



## 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                   | -0.26 % | 4.02 %     | 0.43 %         | -0.16        | -0.42             | 1.01             | -0.18 %         | -2.82 %            | 9.00                  |
| <i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i> | -0.08 % | 3.82 %     | -              | -0.12        | -                 | -                | -               | -2.71 %            | 9.00                  |

Période d'observation: 01.10.2024 au 30.09.2025 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                   | 3.04 % | 6.20 %     | 0.59 %         | 0.43         | 0.62              | 1.05             | 0.24 %          | -6.47 %            | 2.00                  |
| <i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i> | 2.68 % | 5.87 %     | -              | 0.39         | -                 | -                | -               | -6.07 %            | 2.00                  |

Période d'observation: 01.10.2022 au 30.09.2025 Période de base: mensuel

| 5 années                                              | Rdmt    | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|-------------------------------------------------------|---------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III                   | -2.15 % | 6.70 %     | 0.55 %         | -0.38        | 0.36              | 1.04             | 0.28 %          | -21.32 %           | 23.00                 |
| <i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i> | -2.33 % | 6.46 %     | -              | -0.42        | -                 | -                | -               | -20.92 %           | 23.00                 |

Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2025 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                   | -2.26 % | 6.65 %     | 0.61 %         | -0.40        | 0.12              | 1.04             | 0.16 %          | -21.32 %           | 23.00                 |
| <i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i> | -2.32 % | 6.40 %     | -              | -0.42        | -                 | -                | -               | -20.92 %           | 23.00                 |

Période d'observation: 01.09.2020 au 30.09.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 0.38 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



| Chiffre-clé                       | Calcul                                                                                                                                                                                                                          | Description                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Volatilité                        | $\sqrt{\text{Variance}}$                                                                                                                                                                                                        | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne                                                                                                                                                              |
| Ratio de Sharpe                   | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$                                                                                   | 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)<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                                                                                                                                                                             |