0.12 %	-17.68 %	30.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX II	0.27 %	4.61 %	0.16 %	-0.08	-0.36	1.01	-0.06 %	-17.53 %	30.00
OBLIGATIONS SUISSES INDEX III	0.31 %	4.61 %	0.16 %	-0.07	-0.12	1.01	-0.02 %	-17.42 %	30.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	<i>0.33 %</i>	<i>4.55 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.07</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.17 %</i>	<i>30.00</i>

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.65 %	2.00 %	0.10 %	1.50	-0.06	0.98	0.06 %	-0.46 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	3.71 %	2.00 %	0.10 %	1.53	0.54	0.98	0.12 %	-0.45 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	3.75 %	2.00 %	0.10 %	1.55	0.92	0.98	0.16 %	-0.45 %	-
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>3.65 %</i>	<i>1.99 %</i>	<i>-</i>	<i>1.59</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-0.47 %</i>	<i>-</i>

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.19 %	2.96 %	0.31 %	0.85	0.25	0.99	0.11 %	-3.60 %	11.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	3.25 %	2.96 %	0.31 %	0.87	0.45	0.99	0.18 %	-3.59 %	11.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	3.29 %	2.96 %	0.31 %	0.89	0.58	0.99	0.22 %	-3.58 %	11.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>3.11 %</i>	<i>2.99 %</i>	<i>-</i>	<i>0.82</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-3.57 %</i>	<i>13.00</i>

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	0.24 %	3.12 %	0.28 %	-0.13	0.10	0.99	0.02 %	-11.39 %	33.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.30 %	3.12 %	0.28 %	-0.11	0.31	0.99	0.09 %	-11.33 %	33.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.34 %	3.12 %	0.28 %	-0.10	0.46	0.99	0.13 %	-11.29 %	32.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.22 %</i>	<i>3.13 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.14</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-11.16 %</i>	<i>33.00</i>

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	0.25 %	3.30 %	0.45 %	-0.12	-0.17	1.02	-0.08 %	-12.81 %	33.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF II	0.32 %	3.30 %	0.45 %	-0.10	-0.03	1.02	-0.01 %	-12.64 %	33.00
OBLIGATIONS ETRANGERES CHF III	0.36 %	3.30 %	0.45 %	-0.09	0.06	1.02	0.03 %	-12.53 %	33.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.34 %</i>	<i>3.21 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.10</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>33.00</i>

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-2.50 %	5.78 %	0.46 %	-0.57	-0.17	1.05	0.07 %	-5.24 %	-
GOVERNO BOND II	-2.44 %	5.78 %	0.46 %	-0.56	-0.04	1.05	0.13 %	-5.22 %	-
GOVERNO BOND III	-2.40 %	5.78 %	0.46 %	-0.55	0.05	1.05	0.17 %	-5.20 %	-
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-2.41 %	5.29 %	-	-0.58	-	-	-	-5.24 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-4.17 %	6.23 %	0.39 %	-0.77	-0.98	1.01	-0.32 %	-13.95 %	20.00
GOVERNO BOND II	-4.11 %	6.23 %	0.39 %	-0.76	-0.83	1.01	-0.27 %	-13.88 %	20.00
GOVERNO BOND III	-4.07 %	6.23 %	0.39 %	-0.76	-0.72	1.01	-0.23 %	-13.84 %	20.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-3.79 %	6.14 %	-	-0.72	-	-	-	-13.27 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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 %	5.77 %	0.39 %	-1.12	-0.50	1.00	-0.16 %	-27.02 %	20.00
GOVERNO BOND II	-5.78 %	5.77 %	0.39 %	-1.11	-0.35	1.00	-0.10 %	-26.89 %	20.00
GOVERNO BOND III	-5.74 %	5.77 %	0.39 %	-1.10	-0.25	1.00	-0.06 %	-26.80 %	20.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-5.65 %	5.73 %	-	-1.09	-	-	-	-26.46 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-1.35 %	5.88 %	0.40 %	-0.34	-0.87	1.01	-0.34 %	-28.06 %	20.00
GOVERNO BOND II	-1.27 %	5.88 %	0.40 %	-0.33	-0.65	1.01	-0.25 %	-27.86 %	20.00
GOVERNO BOND III	-1.22 %	5.88 %	0.40 %	-0.32	-0.52	1.01	-0.20 %	-27.72 %	20.00
<i>Bloomberg Global Treasuries Customised</i>	-1.01 %	5.83 %	-	-0.28	-	-	-	-27.27 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-2.50 %	5.78 %	1.56 %	-0.57	1.11	0.83	0.89 %	-5.24 %	-
GOVERNO BOND II	-2.44 %	5.78 %	1.56 %	-0.56	1.15	0.83	0.96 %	-5.22 %	-
GOVERNO BOND III	-2.40 %	5.78 %	1.56 %	-0.55	1.18	0.83	0.99 %	-5.20 %	-
JPM GBI	-4.22 %	6.22 %	-	-0.79	-	-	-	-7.60 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-4.17 %	6.23 %	1.83 %	-0.77	0.41	1.00	0.72 %	-13.95 %	20.00
GOVERNO BOND II	-4.11 %	6.23 %	1.83 %	-0.76	0.45	1.00	0.78 %	-13.88 %	20.00
GOVERNO BOND III	-4.07 %	6.23 %	1.83 %	-0.76	0.47	1.00	0.82 %	-13.84 %	20.00
JPM GBI	-4.89 %	5.95 %	-	-0.93	-	-	-	-15.14 %	-

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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 %	5.77 %	1.60 %	-1.12	0.14	0.99	0.13 %	-27.02 %	20.00
GOVERNO BOND II	-5.78 %	5.77 %	1.60 %	-1.11	0.18	0.99	0.19 %	-26.89 %	20.00
GOVERNO BOND III	-5.74 %	5.77 %	1.60 %	-1.10	0.21	0.99	0.23 %	-26.80 %	20.00
JPM GBI	-6.05 %	5.62 %	-	-1.19	-	-	-	-26.82 %	-

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-1.35 %	5.88 %	1.78 %	-0.34	-0.14	0.97	-0.29 %	-28.06 %	20.00
GOVERNO BOND II	-1.27 %	5.88 %	1.78 %	-0.33	-0.09	0.97	-0.21 %	-27.86 %	20.00
GOVERNO BOND III	-1.22 %	5.88 %	1.78 %	-0.32	-0.07	0.97	-0.16 %	-27.72 %	20.00
JPM GBI	-1.11 %	5.76 %	-	-0.30	-	-	-	-28.05 %	-

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	0.43 %	4.00 %	0.42 %	0.07	-0.26	1.06	-0.11 %	-3.04 %	3.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	0.55 %	4.05 %	-	-0.03	-	-	-	-2.83 %	3.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-2.63 %	6.30 %	0.39 %	-0.52	-0.65	1.02	-0.20 %	-12.63 %	20.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-2.38 %	6.17 %	-	-0.49	-	-	-	-12.15 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-4.36 %	5.50 %	0.42 %	-0.91	-0.27	1.00	-0.12 %	-23.17 %	20.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-4.25 %	5.50 %	-	-0.89	-	-	-	-22.79 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-1.10 %	4.75 %	0.42 %	-0.37	-0.49	1.00	-0.20 %	-23.17 %	20.00
Bloomberg Global Treasuries Customised Hedged CHF	-0.90 %	4.72 %	-	-0.33	-	-	-	-22.79 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-0.92 %	5.93 %	0.49 %	-0.32	0.65	1.07	0.44 %	-3.63 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.86 %	5.93 %	0.49 %	-0.31	0.78	1.07	0.50 %	-3.61 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.83 %	5.93 %	0.49 %	-0.30	0.86	1.07	0.54 %	-3.60 %	-
<i>Bloomberg Customised</i>	-1.23 %	5.55 %	-	-0.37	-	-	-	-3.70 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-1.34 %	6.55 %	0.42 %	-0.30	1.77	1.03	0.79 %	-10.56 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-1.28 %	6.55 %	0.42 %	-0.29	1.92	1.03	0.85 %	-10.49 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-1.24 %	6.55 %	0.42 %	-0.29	2.01	1.03	0.89 %	-10.45 %	20.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-2.05 %	6.36 %	-	-0.42	-	-	-	-11.51 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-4.09 %	6.21 %	0.60 %	-0.76	0.57	1.04	0.54 %	-26.26 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-4.03 %	6.21 %	0.61 %	-0.75	0.67	1.04	0.60 %	-26.15 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-3.99 %	6.22 %	0.61 %	-0.74	0.73	1.04	0.63 %	-26.07 %	20.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-4.40 %	5.93 %	-	-0.85	-	-	-	-25.95 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-0.53 %	5.94 %	0.62 %	-0.20	0.12	1.04	0.10 %	-26.26 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.43 %	5.95 %	0.62 %	-0.18	0.28	1.04	0.20 %	-26.15 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.38 %	5.95 %	0.62 %	-0.17	0.36	1.04	0.26 %	-26.07 %	20.00
<i>Bloomberg Customised</i>	-0.59 %	5.71 %	-	-0.22	-	-	-	-25.95 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-0.92 %	5.93 %	2.21 %	-0.32	1.50	0.71	1.90 %	-3.63 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.86 %	5.93 %	2.21 %	-0.31	1.53	0.71	1.96 %	-3.61 %	-
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.83 %	5.93 %	2.21 %	-0.30	1.55	0.71	2.00 %	-3.60 %	-
JPM GBI	-4.22 %	6.22 %	-	-0.79	-	-	-	-7.60 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-1.34 %	6.55 %	2.82 %	-0.30	1.31	0.99	3.51 %	-10.56 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-1.28 %	6.55 %	2.83 %	-0.29	1.34	0.99	3.57 %	-10.49 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-1.24 %	6.55 %	2.83 %	-0.29	1.35	0.99	3.61 %	-10.45 %	20.00
JPM GBI	-4.89 %	5.95 %	-	-0.93	-	-	-	-15.14 %	-

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-4.09 %	6.21 %	3.35 %	-0.76	0.62	0.93	1.52 %	-26.26 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-4.03 %	6.21 %	3.35 %	-0.75	0.63	0.93	1.58 %	-26.15 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-3.99 %	6.22 %	3.35 %	-0.74	0.65	0.93	1.62 %	-26.07 %	20.00
JPM GBI	-6.05 %	5.62 %	-	-1.19	-	-	-	-26.82 %	-

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-0.53 %	5.94 %	3.70 %	-0.20	0.14	0.83	0.27 %	-26.26 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES II	-0.43 %	5.95 %	3.70 %	-0.18	0.17	0.83	0.37 %	-26.15 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES III	-0.38 %	5.95 %	3.70 %	-0.17	0.18	0.83	0.42 %	-26.07 %	20.00
JPM GBI	-1.11 %	5.76 %	-	-0.30	-	-	-	-28.05 %	-

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF (OAH)

Indicateurs de risque

1 année	Rdmt	Volatilité	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Coefficient bêta	Alpha de Jensen	Perte max. cumulée	Délai de récupération
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF I	1.45 %	3.52 %	0.59 %	0.31	0.14	1.04	0.05 %	-2.14 %	3.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	1.51 %	3.52 %	0.59 %	0.33	0.24	1.04	0.11 %	-2.11 %	3.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	1.55 %	3.52 %	0.59 %	0.34	0.31	1.04	0.15 %	-2.09 %	3.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	1.37 %	3.45 %	-	0.33	-	-	-	-2.34 %	3.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-0.19 %	6.20 %	0.50 %	-0.13	1.29	0.99	0.63 %	-8.91 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-0.13 %	6.20 %	0.50 %	-0.13	1.41	0.99	0.69 %	-8.84 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-0.09 %	6.20 %	0.50 %	-0.12	1.49	0.99	0.73 %	-8.79 %	20.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	-0.83 %	6.24 %	-	-0.24	-	-	-	-10.08 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-2.92 %	5.61 %	0.63 %	-0.63	0.48	1.00	0.30 %	-20.59 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-2.86 %	5.61 %	0.64 %	-0.62	0.58	1.00	0.36 %	-20.46 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-2.82 %	5.61 %	0.64 %	-0.62	0.64	1.00	0.40 %	-20.36 %	20.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	-3.22 %	5.57 %	-	-0.69	-	-	-	-20.58 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-0.42 %	4.74 %	0.63 %	-0.23	0.15	1.02	0.11 %	-20.59 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF II	-0.32 %	4.75 %	0.63 %	-0.20	0.31	1.02	0.21 %	-20.46 %	20.00
OBLIGATIONS ETRANGERES HEDGED CHF III	-0.27 %	4.75 %	0.63 %	-0.19	0.39	1.02	0.26 %	-20.36 %	20.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	-0.52 %	4.62 %	-	-0.25	-	-	-	-20.58 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	2.44 %	4.19 %	0.38 %	0.52	-0.52	1.03	-0.28 %	-2.82 %	6.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	2.65 %	4.01 %	-	0.60	-	-	-	-2.71 %	6.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	0.79 %	7.40 %	0.58 %	0.02	0.45	1.04	0.25 %	-9.32 %	11.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	0.55 %	7.07 %	-	-0.01	-	-	-	-9.23 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-2.63 %	6.80 %	0.62 %	-0.48	0.06	1.04	0.14 %	-21.32 %	20.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	-2.65 %	6.55 %	-	-0.50	-	-	-	-20.92 %	20.00

Période d'observation: 01.09.2020 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	0.02 %	8.11 %	0.93 %	-0.13	-0.84	1.02	-0.80 %	-4.70 %	2.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	0.09 %	8.11 %	0.92 %	-0.12	-0.78	1.02	-0.74 %	-4.68 %	2.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	0.13 %	8.11 %	0.92 %	-0.12	-0.74	1.02	-0.70 %	-4.68 %	2.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	0.82 %	8.07 %	-	-0.04	-	-	-	-4.51 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	1.36 %	6.20 %	1.29 %	0.11	-0.48	1.03	-0.68 %	-4.70 %	2.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	1.42 %	6.20 %	1.29 %	0.12	-0.43	1.03	-0.61 %	-4.68 %	2.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	1.46 %	6.20 %	1.29 %	0.13	-0.40	1.03	-0.58 %	-4.68 %	2.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	2.00 %	5.90 %	-	0.23	-	-	-	-4.51 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-1.49 %	6.99 %	1.33 %	-0.31	0.10	1.02	0.16 %	-17.57 %	33.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	-1.43 %	6.99 %	1.33 %	-0.30	0.14	1.02	0.22 %	-17.51 %	33.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	-1.39 %	6.99 %	1.33 %	-0.29	0.17	1.02	0.26 %	-17.46 %	33.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	-1.61 %	6.75 %	-	-0.33	-	-	-	-18.11 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	0.04 %	9.51 %	1.32 %	-0.06	-0.30	1.05	-0.44 %	-21.68 %	33.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS II	0.11 %	9.51 %	1.32 %	-0.06	-0.25	1.05	-0.37 %	-21.55 %	33.00
OBLIGATIONS EMERGING MARKETS III	0.15 %	9.51 %	1.32 %	-0.05	-0.22	1.05	-0.33 %	-21.46 %	33.00
JPM GBI EM Glb DivUnhdg	0.49 %	8.95 %	-	-0.02	-	-	-	-22.44 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	10.42 %	5.65 %	1.25 %	1.72	-0.13	1.05	-0.70 %	-2.04 %	1.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	10.49 %	5.65 %	1.24 %	1.74	-0.08	1.05	-0.63 %	-2.04 %	1.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	10.52 %	5.65 %	1.24 %	1.74	-0.05	1.05	-0.59 %	-2.03 %	1.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>10.60 %</i>	<i>6.30 %</i>	<i>-</i>	<i>1.57</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.05 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	4.59 %	7.44 %	1.61 %	0.53	-0.47	0.94	-0.45 %	-7.27 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	4.65 %	7.43 %	1.61 %	0.54	-0.43	0.94	-0.39 %	-7.26 %	5.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	4.69 %	7.43 %	1.61 %	0.54	-0.41	0.94	-0.34 %	-7.25 %	5.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>5.34 %</i>	<i>7.77 %</i>	<i>-</i>	<i>0.60</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-7.66 %</i>	<i>10.00</i>

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	1.60 %	7.81 %	1.70 %	0.12	-0.19	0.94	-0.20 %	-21.07 %	20.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	1.66 %	7.81 %	1.70 %	0.13	-0.15	0.94	-0.14 %	-20.95 %	20.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	1.70 %	7.81 %	1.70 %	0.13	-0.13	0.94	-0.10 %	-20.86 %	20.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>1.88 %</i>	<i>8.16 %</i>	<i>-</i>	<i>0.15</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>33.00</i>

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	1.10 %	7.10 %	1.62 %	0.06	-0.25	0.92	-0.30 %	-21.07 %	20.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II	1.20 %	7.10 %	1.62 %	0.08	-0.19	0.92	-0.20 %	-20.95 %	20.00
EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III	1.26 %	7.09 %	1.62 %	0.09	-0.15	0.92	-0.14 %	-20.86 %	20.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>1.47 %</i>	<i>7.56 %</i>	<i>-</i>	<i>0.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>33.00</i>

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	2.37 %	15.53 %	0.01 %	0.08	-15.48	1.00	-0.20 %	-6.65 %	1.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	2.41 %	15.53 %	0.01 %	0.08	-12.25	1.00	-0.16 %	-6.64 %	1.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	2.46 %	15.53 %	0.01 %	0.09	-8.54	1.00	-0.11 %	-6.62 %	1.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	2.50 %	15.53 %	0.02 %	0.09	-4.08	1.00	-0.07 %	-6.60 %	1.00
SMI TR	2.57 %	15.53 %	-	0.09	-	-	-	-6.59 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.64 %	11.67 %	0.02 %	0.51	-11.33	1.00	-0.21 %	-8.81 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	6.68 %	11.67 %	0.02 %	0.51	-9.10	1.00	-0.17 %	-8.79 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	6.73 %	11.67 %	0.02 %	0.52	-6.79	1.00	-0.12 %	-8.77 %	4.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	6.75 %	11.67 %	0.02 %	0.52	-5.02	1.00	-0.10 %	-8.77 %	4.00
SMI TR	6.85 %	11.68 %	-	0.53	-	-	-	-8.73 %	4.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	6.47 %	12.81 %	0.02 %	0.45	-10.24	1.00	-0.21 %	-18.09 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	6.51 %	12.81 %	0.02 %	0.46	-7.89	1.00	-0.16 %	-18.07 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	6.56 %	12.81 %	0.02 %	0.46	-5.68	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	6.57 %	12.81 %	0.02 %	0.46	-4.81	1.00	-0.10 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	6.68 %	12.81 %	-	0.47	-	-	-	-17.98 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.19 %	12.20 %	0.03 %	0.45	-9.76	1.00	-0.27 %	-18.09 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX II	6.27 %	12.20 %	0.02 %	0.46	-9.27	1.00	-0.19 %	-18.07 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX III	6.34 %	12.20 %	0.02 %	0.46	-6.59	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
ACTIONS SUISSES SMI INDEX G	6.35 %	12.20 %	0.02 %	0.46	-5.97	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	6.46 %	12.20 %	-	0.47	-	-	-	-17.98 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.73 %	14.77 %	1.25 %	0.18	-0.17	0.92	0.11 %	-5.66 %	1.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	3.79 %	14.78 %	1.25 %	0.18	-0.12	0.92	0.17 %	-5.64 %	1.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	3.83 %	14.78 %	1.25 %	0.19	-0.09	0.92	0.21 %	-5.63 %	1.00
<i>SPI</i>	<i>3.87 %</i>	<i>14.88 %</i>	-	<i>0.18</i>	-	-	-	-6.25 %	<i>1.00</i>

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	5.74 %	10.81 %	1.12 %	0.47	-0.39	0.94	-0.05 %	-10.27 %	5.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	5.81 %	10.81 %	1.12 %	0.47	-0.34	0.94	0.01 %	-10.24 %	5.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	5.85 %	10.82 %	1.12 %	0.48	-0.30	0.94	0.05 %	-10.22 %	5.00
<i>SPI</i>	<i>6.12 %</i>	<i>11.47 %</i>	-	<i>0.48</i>	-	-	-	-9.66 %	<i>5.00</i>

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.97 %	12.07 %	1.10 %	0.44	0.03	0.96	0.33 %	-18.43 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	6.03 %	12.07 %	1.10 %	0.44	0.09	0.96	0.39 %	-18.39 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	6.08 %	12.07 %	1.10 %	0.45	0.12	0.96	0.44 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>5.86 %</i>	<i>12.56 %</i>	-	<i>0.41</i>	-	-	-	-19.93 %	<i>23.00</i>

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.28 %	11.55 %	1.09 %	0.48	-0.13	0.96	0.12 %	-18.43 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS II	6.34 %	11.55 %	1.09 %	0.49	-0.07	0.96	0.18 %	-18.39 %	28.00
ACTIONS SUISSES SPI PLUS III	6.39 %	11.55 %	1.09 %	0.50	-0.02	0.96	0.24 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>6.37 %</i>	<i>11.95 %</i>	-	<i>0.48</i>	-	-	-	-19.93 %	<i>23.00</i>

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	8.67 %	14.16 %	1.17 %	0.53	-0.84	1.02	-1.32 %	-5.46 %	1.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	8.75 %	14.16 %	1.17 %	0.54	-0.78	1.02	-1.24 %	-5.44 %	1.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	8.85 %	14.16 %	1.17 %	0.54	-0.70	1.02	-1.14 %	-5.42 %	1.00
<i>SPI EXTRA</i>	9.77 %	13.52 %	-	0.64	-	-	-	-4.97 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	5.34 %	13.95 %	1.71 %	0.33	-0.59	1.05	-1.48 %	-14.60 %	4.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	5.41 %	13.95 %	1.71 %	0.34	-0.55	1.05	-1.40 %	-14.59 %	4.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	5.50 %	13.95 %	1.72 %	0.35	-0.50	1.05	-1.31 %	-14.58 %	4.00
<i>SPI EXTRA</i>	6.50 %	13.17 %	-	0.44	-	-	-	-14.10 %	5.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.09 %	15.00 %	1.73 %	0.29	-0.24	1.05	-0.76 %	-31.29 %	33.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	5.17 %	15.00 %	1.73 %	0.30	-0.20	1.05	-0.69 %	-31.25 %	33.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	5.27 %	15.00 %	1.73 %	0.31	-0.14	1.05	-0.59 %	-31.21 %	33.00
<i>SPI EXTRA</i>	5.62 %	14.24 %	-	0.35	-	-	-	-30.06 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	7.81 %	14.35 %	2.27 %	0.50	0.18	1.02	0.24 %	-31.29 %	33.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II	7.91 %	14.35 %	2.27 %	0.50	0.22	1.02	0.34 %	-31.25 %	33.00
ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III	8.05 %	14.36 %	2.28 %	0.51	0.28	1.02	0.48 %	-31.21 %	33.00
<i>SPI EXTRA</i>	7.41 %	13.86 %	-	0.49	-	-	-	-30.06 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.18 %	19.31 %	0.04 %	0.09	3.89	1.00	0.17 %	-13.62 %	2.00
GLOBE INDEX II	3.22 %	19.31 %	0.04 %	0.09	4.79	1.00	0.22 %	-13.61 %	2.00
GLOBE INDEX III	3.30 %	19.31 %	0.05 %	0.09	6.41	1.00	0.29 %	-13.60 %	2.00
GLOBE INDEX G	3.31 %	19.31 %	0.04 %	0.09	6.77	1.00	0.31 %	-13.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	3.00 %	19.32 %	-	0.08	-	-	-	-13.65 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	11.68 %	14.57 %	0.08 %	0.75	2.69	1.00	0.25 %	-13.62 %	2.00
GLOBE INDEX II	11.72 %	14.57 %	0.08 %	0.76	3.19	1.00	0.30 %	-13.61 %	2.00
GLOBE INDEX III	11.80 %	14.57 %	0.08 %	0.76	4.08	1.00	0.38 %	-13.60 %	2.00
GLOBE INDEX G	11.82 %	14.57 %	0.08 %	0.76	4.27	1.00	0.39 %	-13.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	11.43 %	14.58 %	-	0.74	-	-	-	-13.65 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	11.01 %	14.58 %	0.08 %	0.71	2.42	1.00	0.21 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	11.06 %	14.58 %	0.08 %	0.71	2.93	1.00	0.25 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	11.14 %	14.58 %	0.08 %	0.72	3.85	1.00	0.33 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	11.16 %	14.58 %	0.08 %	0.72	4.06	1.00	0.35 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	10.80 %	14.57 %	-	0.69	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	9.22 %	14.64 %	0.08 %	0.58	2.42	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.27 %	14.64 %	0.08 %	0.59	3.05	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.34 %	14.64 %	0.08 %	0.59	3.87	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.37 %	14.64 %	0.08 %	0.59	4.21	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.01 %	14.64 %	-	0.57	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	9.69 %	16.12 %	0.13 %	0.54	0.02	1.00	0.03 %	-7.18 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	9.77 %	16.12 %	0.13 %	0.55	0.65	1.00	0.12 %	-7.17 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	9.80 %	16.12 %	0.13 %	0.55	0.82	1.00	0.14 %	-7.16 %	2.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	9.68 %	16.09 %	-	0.54	-	-	-	-7.18 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	14.01 %	14.11 %	0.13 %	0.94	1.77	1.00	0.27 %	-11.93 %	6.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	14.10 %	14.11 %	0.13 %	0.95	2.37	1.00	0.35 %	-11.92 %	6.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	14.13 %	14.11 %	0.13 %	0.95	2.53	1.00	0.38 %	-11.92 %	6.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	13.75 %	14.11 %	-	0.92	-	-	-	-11.97 %	6.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	11.99 %	14.75 %	0.13 %	0.77	1.40	1.00	0.19 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	12.04 %	14.75 %	0.13 %	0.77	1.74	1.00	0.25 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	12.10 %	14.75 %	0.13 %	0.77	2.19	1.00	0.31 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	11.79 %	14.74 %	-	0.75	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	8.52 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.21	1.00	0.19 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	8.55 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.36	1.00	0.21 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	8.62 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.91	1.00	0.29 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	8.34 %	14.34 %	-	0.53	-	-	-	-23.18 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



EUROPE INDEX SRI (EISRI)

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 INDEX SRI III	-10.68 %	19.03 %	0.10 %	-0.62	0.17	0.99	-0.05 %	-12.57 %	2.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	-10.70 %	18.53 %	-	-0.64	-	-	-	-12.62 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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 INDEX SRI III	8.56 %	14.82 %	0.08 %	0.53	-0.70	1.00	-0.03 %	-14.16 %	2.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	8.62 %	14.86 %	-	0.53	-	-	-	-14.16 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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
EUROPE INDEX SRI III	5.94 %	16.92 %	0.09 %	0.31	-0.56	1.00	-0.03 %	-28.50 %	17.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	5.98 %	16.97 %	-	0.31	-	-	-	-28.55 %	17.00

Période d'observation: 14.10.2020 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	8.03 %	13.23 %	7.17 %	0.49	0.59	0.67	5.81 %	-7.85 %	2.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.09 %	13.23 %	7.17 %	0.50	0.60	0.67	5.88 %	-7.84 %	2.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.14 %	13.23 %	7.17 %	0.50	0.61	0.67	5.92 %	-7.84 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	3.00 %	19.32 %	-	0.08	-	-	-	-13.65 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.35 %	11.64 %	7.60 %	0.49	-0.69	0.68	-1.66 %	-9.20 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.41 %	11.64 %	7.60 %	0.49	-0.68	0.68	-1.60 %	-9.15 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.46 %	11.64 %	7.60 %	0.50	-0.68	0.68	-1.55 %	-9.12 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	11.43 %	14.58 %	-	0.74	-	-	-	-13.65 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	8.39 %	11.83 %	7.39 %	0.65	-0.38	0.70	0.63 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.46 %	11.83 %	7.39 %	0.66	-0.37	0.70	0.69 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.50 %	11.83 %	7.39 %	0.66	-0.37	0.70	0.74 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	10.80 %	14.57 %	-	0.69	-	-	-	-19.42 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.31 %	12.31 %	6.36 %	0.46	-0.47	0.76	-0.68 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.39 %	12.31 %	6.36 %	0.46	-0.46	0.76	-0.60 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.44 %	12.32 %	6.36 %	0.47	-0.45	0.76	-0.55 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.01 %	14.64 %	-	0.57	-	-	-	-21.61 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	8.03 %	13.23 %	4.02 %	0.49	1.04	0.91	4.69 %	-7.85 %	2.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.09 %	13.23 %	4.02 %	0.50	1.05	0.91	4.76 %	-7.84 %	2.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.14 %	13.23 %	4.02 %	0.50	1.06	0.91	4.80 %	-7.84 %	2.00
MSCI World Min Vol NR	3.61 %	12.45 %	-	0.19	-	-	-	-9.06 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.35 %	11.64 %	3.76 %	0.49	0.62	1.07	2.11 %	-9.20 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.41 %	11.64 %	3.76 %	0.49	0.63	1.07	2.17 %	-9.15 %	5.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.46 %	11.64 %	3.76 %	0.50	0.64	1.07	2.22 %	-9.12 %	5.00
MSCI World Min Vol NR	4.01 %	10.35 %	-	0.32	-	-	-	-9.06 %	-

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	8.39 %	11.83 %	3.49 %	0.65	1.03	1.06	3.41 %	-10.49 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	8.46 %	11.83 %	3.49 %	0.66	1.04	1.06	3.47 %	-10.45 %	18.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	8.50 %	11.83 %	3.49 %	0.66	1.06	1.06	3.51 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	4.73 %	10.65 %	-	0.38	-	-	-	-11.38 %	18.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.31 %	12.31 %	3.92 %	0.46	0.01	1.10	-0.63 %	-23.99 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL II	6.39 %	12.31 %	3.92 %	0.46	0.03	1.10	-0.54 %	-23.97 %	12.00
ACTIONS GLOBAL LOW VOL III	6.44 %	12.32 %	3.92 %	0.47	0.05	1.10	-0.50 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	6.38 %	10.68 %	-	0.53	-	-	-	-16.95 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-2.67 %	18.51 %	2.03 %	-0.18	-1.61	0.99	-3.28 %	-15.65 %	2.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	-2.61 %	18.51 %	2.03 %	-0.18	-1.58	0.99	-3.22 %	-15.64 %	2.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	-2.57 %	18.51 %	2.03 %	-0.18	-1.57	0.99	-3.18 %	-15.63 %	2.00
MSCI AC World SC ndr	0.60 %	18.23 %	-	-0.01	-	-	-	-14.46 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	2.69 %	16.02 %	2.07 %	0.13	-1.40	0.99	-2.95 %	-15.65 %	2.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	2.75 %	16.02 %	2.07 %	0.13	-1.37	0.99	-2.89 %	-15.64 %	2.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	2.79 %	16.02 %	2.07 %	0.13	-1.35	0.99	-2.85 %	-15.63 %	2.00
MSCI AC World SC ndr	5.70 %	16.06 %	-	0.31	-	-	-	-14.46 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	3.40 %	15.47 %	3.56 %	0.18	-1.12	0.94	-3.74 %	-29.66 %	20.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	3.47 %	15.47 %	3.56 %	0.18	-1.10	0.94	-3.68 %	-29.57 %	20.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	3.51 %	15.47 %	3.56 %	0.18	-1.09	0.94	-3.63 %	-29.50 %	20.00
MSCI AC World SC ndr	7.52 %	15.96 %	-	0.43	-	-	-	-21.61 %	26.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	4.62 %	15.55 %	3.77 %	0.25	-0.35	0.90	-0.61 %	-29.66 %	20.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	4.68 %	15.55 %	3.77 %	0.26	-0.34	0.90	-0.56 %	-29.57 %	20.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	4.75 %	15.55 %	3.77 %	0.26	-0.32	0.90	-0.49 %	-29.50 %	20.00
MSCI AC World SC ndr	5.72 %	16.79 %	-	0.30	-	-	-	-30.25 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-4.10 %	25.79 %	2.74 %	-0.17	-0.57	0.93	-1.48 %	-21.48 %	2.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	-4.10 %	25.79 %	2.74 %	-0.17	-0.57	0.93	-1.47 %	-21.47 %	2.00
MSCI USA Small Cap TR	-2.88 %	26.32 %	-	-0.12	-	-	-	-22.53 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.17 %	20.49 %	2.27 %	0.12	-0.64	0.97	-1.31 %	-21.48 %	2.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	3.18 %	20.49 %	2.27 %	0.12	-0.64	0.97	-1.30 %	-21.47 %	2.00
MSCI USA Small Cap TR	4.58 %	20.90 %	-	0.19	-	-	-	-22.53 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.75 %	18.53 %	4.10 %	0.27	-0.47	0.94	-1.39 %	-24.91 %	13.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	5.76 %	18.53 %	4.10 %	0.27	-0.47	0.94	-1.38 %	-24.90 %	13.00
MSCI USA Small Cap TR	7.57 %	19.33 %	-	0.36	-	-	-	-22.53 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	5.64 %	18.34 %	4.12 %	0.27	-0.30	0.92	-0.52 %	-29.66 %	10.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	5.70 %	18.34 %	4.12 %	0.27	-0.29	0.92	-0.46 %	-29.64 %	10.00
MSCI USA Small Cap TR	6.63 %	19.48 %	-	0.31	-	-	-	-30.52 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	2.15 %	19.97 %	5.77 %	0.03	-1.07	1.01	-6.77 %	-8.87 %	2.00
MSCI Europe Small Cap NR	8.81 %	15.92 %	-	0.70	-	-	-	-5.78 %	7.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.07 %	17.30 %	5.08 %	0.14	-0.86	1.00	-4.67 %	-19.30 %	18.00
MSCI Europe Small Cap NR	7.77 %	16.60 %	-	0.43	-	-	-	-17.70 %	4.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	0.96 %	18.60 %	6.31 %	0.02	-0.87	0.97	-5.60 %	-46.48 %	33.00
MSCI Europe Small Cap NR	6.74 %	18.04 %	-	0.34	-	-	-	-37.72 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	4.79 %	17.96 %	5.66 %	0.23	-0.07	0.94	0.03 %	-46.48 %	33.00
MSCI Europe Small Cap NR	5.01 %	18.16 %	-	0.24	-	-	-	-37.72 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	1.54 %	15.68 %	5.21 %	0.02	-0.15	0.83	-0.33 %	-8.98 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	1.60 %	15.68 %	5.21 %	0.02	-0.14	0.83	-0.27 %	-8.97 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	1.64 %	15.68 %	5.21 %	0.02	-0.13	0.83	-0.23 %	-8.96 %	2.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	2.12 %	18.41 %	-	0.04	-	-	-	-7.29 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.34 %	11.01 %	7.16 %	0.51	0.34	0.67	4.02 %	-8.98 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.41 %	11.01 %	7.16 %	0.52	0.34	0.67	4.09 %	-8.97 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.45 %	11.01 %	7.16 %	0.52	0.35	0.67	4.13 %	-8.96 %	2.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	3.16 %	14.48 %	-	0.17	-	-	-	-12.29 %	17.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	6.69 %	11.66 %	7.19 %	0.52	0.41	0.72	4.24 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.76 %	11.66 %	7.19 %	0.52	0.41	0.72	4.30 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.80 %	11.66 %	7.19 %	0.53	0.42	0.72	4.34 %	-17.78 %	18.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	3.15 %	13.73 %	-	0.18	-	-	-	-30.69 %	32.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.50 %	13.83 %	6.28 %	0.21	0.00	0.84	0.74 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.57 %	13.83 %	6.28 %	0.21	0.01	0.84	0.81 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.61 %	13.83 %	6.28 %	0.21	0.02	0.84	0.85 %	-32.22 %	12.00
MSCI Emerging Markets Net Total Return	3.15 %	14.88 %	-	0.17	-	-	-	-30.69 %	32.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	1.54 %	15.68 %	3.84 %	0.02	0.32	1.25	1.11 %	-8.98 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	1.60 %	15.68 %	3.84 %	0.02	0.33	1.25	1.17 %	-8.97 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	1.64 %	15.68 %	3.84 %	0.02	0.34	1.25	1.21 %	-8.96 %	2.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	0.47 %	10.11 %	-	1.23	-	-	-	-7.52 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.34 %	11.01 %	3.93 %	0.51	1.20	1.14	4.51 %	-8.98 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.41 %	11.01 %	3.93 %	0.52	1.21	1.14	4.57 %	-8.97 %	2.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.45 %	11.01 %	3.93 %	0.52	1.22	1.14	4.62 %	-8.96 %	2.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	1.69 %	9.10 %	-	0.11	-	-	-	-9.70 %	6.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	6.69 %	11.66 %	4.97 %	0.52	0.68	1.12	3.05 %	-17.88 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	6.76 %	11.66 %	4.97 %	0.52	0.69	1.12	3.11 %	-17.82 %	18.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	6.80 %	11.66 %	4.97 %	0.53	0.70	1.12	3.15 %	-17.78 %	18.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	3.33 %	9.47 %	-	0.28	-	-	-	-16.39 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.50 %	13.83 %	5.67 %	0.21	0.27	1.17	1.08 %	-32.38 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.57 %	13.83 %	5.67 %	0.21	0.28	1.17	1.15 %	-32.28 %	12.00
ACTIONS EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.61 %	13.83 %	5.67 %	0.21	0.29	1.17	1.19 %	-32.22 %	12.00
MSCI Emerging Market Low Volatility Index	2.16 %	10.87 %	-	0.14	-	-	-	-23.34 %	12.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	14.97 %	10.24 %	0.80 %	1.27	-0.71	1.03	-1.09 %	-2.50 %	1.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	15.04 %	10.24 %	0.80 %	1.27	-0.63	1.03	-1.02 %	-2.49 %	1.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	15.08 %	10.24 %	0.80 %	1.28	-0.58	1.03	-0.97 %	-2.48 %	1.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>15.63 %</i>	<i>10.12 %</i>	<i>-</i>	<i>1.33</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.43 %</i>	<i>1.00</i>

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	8.88 %	8.43 %	0.83 %	0.97	0.67	1.01	0.47 %	-6.77 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	8.94 %	8.43 %	0.83 %	0.98	0.75	1.01	0.54 %	-6.70 %	2.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	8.99 %	8.43 %	0.83 %	0.99	0.80	1.01	0.58 %	-6.65 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>8.29 %</i>	<i>8.26 %</i>	<i>-</i>	<i>0.92</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-7.65 %</i>	<i>2.00</i>

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	6.16 %	9.25 %	0.76 %	0.59	0.80	0.99	0.72 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	6.22 %	9.25 %	0.76 %	0.60	0.88	0.99	0.78 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	6.27 %	9.25 %	0.76 %	0.60	0.94	0.99	0.83 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.50 %</i>	<i>9.34 %</i>	<i>-</i>	<i>0.52</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	5.55 %	8.33 %	0.74 %	0.59	0.18	1.00	0.14 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE II	5.63 %	8.33 %	0.74 %	0.59	0.28	1.00	0.22 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SUISSE III	5.70 %	8.33 %	0.74 %	0.60	0.37	1.00	0.29 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.41 %</i>	<i>8.29 %</i>	<i>-</i>	<i>0.57</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	4.29 %	1.30 %	0.68 %	2.80	-0.11	0.02	3.58 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SUISSE II	4.40 %	1.32 %	0.68 %	2.82	0.04	0.02	3.67 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SUISSE III	4.49 %	1.35 %	0.68 %	2.84	0.17	0.02	3.77 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.61 %	1.37 %	0.68 %	2.87	0.33	0.02	3.87 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.37 %	1.28 %	-	2.90	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.03 %	0.64 %	0.68 %	3.73	-0.65	0.37	1.33 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	3.13 %	0.64 %	0.68 %	3.89	-0.50	0.37	1.43 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	3.23 %	0.63 %	0.68 %	4.04	-0.37	0.37	1.52 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.34 %	0.63 %	0.68 %	4.21	-0.21	0.37	1.63 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	3.49 %	0.48 %	-	5.82	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	4.02 %	0.81 %	0.75 %	4.13	-0.25	0.65	1.06 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	4.12 %	0.81 %	0.75 %	4.26	-0.12	0.65	1.15 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	4.22 %	0.81 %	0.75 %	4.38	0.00	0.65	1.25 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.33 %	0.81 %	0.75 %	4.52	0.15	0.65	1.36 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.22 %	0.57 %	-	6.20	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	4.93 %	1.05 %	1.00 %	4.04	0.11	0.66	1.54 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE II	5.04 %	1.06 %	1.00 %	4.13	0.21	0.66	1.65 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SUISSE III	5.14 %	1.06 %	1.00 %	4.23	0.30	0.66	1.75 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.25 %	1.06 %	1.00 %	4.34	0.41	0.66	1.87 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.82 %	0.60 %	-	6.94	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.65 %	1.04 %	0.51 %	2.86	-1.36	-0.04	3.16 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.37 %	1.28 %	-	2.90	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.02 %	1.04 %	1.00 %	2.27	-0.45	0.69	0.41 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	3.49 %	0.48 %	-	5.82	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	3.40 %	0.97 %	0.94 %	2.83	-0.84	0.57	0.73 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.22 %	0.57 %	-	6.20	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.70 %	1.16 %	1.11 %	2.61	-0.96	0.66	0.32 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.82 %	0.60 %	-	6.94	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	4.08 %	1.47 %	1.06 %	2.33	-0.27	0.02	3.37 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.37 %	1.28 %	-	2.90	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	4.22 %	1.07 %	1.25 %	3.33	0.56	-0.42	4.75 %	0.00 %	-
KGAST-Index	3.49 %	0.48 %	-	5.82	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	4.92 %	1.70 %	1.73 %	2.50	0.39	0.36	2.99 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.22 %	0.57 %	-	6.20	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.87 %	3.95 %	3.80 %	1.57	0.52	2.17	-2.80 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.82 %	0.60 %	-	6.94	-	-	-	-0.02 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-5.51 %	15.20 %	2.72 %	-0.41	-2.05	0.90	-5.50 %	-11.82 %	-
GPR 250 World Net CHF	-0.08 %	15.31 %	-	-0.04	-	-	-	-9.82 %	-

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-3.37 %	15.90 %	2.54 %	-0.25	-0.50	1.02	-1.24 %	-24.88 %	20.00
GPR 250 World Net CHF	-2.06 %	15.37 %	-	-0.18	-	-	-	-24.23 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	1.24 %	15.36 %	2.47 %	0.04	-0.36	0.99	-0.86 %	-31.46 %	20.00
GPR 250 World Net CHF	2.11 %	15.31 %	-	0.09	-	-	-	-32.15 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	-0.42 %	16.86 %	2.51 %	-0.06	-0.11	0.98	-0.24 %	-31.46 %	20.00
GPR 250 World Net CHF	-0.19 %	16.93 %	-	-0.05	-	-	-	-32.15 %	20.00

Période d'observation: 01.12.2017 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.39 %	2.68 %	0.63 %	1.03	0.18	0.98	0.17 %	-1.20 %	2.00
MIXTA OPTIMA 15 III	3.44 %	2.68 %	0.63 %	1.05	0.26	0.98	0.23 %	-1.19 %	2.00
MO15 Customised	3.28 %	3.06 %	-	0.89	-	-	-	-0.99 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	2.95 %	3.94 %	0.97 %	0.58	-0.59	0.90	-0.27 %	-4.55 %	15.00
MIXTA OPTIMA 15 III	3.00 %	3.94 %	0.97 %	0.59	-0.54	0.90	-0.23 %	-4.55 %	15.00
MO15 Customised	3.52 %	4.28 %	-	0.67	-	-	-	-4.73 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	1.44 %	3.84 %	0.95 %	0.20	0.02	0.90	0.11 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.47 %	3.85 %	0.95 %	0.21	0.05	0.90	0.14 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	1.40 %	4.16 %	-	0.18	-	-	-	-11.43 %	26.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	2.08 %	3.68 %	1.07 %	0.39	-0.20	0.93	-0.09 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.09 %	3.68 %	1.07 %	0.39	-0.19	0.93	-0.07 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	2.29 %	3.82 %	-	0.43	-	-	-	-11.43 %	26.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.58 %	4.00 %	0.48 %	0.71	0.18	1.02	0.02 %	-2.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.64 %	4.00 %	0.48 %	0.72	0.31	1.02	0.08 %	-2.06 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.69 %	4.00 %	0.48 %	0.74	0.42	1.02	0.14 %	-2.05 %	2.00
MO25 Customised	3.49 %	4.25 %	-	0.67	-	-	-	-1.87 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.33 %	4.67 %	0.92 %	0.57	-0.76	0.92	-0.43 %	-4.84 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.68 %	0.92 %	0.58	-0.70	0.92	-0.37 %	-4.83 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.45 %	4.68 %	0.92 %	0.60	-0.64	0.92	-0.32 %	-4.82 %	15.00
MO25 Customised	4.04 %	5.01 %	-	0.67	-	-	-	-5.22 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	2.47 %	4.76 %	0.95 %	0.38	0.02	0.93	0.16 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.53 %	4.76 %	0.95 %	0.39	0.09	0.93	0.22 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.59 %	4.76 %	0.95 %	0.40	0.14	0.93	0.27 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.43 %	5.01 %	-	0.35	-	-	-	-11.81 %	24.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.04 %	4.82 %	1.13 %	0.49	0.00	1.00	0.01 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.14 %	4.82 %	1.13 %	0.51	0.09	1.00	0.10 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.19 %	4.82 %	1.13 %	0.52	0.13	1.00	0.16 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.03 %	4.69 %	-	0.51	-	-	-	-11.81 %	24.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.58 %	4.00 %	1.29 %	0.71	0.58	0.92	0.96 %	-2.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.64 %	4.00 %	1.29 %	0.72	0.62	0.92	1.02 %	-2.06 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.69 %	4.00 %	1.29 %	0.74	0.66	0.92	1.07 %	-2.05 %	2.00
LPP 25 (2000)	2.80 %	4.40 %	-	0.50	-	-	-	-1.97 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.33 %	4.67 %	2.02 %	0.57	-0.37	0.77	0.07 %	-4.84 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.68 %	2.02 %	0.58	-0.34	0.77	0.14 %	-4.83 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.45 %	4.68 %	2.02 %	0.60	-0.31	0.77	0.19 %	-4.82 %	15.00
LPP 25 (2000)	4.03 %	5.72 %	-	0.59	-	-	-	-6.44 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	2.47 %	4.76 %	2.02 %	0.38	0.52	0.80	1.26 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.53 %	4.76 %	2.02 %	0.39	0.55	0.80	1.33 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.59 %	4.76 %	2.02 %	0.40	0.58	0.80	1.38 %	-11.11 %	26.00
LPP 25 (2000)	1.34 %	5.54 %	-	0.12	-	-	-	-15.55 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.04 %	4.82 %	1.83 %	0.49	0.44	0.88	1.03 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.14 %	4.82 %	1.83 %	0.51	0.49	0.88	1.13 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.19 %	4.82 %	1.83 %	0.52	0.52	0.88	1.18 %	-11.11 %	26.00
LPP 25 (2000)	2.18 %	5.09 %	-	0.30	-	-	-	-15.55 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.93 %	5.13 %	0.42 %	0.60	0.94	0.99	0.42 %	-2.65 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.99 %	5.13 %	0.42 %	0.62	1.09	0.99	0.49 %	-2.64 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.05 %	5.13 %	0.42 %	0.63	1.21	0.99	0.54 %	-2.63 %	2.00
MO35 Customised	3.53 %	5.54 %	-	0.50	-	-	-	-2.75 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	3.87 %	5.59 %	0.95 %	0.57	-0.72	0.93	-0.41 %	-5.58 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.93 %	5.59 %	0.95 %	0.58	-0.66	0.93	-0.35 %	-5.57 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.98 %	5.59 %	0.95 %	0.59	-0.60	0.93	-0.30 %	-5.56 %	15.00
MO35 Customised	4.56 %	5.94 %	-	0.65	-	-	-	-5.96 %	10.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	2.97 %	5.81 %	0.95 %	0.40	-0.11	0.95	0.03 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.04 %	5.81 %	0.96 %	0.41	-0.04	0.95	0.10 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.09 %	5.81 %	0.96 %	0.42	0.01	0.95	0.15 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.06 %	6.04 %	-	0.40	-	-	-	-13.35 %	24.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	3.36 %	5.77 %	1.08 %	0.47	-0.29	0.99	-0.27 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.46 %	5.77 %	1.08 %	0.48	-0.20	0.99	-0.18 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.51 %	5.77 %	1.08 %	0.49	-0.15	0.99	-0.12 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.67 %	5.74 %	-	0.52	-	-	-	-13.35 %	24.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	4.73 %	9.66 %	0.94 %	0.38	0.86	0.95	1.03 %	-4.61 %	2.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.79 %	9.66 %	0.94 %	0.38	0.91	0.95	1.08 %	-4.60 %	2.00
MO75 Customised	3.88 %	10.29 %	-	0.27	-	-	-	-5.17 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	6.22 %	8.59 %	1.19 %	0.65	-0.51	0.94	-0.24 %	-7.37 %	4.00
MIXTA OPTIMA 75 III	6.28 %	8.59 %	1.19 %	0.65	-0.47	0.94	-0.19 %	-7.36 %	4.00
MO75 Customised	6.83 %	9.06 %	-	0.68	-	-	-	-7.90 %	7.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.32 %	9.18 %	1.43 %	0.51	-0.61	0.94	-0.53 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.35 %	9.19 %	1.33 %	0.51	-0.63	0.94	-0.52 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	6.18 %	9.66 %	-	0.57	-	-	-	-16.69 %	20.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	4.20 %	9.74 %	1.47 %	0.36	-0.54	0.93	-0.46 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.23 %	9.75 %	1.38 %	0.37	-0.55	0.94	-0.45 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	4.95 %	10.33 %	-	0.41	-	-	-	-16.69 %	20.00

Période d'observation: 01.12.2019 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	12.10 %	4.75 %	-	-	-	-	-	-1.01 %	2.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	12.12 %	4.75 %	-	-	-	-	-	-1.01 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	7.22 %	-	-	-	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	7.25 %	-	-	-	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.59 %	4.09 %	-	0.17	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	5.62 %	4.09 %	-	0.18	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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 USD III	3.87 %	3.36 %	-	-0.32	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	3.88 %	3.36 %	-	-0.31	-	-	-	-5.05 %	4.00

Période d'observation: 01.12.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 4.95 % (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	7.10 %	3.70 %	-	-	-	-	-	-1.38 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	7.18 %	3.70 %	-	-	-	-	-	-1.36 %	3.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	7.22 %	3.72 %	-	-	-	-	-	-1.37 %	3.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	2.76 %	-	-	-	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	2.84 %	-	-	-	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	2.88 %	-	-	-	-	-	-	-5.35 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	2.33 %	4.00 %	-	0.43	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	2.41 %	4.00 %	-	0.45	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	2.45 %	4.00 %	-	0.46	-	-	-	-5.35 %	8.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	0.76 %	3.36 %	-	0.03	-	-	-	-9.63 %	24.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.85 %	3.35 %	-	0.06	-	-	-	-9.21 %	53.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.90 %	3.36 %	-	0.08	-	-	-	-9.10 %	53.00

Période d'observation: 17.02.2016 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	-27.03 %	23.18 %	-	-	-	-	-	-29.43 %	5.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-20.19 %	23.55 %	-	-	-	-	-	-30.02 %	5.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	-21.36 %	20.40 %	-	-1.13	-	-	-	-31.19 %	5.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-18.68 %	20.84 %	-	-1.18	-	-	-	-34.58 %	5.00

Période d'observation: 01.02.2024 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.73 %	14.77 %	1.25 %	0.18	-0.17	0.92	0.11 %	-5.66 %	1.00
SPI	3.87 %	14.88 %	-	0.18	-	-	-	-6.25 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	5.74 %	10.81 %	1.12 %	0.47	-0.39	0.94	-0.05 %	-10.26 %	5.00
SPI	6.12 %	11.47 %	-	0.48	-	-	-	-9.66 %	5.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.97 %	12.06 %	1.11 %	0.44	0.03	0.96	0.33 %	-18.43 %	28.00
SPI	5.86 %	12.56 %	-	0.41	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	6.28 %	11.55 %	1.09 %	0.49	-0.13	0.96	0.12 %	-18.43 %	28.00
SPI	6.37 %	11.95 %	-	0.48	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	7.56 %	13.66 %	2.96 %	0.47	1.14	0.82	4.27 %	-4.07 %	2.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	7.60 %	13.66 %	2.96 %	0.47	1.15	0.82	4.32 %	-4.07 %	2.00
<i>SPI</i>	3.87 %	14.88 %	-	0.18	-	-	-	-6.25 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	5.62 %	9.17 %	3.59 %	0.54	-0.21	0.77	0.75 %	-8.02 %	7.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	5.66 %	9.17 %	3.59 %	0.54	-0.20	0.77	0.79 %	-8.00 %	7.00
<i>SPI</i>	6.12 %	11.47 %	-	0.48	-	-	-	-9.66 %	5.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	5.41 %	11.16 %	3.17 %	0.42	-0.20	0.86	0.26 %	-16.86 %	28.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	5.45 %	11.16 %	3.17 %	0.43	-0.19	0.86	0.30 %	-16.84 %	28.00
<i>SPI</i>	5.86 %	12.56 %	-	0.41	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	7.04 %	10.75 %	2.91 %	0.59	0.16	0.87	1.38 %	-16.86 %	28.00
ACTIONS SUISSES STRATÉGIE DIVIDENDES III	7.08 %	10.75 %	2.91 %	0.60	0.17	0.87	1.42 %	-16.84 %	28.00
<i>SPI</i>	6.37 %	11.95 %	-	0.48	-	-	-	-19.93 %	23.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	3.99 %	4.60 %	0.66 %	0.68	0.81	0.91	0.80 %	-2.26 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	4.05 %	4.60 %	0.66 %	0.69	0.90	0.91	0.86 %	-2.25 %	2.00
MO30 Customised	3.43 %	4.94 %	-	0.55	-	-	-	-2.39 %	2.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	4.01 %	4.88 %	1.65 %	0.68	-0.24	0.77	0.50 %	-4.86 %	10.00
MIXTA OPTIMA 30 II	4.07 %	4.88 %	1.65 %	0.70	-0.20	0.77	0.57 %	-4.85 %	9.00
MO30 Customised	4.33 %	6.20 %	-	0.59	-	-	-	-6.81 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	2.93 %	5.36 %	1.66 %	0.42	0.16	0.80	0.74 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.97 %	5.36 %	1.66 %	0.43	0.18	0.80	0.78 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	2.58 %	6.59 %	-	0.29	-	-	-	-16.11 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2020 au 30.06.2025 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	2.96 %	5.59 %	1.49 %	0.41	-0.30	0.87	-0.06 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.98 %	5.59 %	1.49 %	0.42	-0.28	0.87	-0.04 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.36 %	6.23 %	-	0.43	-	-	-	-16.11 %	33.00

Période d'observation: 01.07.2015 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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	5.06 %	3.72 %	1.11 %	1.18	0.96	1.07	0.86 %	-1.90 %	1.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	3.97 %	3.87 %	-	1.00	-	-	-	-1.60 %	1.00

Période d'observation: 01.07.2024 au 30.06.2025 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	2.15 %	8.41 %	3.88 %	0.18	-0.36	1.35	-2.61 %	-15.00 %	19.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	3.70 %	5.73 %	-	0.53	-	-	-	-6.61 %	15.00

Période d'observation: 01.07.2022 au 30.06.2025 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	-6.64 %	10.38 %	5.67 %	-0.71	-1.14	1.55	-6.37 %	-35.78 %	28.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	0.05 %	6.01 %	-	-0.10	-	-	-	-14.22 %	33.00

Période d'observation: 02.11.2021 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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 G <i>Lancé le 30.05.2025</i>	0.76 %	0.23 %	-	-	-	-	-	0.00 %	-
KGAST-Index	5.28 %	1.54 %	-	-	-	-	-	0.00 %	-

Période d'observation: 31.05.2025 au 30.06.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.65 % (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