

## Introduction

---

Le module interactif du site internet de la KGAST permet de comparer en toute neutralité les indicateurs de performance et de risque de plus de 230 groupes d'investissement.

Les groupes d'investissement sont répartis en 24 catégories. Les horizons temporels comme les benchmarks peuvent être librement choisis par l'utilisateur. Jusqu'à 180 données mensuelles sont disponibles par groupe d'investissement.

Le présent document fait office d'introduction aux fonctionnalités les plus importantes de l'application.

# Choix de la catégorie

Vingt-quatre catégories regroupant plus de 230 groupes d'investissement sont proposées à choix.

The screenshot shows a financial software interface with a category selection menu on the left and a performance table on the right. The menu lists 24 categories, including 'Actions étrangères', 'Actions suisses', 'Allocations mixtes', 'Hedge funds', 'Immobilier', 'Marché monétaire', 'Obligations convertibles', 'Obligations en francs suisses', 'Obligations en monnaies étrangères', and 'Private equity'. The table displays performance metrics for various products, with 'MSCI World TR' selected.

	Perf.	Vol.	MDD	SR	Corr.	R2	Alpha	Bêta	TE	IR	A/I
Actions étrangères: Etats-Unis/Amérique du Nord	-0,7	17,0	-15,2	-0,1	1,0	1,0	0,2	1,0	2,2	0,1	A
Actions étrangères: Europe	-1,1	16,9	-14,7	-0,1	1,0	1,0	-0,2	1,0	0,4	-0,6	I
Actions étrangères: Japon	-1,0	16,9	-14,7	-0,1	1,0	1,0	-0,1	1,0	0,4	-0,2	I
Actions étrangères: marchés émergents	-1,4	16,8	-14,8	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,4	-1,2	I
Actions étrangères: Monde	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Actions suisses	-2,6	14,7	-13,9	-0,2	0,9	0,8	-1,9	0,8	6,9	-0,2	A
Actions suisses: small & mid caps	-1,5	16,9	-14,8	-0,1	1,0	1,0	-0,6	1,0	0,5	-1,4	I
Allocations mixtes	-0,7	16,5	-14,4	-0,1	1,0	1,0	0,2	1,0	2,0	0,1	A
Allocations mixtes: actions 10-19%	-2,6	17,4	-12,7	-0,2	0,9	0,8	-1,8	0,9	7,3	-0,2	I
Allocations mixtes: actions 20-30%	-1,2	15,7	-14,7	-0,1	1,0	1,0	-0,4	0,9	2,2	-0,2	A
Allocations mixtes: actions 31-40%	-1,4	16,9	-14,8	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,4	-1,1	I
Allocations mixtes: actions 41-50%	-2,5	16,2	-15,6	-0,2	1,0	1,0	-1,7	1,0	3,1	-0,5	A
Hedge funds (avec couverture monétaire)	0,4	17,4	-15,6	0,0	1,0	1,0	1,3	1,0	3,6	0,3	A
Hedge funds (avec couverture monétaire)	-1,8	16,5	-15,0	-0,1	1,0	1,0	-0,9	1,0	3,6	-0,2	A
Immobilier étranger	-1,2	17,4	-15,1	-0,1	1,0	1,0	-0,2	1,0	1,7	-0,2	A
Immobilier étranger	-1,9	17,0	-15,0	-0,1	1,0	1,0	-1,0	1,0	1,8	-0,6	A
Immobilier suisse	-0,8	16,5	-14,7	-0,1	1,0	1,0	0,1	1,0	1,4	0,1	A
Immobilier suisse: immeubles à vocation mixte	-3,1	19,0	-17,3	-0,2	1,0	1,0	-2,1	1,1	2,9	-0,8	A
Immobilier suisse: immeubles commerciaux	-1,6	17,0	-14,9	-0,1	1,0	1,0	-0,7	1,0	0,7	-1,1	I
Immobilier suisse: immeubles d'habitation	-3,0	19,0	-17,2	-0,2	1,0	1,0	-2,0	1,1	2,9	-0,8	A
Marché monétaire	-1,4	17,0	-14,8	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations convertibles	-5,7	15,3	-15,3	-0,4	0,9	0,9	-5,2	0,9	6,4	-0,8	A
Obligations convertibles	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en francs suisses	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en francs suisses: part domestique	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en francs suisses: part étrangère	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en monnaies étrangères	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en monnaies étrangères: dollar US	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en monnaies étrangères: euro	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Obligations en monnaies étrangères: Monde	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
Private equity	-3,1	19,0	-17,3	-0,2	1,0	1,0	-2,1	1,1	2,9	-0,8	A
Private equity	-1,6	17,0	-14,9	-0,1	1,0	1,0	-0,7	1,0	0,7	-1,1	I
UBS2 Global Equities (ex CH)	-3,0	19,0	-17,2	-0,2	1,0	1,0	-2,0	1,1	2,9	-0,8	A
UBS2 Global Equities (ex CH) Passive	-1,4	17,0	-14,8	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I
ZUR Actions Durabilité Global	-5,7	15,3	-15,3	-0,4	0,9	0,9	-5,2	0,9	6,4	-0,8	A
MSCI World TR	-0,9	16,6	-14,3	-0,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,7	-0,7	I

Taux sans risque: Libor 3M CHF

## Choix du benchmark

Jusqu'à trois benchmarks par catégorie peuvent être sélectionnés. Le benchmark de certains groupes d'investissement n'est pas disponible. Cela vaut en particulier pour les benchmarks « customisés ».

Deutsch | Français

Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen / Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

COMPARATIF PRODUITS

Obligations en monnaies étrangères: euro

- ✓ Citigroup EMU GBI TR
- JP Morgan EMU Aggregate
- Barclays Capital Euro Aggregate TR

01.06.1998 31.03.2011

Periode: 01.04.2010 - 31.03.2011 (12 mois)

F.	Dénomination	Perf.	Vol.	MDD	SR	Corr.	R2	Alpha	Bêta	TE	IR	A/I
▶	AVA Obligations en EUR	-10,7	12,6	-13,2	-0,9	1,0	1,0	-0,4	0,9	1,0	0,3	A
▶	BAL Obligations Euro	-10,3	12,5	-13,3	-0,9	1,0	1,0	-0,1	0,9	1,9	0,4	A
▶	CSF Bonds EUR	-9,3	12,6	-13,0	-0,8	1,0	1,0	1,2	0,9	1,2	1,6	A
▶	IST Governo Euro Plus	-8,7	11,7	-12,6	-0,8	1,0	1,0	0,9	0,9	2,8	0,9	A
▶	SWC Obligations Europe Top	-7,4	11,9	-12,2	-0,6	1,0	1,0	2,5	0,9	3,1	1,3	A
▶	UBS Obligations en EUR	-9,8	12,7	-13,1	-0,8	1,0	1,0	0,8	0,9	1,1	1,3	A
▶	ZUR Obligations Euro	-10,8	12,1	-13,0	-0,9	1,0	1,0	-0,9	0,9	1,7	0,1	A
	Citigroup EMU GBI TR	-11,0	13,3	-13,6	-0,9							

Taux sans risque: Libor 3M CHF

Powered by Fundo; Source: LIPPER

# Choix de l'horizon temporel

Le curseur permet le libre choix de la période d'analyse. La période minimale d'analyse a été fixée à 12 mois. Par défaut, la période couvrant les 12 derniers mois est sélectionnée à l'ouverture de l'application. Toutes les périodes d'une durée variant entre 12 et 180 mois peuvent être librement sélectionnées.

Le curseur peut être actionné indifféremment avec la souris de votre ordinateur ou les touches du clavier correspondant aux flèches droite et gauche.

Deutsch | Français

KIGAST Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

COMPARATIF PRODUITS

Actions suisses SPI® TR

01.10.2003 [36 m.] 30.09.2006 [36 m.]

01.05.1996 31.03.2011

Periode: 01.10.2003 - 30.09.2006 (36 mois)

F.	Dénomination	Perf.	Vol.	MDD	SR	Corr.	R2	Alpha	Bêta	TE	IR	A/I
▶ ALZ	Actions suisses	20,7	9,0	-6,7	2,0	1,0	1,0	-1,1	1,0	0,5	-1,8	A
▶ AVA	Actions Suisse	21,4	9,0	-6,5	2,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,2	-2,7	I
▶ BAL	Actions Suisse	21,6	9,2	-6,4	2,1	1,0	1,0	-0,7	1,0	0,9	-0,3	A
▶ CSF	Equity Switzerland	20,3	9,2	-7,5	1,9	1,0	1,0	-1,9	1,0	0,8	-1,6	A
▶ CSF	Swiss Index	20,3	9,0	-7,0	2,0	1,0	1,0	-1,4	1,0	0,9	-1,5	I
▶ FWI	Actions Suisse	20,4	9,0	-7,0	2,0	1,0	1,0	-1,3	1,0	0,9	-1,4	I
▶ HEL	Actions Suisse indexées	21,3	9,3	-6,6	2,0	0,9	0,9	0,2	1,0	3,4	-0,1	I
▶ IST	Actions suisses indexées sur le SMI	20,0	8,9	-7,7	2,0	1,0	1,0	-1,4	1,0	1,3	-1,2	I
▶ SAR	Actions Durable Suisse	21,7	8,9	-5,9	2,1	1,0	1,0	0,2	1,0	1,5	-0,1	A
▶ SAR	Actions Suisse	20,5	9,4	-7,6	1,9	1,0	1,0	-2,0	1,0	0,8	-1,4	A
▶ SWC	Actions suisses	20,4	9,2	-7,4	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	0,8	-1,5	A
▶ SWL	Actions Suisse	19,0	8,8	-7,2	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	1,1	-1,7	A
▶ UBS	Actions suisses	20,4	9,2	-7,4	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	0,8	-1,5	A
▶ UBS	Actions suisses Indexé	20,4	9,2	-7,4	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	0,8	-1,5	I
▶ ZUR	Actions Suisse	20,4	9,2	-7,4	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	0,8	-1,5	A

Suisse romand

Powered by Fundo; Source: LIPPER

# Indicateurs statistiques

Onze indicateurs statistiques sont calculés dynamiquement en fonction de la période présélectionnée.

- Performance p.a. [Perf.]
- Maximum Drawdown [MDD]
- Volatilité p.a. [Vol.]
- Sharpe Ratio p.a. [SR]
- Corrélation [Korr.]
- Coefficient de détermination [R<sup>2</sup>]
- Alpha (de Jensens) [Alpha]
- Bêta [Beta]
- Tracking Error p.a. [TE]
- Ratio d'information p.a. [IR]
- Produit actif/indicé [A/I]

Le tri ascendant et descendant des colonnes est possible en cliquant sur les icônes placées en tête des colonnes.

Taux sans risque: Libor CHF 3 months

Deutsch | Français

Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen / Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

COMPARATIF PRODUITS

Actions suisses | SPI® TR

01.05.1996 | 31.03.2011

Periode: 01.10.2003 - 30.09.2006 (36 mois)

F.	Dénomination	Perf.	Vol.	MDD	SR	Corr.	R2	Alpha	Bêta	TE	IR	A/I
▶ ALZ	Actions suisses	20,7	9,0	-6,7	2,0	1,0	1,0	-1,1	1,0	0,5	-1,8	A
▶ AVA	Actions Suisse	21,4	9,0	-6,5	2,1	1,0	1,0	-0,5	1,0	0,2	-2,7	I
▶ BAL	Actions Suisse	21,6	9,2	-6,4	2,1	1,0	1,0	-0,7	1,0	0,9	-0,3	A
▶ CSF	Equity Switzerland	20,3	9,2	-7,5	1,9	1,0	1,0	-1,9	1,0	0,8	-1,6	A
▶ CSF	Swiss Index	20,3	9,0	-7,0	2,0	1,0	1,0	-1,4	1,0	0,9	-1,5	I
▶ Fwi	Actions Suisse	20,4	9,0	-7,0	2,0	1,0	1,0	-1,3	1,0	0,9	-1,4	I
▶ HEL	Actions Suisse indexées	21,3	9,3	-6,6	2,0	0,9	0,9	0,2	1,0	3,4	-0,1	I
▶ IST	Actions suisses indexées sur le SMI	20,0	8,9	-7,7	2,0	1,0	1,0	-1,4	1,0	1,3	-1,2	I
▶ SAR	Actions Durable Suisse	21,7	8,9	-5,9	2,1	1,0	1,0	0,2	1,0	1,5	-0,1	A
▶ SAR	Actions Suisse	20,5	9,4	-7,6	1,9	1,0	1,0	-2,0	1,0	0,8	-1,4	A
▶ SWC	Actions suisses	20,4	9,2	-7,4	2,0	1,0	1,0	-1,7	1,0	0,8	-1,5	A
▶ SWL	Actions Suisse	19,9	8,2	-5,3	2,1	1,0	1,0	0,2	0,9	1,4	-1,2	A
▶ UBS	Actions suisses	20,9	9,0	-7,3	2,0	1,0	1,0	-0,9	1,0	1,0	-0,8	A
▶ UBS	Actions suisses Indexé	20,4	9,0	-7,0	2,0	1,0	1,0	-1,2	1,0	0,9	-1,3	I
▶ ZUR	Actions Suisse	21,1	9,2	-6,9	2,0	1,0	1,0	-1,0	1,0	1,3	-0,5	A
	SPI® TR	21,9	8,9	-6,2	2,1							

Taux sans risque: Libor 3M CHF

Powered by FJ Fundo; Source: LIPPER

# Tableaux et graphiques

Outre le tableau de chiffres, trois vues graphiques sont également sélectionnables.

Konferenz der Geschäftsführer  
von Anlagestiftungen  
Conférence des Administrateurs  
de Fondations de Placement

Deutsch | Français

COMPARATIF
PRODUITS

Actions suisses
SPI® TR

01.05.1996
31.03.2011

Période: 01.04.2010 - 31.03.2011 (12 mois)

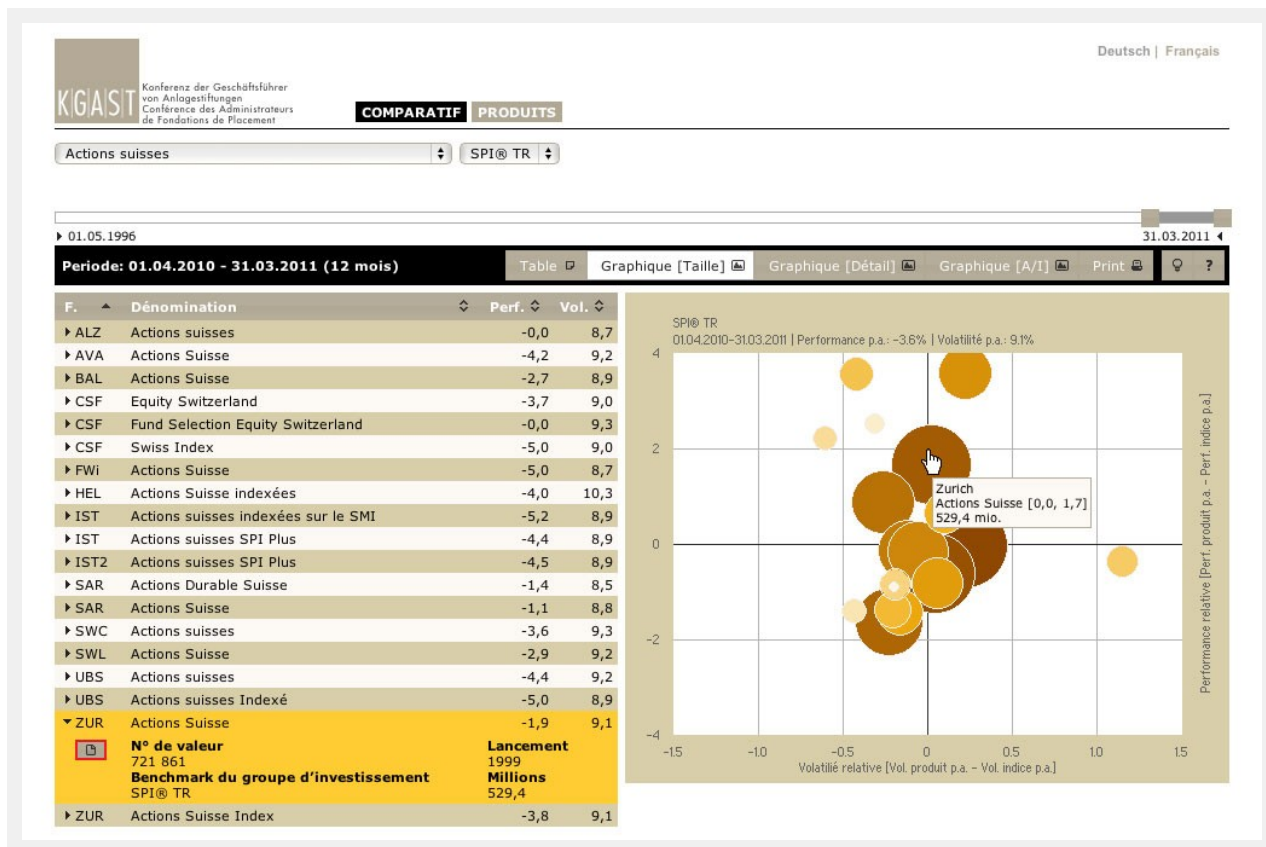
Table
Graphique [Taille]
Graphique [Détail]
Graphique [A/I]
Print
?

F.	Dénomination	Perf.	Vol.
▶ ALZ	Actions suisses	-0,0	8,7
▶ AVA	Actions Suisse	-4,2	9,2
▶ BAL	Actions Suisse	-2,7	8,9
▶ CSF	Equity Switzerland	-3,7	9,0
▶ CSF	Fund Selection Equity Switzerland	-0,0	9,3
▶ CSF	Swiss Index	-5,0	9,0
▶ FWi	Actions Suisse	-5,0	8,7
▶ HEL	Actions Suisse indexées	-4,0	10,3
▶ IST	Actions suisses indexées sur le SMI	-5,2	8,9
▶ IST	Actions suisses SPI Plus	-4,4	8,9
▶ IST2	Actions suisses SPI Plus	-4,5	8,9
▶ SAR	Actions Durable Suisse	-1,4	8,5
▶ SAR	Actions Suisse	-1,1	8,8
▶ SWC	Actions suisses	-3,6	9,3
▶ SWL	Actions Suisse	-2,9	9,2
▶ UBS	Actions suisses	-4,4	9,2
▶ UBS	Actions suisses Indexé	-5,0	8,9
▶ ZUR	Actions Suisse	-1,9	9,1
▶ ZUR	Actions Suisse Index	-3,8	9,1
SPI® TR		-3,6	9,1

Powered by Fundo; Source: LIPPER

## Vue détaillée

En cliquant sur le triangle noir situé en regard de l'intitulé de chaque groupe d'investissement, on accède à des informations supplémentaires. Il est de plus possible de générer dynamiquement un factsheet pour la période et le benchmark sélectionnés.



# Factsheets

Le factsheet peut être sauvé sous forme de fichier au format pdf. La sélection de périodes et de benchmarks différents donne lieu à la production de versions distinctes du même factsheet.

**KIGIA|S|T** Conférence des Geschäftsführer von Anlagestiftungen / Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

**ACTIONS SUISSE MARS 2011**

**1**

**Actions Suisse**  
CH000218610  
VNI: CHF 1'480,73

**Manager:** Zurich Anlagestiftung  
**Administrateur:** Zurich Anlagestiftung  
**Dépositaire:** SSC Credit Investor Services Bank SA, Zurich Branch  
**Fortune:** 520 Millions  
**Lancement:** 19-05-1999  
**Benchmark:** SPI® TR

Zurich Fondation de placement  
Case postale, 8001 Zurich  
044 628 78 88  
www.zurich-fondation.ch

**Performances mensuelles 2010-2011**

SPI® TR	Jan	Fév	Mars	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sep	Oct	Nov	Déc	2010	2011
-0,82	-2,88			-3,37	-4,30	-2,87	1,90	-2,87	0,98	3,08	-2,48	5,11		
0,03	0,77	0,77	1,34	-2,30										

**Performance cumulée 2010-2011, 31.03.2010=100**

**Retour**  
**Avancer**  
**Rafraîchir**

**Enregistrer sous...**  
**Imprimer...**  
Traduire en français  
Afficher le code source de la page  
Afficher les infos sur la page  
Procéder à l'inspection de l'élément

Département	Ratio	Ratio	Benchmark	Impact	Ratio de Bénéf
Schweiz	absolu	pourcent		absolu	absolu
Schweiz	-0,93%	1,00	0,04%	0,14%	-0,23
SPI® TR	-0,93%	1,00	0,04%	0,12%	-0,12

**KIGIA|S|T** Conférence des Geschäftsführer von Anlagestiftungen / Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

**ACTIONS SUISSE DÉCEMBRE 2010**

**1**

**Actions Suisse**  
CH000218610  
VNI: CHF 1'468,44

**Manager:** Zurich Anlagestiftung  
**Administrateur:** Zurich Anlagestiftung  
**Dépositaire:** SSC Credit Investor Services Bank SA, Zurich Branch  
**Fortune:** 574 Millions  
**Lancement:** 19-05-1999  
**Benchmark:** SPI® TR

Zurich Fondation de placement  
Case postale, 8001 Zurich  
044 628 78 88  
www.zurich-fondation.ch

**Performances mensuelles 2009-2010**

SPI® TR	Jan	Fév	Mars	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sep	Oct	Nov	Déc	2009	2010
22,08	21,81	-0,23	-0,23	-0,22	0,08	1,45	3,76	6,43	0,91	-0,70	4,43	3,76	0,02	
6,89	5,97	4,18	1,87	-0,18	4,26	-2,18	0,26	-0,27	-0,28	0,77	-1,78	1,46	4,78	2004
30,61	34,50	1,44	3,89	0,13	-0,28	4,37	0,26	0,68	+1,23	0,83	0,84	5,53	0,70	2005
30,67	17,78	3,48	1,64	2,20	0,80	+4,83	0,00	3,70	3,14	0,80	1,84	-0,72	0,68	2006
-0,28	-1,86	4,46	-0,52	1,81	0,86	0,41	-0,41	-0,32	+1,17	0,76	1,84	-0,20	-0,95	2007
-0,28	-0,28	+0,87	0,14	-0,36	0,84	0,47	-0,86	0,74	1,13	-1,81	-0,74	-1,24	-0,93	2008
33,18	18,80	+0,78	-1,38	0,80	0,17	2,20	-1,23	-10,28	0,80	3,84	-0,72	-0,24	0,83	2009
0,80	0,80	-0,23	0,91	0,70	-0,27	-0,32	1,96	-0,87	0,08	0,90	-0,18	0,12	0,10	2010

**Performance cumulée 2001-2010, 31.12.2000=100**

**Analyse comparative (31-12-2000 - 31-12-2010)**

Département	Performance	Risque	Performance	Risque	Performance	Risque
Schweiz	absolu	absolu	pourcent	absolu	absolu	absolu
Schweiz	15,02%	0,02%	1,41%	13,24%	10,29%	+1,09%
SPI® TR	0,0%	0,12%	0,0%	13,24%	10,29%	+10,29%



## Annexe (abréviations)

AFI	AFIAA Fondation d'investissement immobilier à l'étranger
ALZ	Allianz Suisse Fondation de placement
ASI	Assetimmo Fondation de placements immobiliers
AVA	Avadis Fondation d'investissement
BAL	Fondation de la Bâloise pour le placement des capitaux d'institutions de prévoyance
CSF	Credit Suisse Fondation de placement
CSF2	Credit Suisse Fondation de placement 2e pilier
ECO	Ecoreal Fondation suisse de placement immobilier
FWi	FWi Fondation de placement Winterthur
HEL	Helvetia Fondation de placement
HIG	HIG Immobilien Anlage Stiftung
IMO	Imoka Fondation de placements immobiliers
IST	IST Fondation d'investissement pour la prévoyance en faveur du personnel
IST2	IST2 Fondation de placements immobiliers
PAT	Patrimonium Fondation de placements
PEN	Pensimo Fondation de placements immobiliers
PRI	Prisma Fondation d'investissement
REN	Renaissance PME, Fondation suisse d'investissement
SAR	Sarasin Fondation de placement
SWA	Swisscanto Fondation de placement Avant
SWC	Swisscanto Fondation de placement
SWL	Fondation de placement Swiss Life
TES	Testina Fondation de placements immobiliers
TUR	Turidomus Fondation de placements immobiliers
UBS	Fondation UBS pour l'investissement du patrimoine d'institutions de prévoyance du personnel
UBS2	UBS Investment Foundation 2
ZUR	Zurich Fondation de placement