

BCV DIAPASON COMMODITY FD - BCV DIAP. Commodity (CHF) A

Domicile du fonds: Suisse Données au 31.12.2011

Caractéristiques du fonds

Risque ■ ■ ■ ■ ■ ■ ■ ■ ■ ■

BCV DIAPASON COMMODITY FUND est un fonds de placement de droit suisse à compartiments multiples, catégorie «Autres fonds en placements traditionnels». L'objectif du compartiment BCV DIAPASON Commodity (CHF) est de générer une performance proche ou supérieure à celle de l'indice Diapason Commodities Index® (DCI®), indice composé des cours de 48 commodities dont la pondération est ajustée une fois par année selon des critères purement quantitatifs et rebalancée une fois par mois. Au minimum 2/3 de la fortune est exposé aux commodities par des dérivés (futures). La couverture des risques de change est effectuée par des dérivés (forwards).

| | |
|--|--|
| Valeur nette d'inventaire comptable | CHF 71.18 |
| Cours extrêmes 2011 | CHF 87.08/68.64 |
| Fortune du compartiment (en mios) | CHF 175.57 |
| TER au 30.06.2011 | 2.08% |
| Management fee | 2.00% |
| Date de création | 28.03.2006 |
| N° de valeur / ISIN | 2463440 / CH0024634401 |
| Reuters / Bloomberg | 0#GERI1 / BCDVCCA |
| Monnaie de référence | CHF |
| Calcul de la valeur nette d'inventaire | Chaque jeudi ou le 1er jour ouvrable bancaire suivant. |
| Gestionnaire du fonds | BCV Asset Management |
| Conseiller en investissement | Diapason CM |

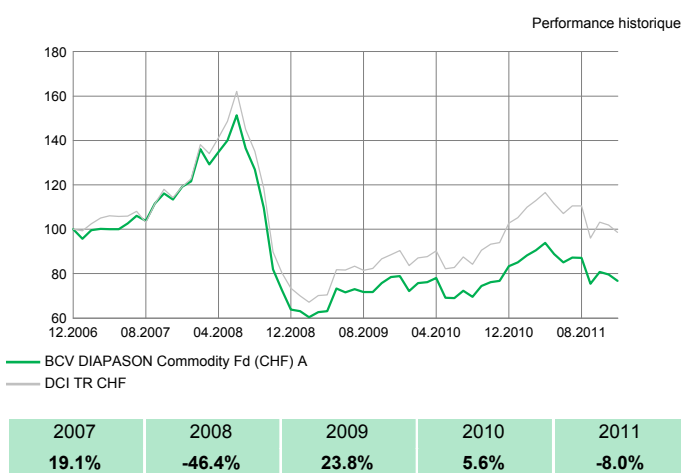
Direction de fonds: GERIFONDS SA, Lausanne / www.gerifonds.ch

Performance en CHF

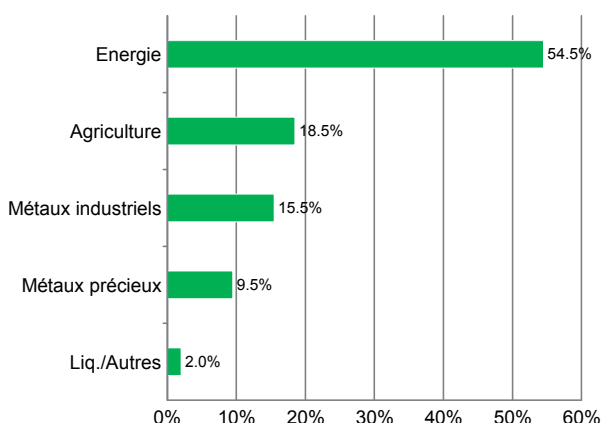
| | 1 mois | Depuis le 31/12/10 | 1 an | Depuis le 28/03/06 |
|--|--------------|--------------------|--------------|--------------------|
| BCV DIAPASON Commodity Fd (CHF) A | -3.6% | -8.0% | -8.0% | -28.8% |
| DCI TR CHF | -3.2% | -4.1% | -4.1% | -10.3% |

*Volatilité annualisée 23.53% *Taux hors risque 1.20%
*Ratio de Sharpe -0.30 *Bêta 0.99

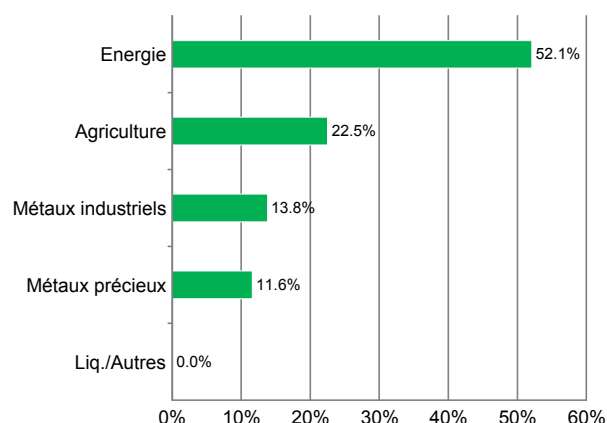
Depuis le 31.03.2006



Allocation tactique du fonds



Allocation de l'indice



Performance en USD sur 1 mois / 3 mois :
DCI Agriculture : 1.86% / -2.24%
DCI Métaux industriels : -3.99% / -1.58%
DCI Métaux précieux : -10.83% / -4.14%
DCI Energie : -3.49% / 6.41%

La performance historique ne représente pas un indicateur de performance courante ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.



Tél. 021/212 20 51 - E-mail: fonds@bcv.ch