



Asset Services SA

## Indicateurs de risques

Afin que les investisseurs institutionnels puissent intégrer nos portefeuilles dans leur budget de risques et aient également la possibilité de comparer ceux-ci (Peer Group), AS mandate la direction de fonds, aussitôt que celle-ci est définie, pour calculer les indicateurs de risques conventionnels tels que

- Volatilité
- Sharpe Ratio
- Information Ratio
- Tracking Error
- Alpha de Jensen
- Beta

de nos portefeuilles, qui seront dès lors des fonds de placement. Cette instance tierce peut, si nécessaire, calculer les indicateurs de risques de façon rétroactive sur plusieurs années, car toutes les données sont à disposition.

La gestion quotidienne est guidée par notre Global Sentiment-Exposure-Index. Voir [Description](#) Global Sentiment-Exposure-Index.