



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 | 1.40 % | 11.20 % | 1.19 % | 0.01 | -0.77 | 1.01 | -0.94 % | -5.46 % | 1.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II | 1.47 % | 11.20 % | 1.19 % | 0.02 | -0.71 | 1.01 | -0.87 % | -5.44 % | 1.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III | 1.56 % | 11.20 % | 1.19 % | 0.02 | -0.63 | 1.01 | -0.78 % | -5.42 % | 1.00 |
| <i>SPI EXTRA</i> | <i>2.34 %</i> | <i>10.49 %</i> | - | <i>0.10</i> | - | - | - | <i>-4.97 %</i> | <i>1.00</i> |

Période d'observation: 01.04.2024 au 31.03.2025 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 | -2.51 % | 14.78 % | 1.76 % | -0.26 | -0.70 | 1.05 | -1.18 % | -22.67 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II | -2.44 % | 14.78 % | 1.76 % | -0.25 | -0.66 | 1.05 | -1.11 % | -22.64 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III | -2.35 % | 14.78 % | 1.76 % | -0.25 | -0.61 | 1.05 | -1.02 % | -22.61 % | 30.00 |
| <i>SPI EXTRA</i> | <i>-1.20 %</i> | <i>13.95 %</i> | - | <i>-0.18</i> | - | - | - | <i>-21.19 %</i> | <i>30.00</i> |

Période d'observation: 01.04.2022 au 31.03.2025 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 | 6.21 % | 15.15 % | 1.88 % | 0.32 | -0.37 | 1.04 | -1.04 % | -31.29 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II | 6.28 % | 15.15 % | 1.88 % | 0.33 | -0.33 | 1.04 | -0.97 % | -31.25 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III | 6.39 % | 15.15 % | 1.88 % | 0.33 | -0.28 | 1.04 | -0.86 % | -31.21 % | 30.00 |
| <i>SPI EXTRA</i> | <i>7.03 %</i> | <i>14.48 %</i> | - | <i>0.39</i> | - | - | - | <i>-30.06 %</i> | <i>30.00</i> |

Période d'observation: 01.04.2020 au 31.03.2025 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 | 6.80 % | 14.37 % | 2.33 % | 0.38 | 0.22 | 1.02 | 0.38 % | -31.29 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES II | 6.91 % | 14.37 % | 2.33 % | 0.39 | 0.26 | 1.02 | 0.48 % | -31.25 % | 30.00 |
| ACTIONS SUISSES VALEURS COMPLEMENTAIRES III | 7.05 % | 14.37 % | 2.34 % | 0.40 | 0.32 | 1.02 | 0.62 % | -31.21 % | 30.00 |
| <i>SPI EXTRA</i> | <i>6.30 %</i> | <i>13.85 %</i> | - | <i>0.36</i> | - | - | - | <i>-30.06 %</i> | <i>30.00</i> |

Période d'observation: 01.04.2015 au 31.03.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.29 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

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