

Gestion obligataire en assurance de portefeuille de type TPP : Dynagest Expo Bonds USD « MAS »

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



Gestion « à cliquets » (USD)

> performance (p.a.) - brut	5.6%
> volatilité	5.4%
> « maximum drawdown »	-8.0%

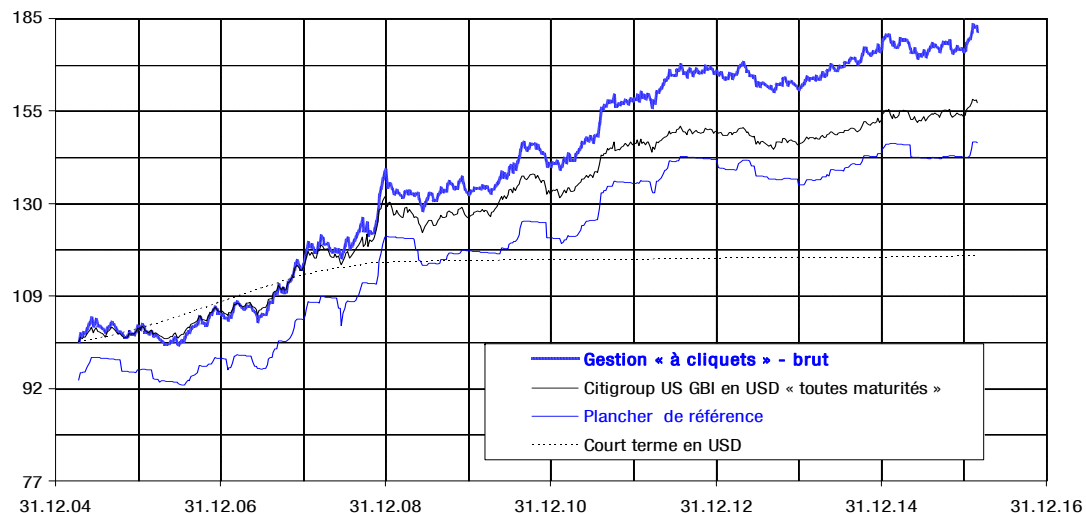
Citigroup US GBI en USD « toutes maturités »

> performance (p.a.)	4.3%
> volatilité	4.1%
> « maximum drawdown »	-6.7%

Plancher de référence

(en % de l'inv. initial)

> de	93.0%
> à	146.2%
> abaisséments (moyenne, p.a.) (ré-injections de coussin)	-4.9%



Exposition

> moyenne	73.6%
> initiale - finale	74.9% - 62.1%
> min. - max.	32.2% - 99.0%

Duration modifiée

> moyenne	6.58
> initiale - finale	6.90 - 7.30
> min. - max.	3.25 - 9.89

Paramètres

> exposition de base (autorisée max.)	100%
> coussin de base (max.)	7%
> multiples (max.)	14 2/7
> exposition minimum	30%
> ré-injections de coussin	conditionnelles
> budget de ré-injection de coussin (p.a.)	5.5%

