



# 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      | 4.67 %  | 7.45 %     | 3.91 %         | 0.63         | 1.30              | 1.35             | 4.93 %          | -4.90 %            | 1.00                  |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II     | 4.73 %  | 7.44 %     | 3.91 %         | 0.64         | 1.32              | 1.35             | 4.98 %          | -4.87 %            | 1.00                  |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III    | 4.77 %  | 7.44 %     | 3.92 %         | 0.64         | 1.33              | 1.35             | 5.03 %          | -4.86 %            | 1.00                  |
| <i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i> | -0.20 % | 6.67 %     | -              | -0.02        | -                 | -                | -               | -5.07 %            | -                     |

Période d'observation: 01.10.2025 au 30.09.2026 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      | 8.23 % | 8.28 %     | 2.57 %         | 0.99         | 0.75              | 1.14             | 1.09 %          | -4.90 %            | 1.00                  |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II     | 8.29 % | 8.29 %     | 2.57 %         | 1.00         | 0.77              | 1.14             | 1.15 %          | -4.87 %            | 1.00                  |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III    | 8.34 % | 8.29 %     | 2.57 %         | 1.01         | 0.79              | 1.14             | 1.19 %          | -4.86 %            | 1.00                  |
| <i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i> | 6.27 % | 6.97 %     | -              | 0.90         | -                 | -                | -               | -5.07 %            | -                     |

Période d'observation: 01.10.2023 au 30.09.2026 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      | 1.49 % | 8.61 %     | 2.33 %         | 0.18         | 0.57              | 1.01             | 1.32 %          | -18.50 %           | 23.00                 |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II     | 1.55 % | 8.61 %     | 2.33 %         | 0.18         | 0.60              | 1.01             | 1.38 %          | -18.41 %           | 23.00                 |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III    | 1.59 % | 8.61 %     | 2.34 %         | 0.19         | 0.61              | 1.01             | 1.42 %          | -18.34 %           | 23.00                 |
| <i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i> | 0.17 % | 8.18 %     | -              | 0.02         | -                 | -                | -               | -20.55 %           | 37.00                 |

Période d'observation: 01.10.2021 au 30.09.2026 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      | 2.23 % | 7.72 %     | 2.06 %         | 0.29         | 0.06              | 0.97             | 0.21 %          | -21.07 %           | 24.00                 |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF II     | 2.32 % | 7.72 %     | 2.06 %         | 0.30         | 0.10              | 0.97             | 0.30 %          | -20.95 %           | 24.00                 |
| EMPRUNTS CONVERTIBLES GLOBAL HEDGED CHF III    | 2.37 % | 7.72 %     | 2.06 %         | 0.31         | 0.13              | 0.97             | 0.35 %          | -20.86 %           | 24.00                 |
| <i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i> | 2.08 % | 7.67 %     | -              | 0.28         | -                 | -                | -               | -21.30 %           | 44.00                 |

Période d'observation: 01.10.2016 au 30.09.2026 Période de base: mensuel

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

Informations fournies sous toutes réserves



| Chiffre-clé                       | Calcul                                                                                                                                                                                                                          | Description                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Volatilité                        | $\sqrt{\text{Variance}}$                                                                                                                                                                                                        | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne                                                                                                                                                              |
| Ratio de Sharpe                   | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$                                                                                   | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru                                                                                                                                                                     |
| Tracking error                    | Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark)                                                                                                                                           | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif)<br>Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information               | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$                                                                                                             | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru                                                                                                                                                                             |
| Coefficient bêta                  | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$                                                                                                  | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché                                                                                                                                                                         |
| Alpha de Jensen                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | 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                                                                                                                                                                             |