

Gestion obligataire en assurance de portefeuille de type TIPP : Dynagest Expo Bonds Euro « MAS »

Gestion effective depuis le lancement : du 13.04.2005 au 02.03.2016 (en EUR)



Gestion « à cliquets » (EUR)

> performance (p.a.) - brut	5.5%
> volatilité	4.1%
> « maximum drawdown »	-5.7%

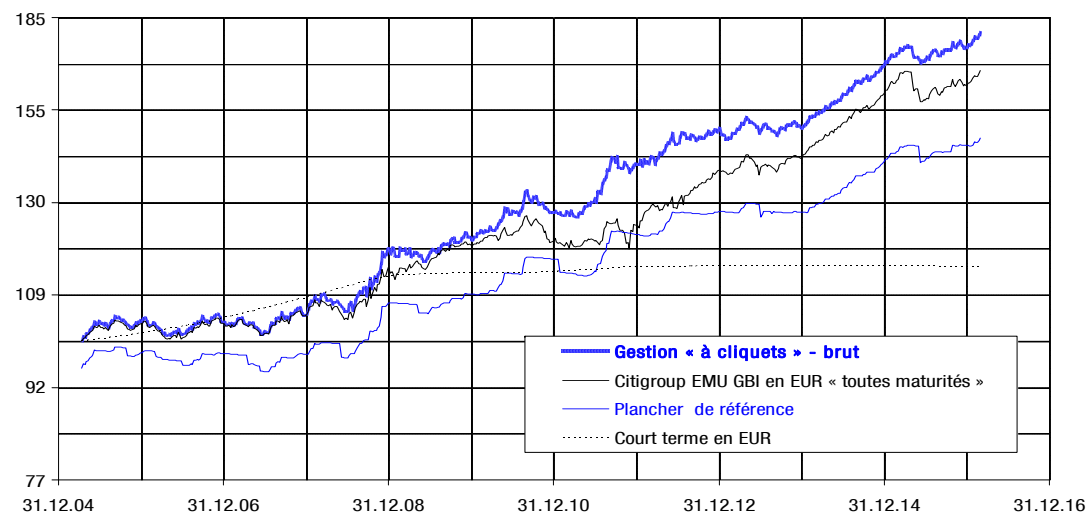
Citigroup EMU GBI en EUR « toutes maturités »

> performance (p.a.)	4.8%
> volatilité	4.2%
> « maximum drawdown »	-6.1%

Plancher de référence

(en % de l'inv. initial)

> de	95.0%
> à	147.2%
> abaissements (moyenne, p.a.) (ré-injections de coussin)	-3.1%



Exposition

> moyenne	77.9%
> initiale - finale	92.5% - 85.0%
> min. - max.	26.7% - 94.7%

Duration modifiée

> moyenne	6.46
> initiale - finale	6.96 - 7.90
> min. - max.	2.48 - 8.31

Paramètres

> exposition de base (autorisée max.)	100%
> coussin de base (max.)	5%
> multiples (max.)	20
> exposition minimum	30%
> ré-injections de coussin	conditionnelles
> budget de ré-injection de coussin (p.a.)	4.5%

