



1

**PRISMA Global Emerging Markets
Equities II**
CH0276997662

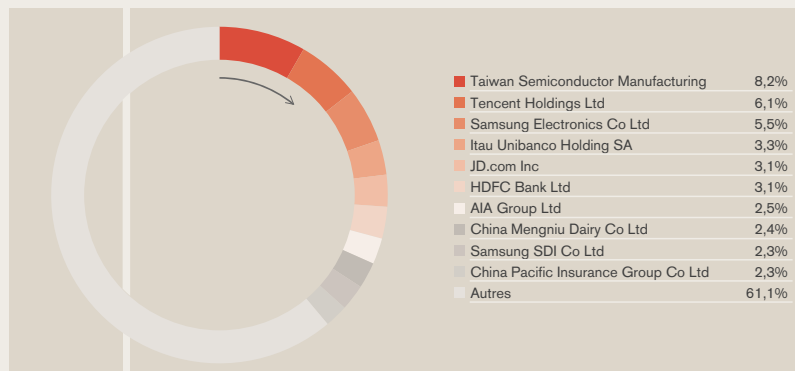
VNI: CHF 1'062,07

| | |
|---|--|
| Gestion déléguée | Schroders, Londres |
| Banque dépositaire | Credit Suisse, Zurich |
| Administrateur | Credit Suisse, Zurich |
| Distribution | Key Investment Services (KIS) SA, Morges |
| Auditeur | Ernst & Young, Lausanne |
| Numéro de valeur / Bloomberg | 276 99 766 / PEMKEQA SW |
| Monnaie de référence | Francs suisses (CHF) |
| Date de lancement | 26 juin 2015 |
| Benchmark | MSCI EM TR Net |
| Date de fin d'exercice | 31 mars |
| Publication des cours Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et www.prisma-fondation.ch | |
| Liquidité | hebdomadaire |
| Prix d'émission | CHF 1000.- |
| Frais Aucun frais de souscription. Les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts. | |
| TER KGAST | 1,21% |
| Prisma Fondation d'investissement Rue du Sablon 2 CH-1110 Morges Tél.: 0848 106 106 www.prisma-fondation.ch info@prisma-fondation.ch | |

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

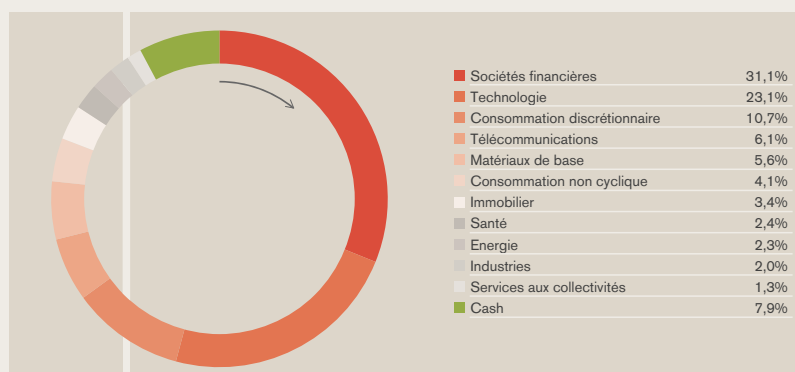
01

Positions principales



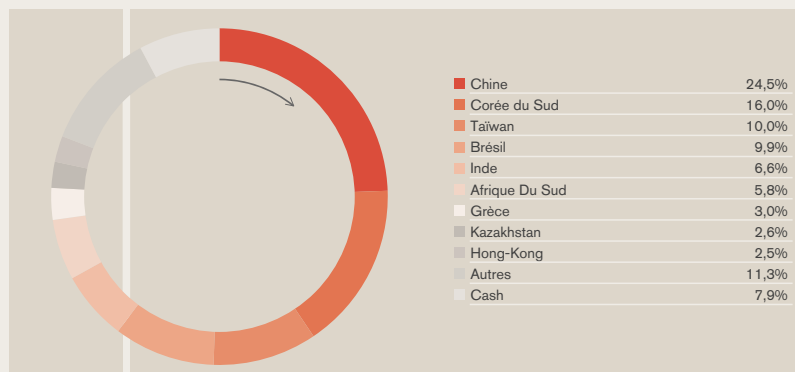
02

Répartition sectorielle



03

Répartition géographique



2

PRISMA Global Emerging Markets Equities II
CH0276997662

VNI: CHF 1'062,07

| | |
|------------------------------|--|
| Gestion déléguée | Schroders, Londres |
| Banque dépositaire | Credit Suisse, Zurich |
| Administrateur | Credit Suisse, Zurich |
| Distribution | Key Investment Services (KIS) SA, Morges |
| Auditeur | Ernst & Young, Lausanne |
| Numéro de valeur / Bloomberg | 276 99 766 / PEMKEQA SW |
| Monnaie de référence | Francs suisses (CHF) |
| Date de lancement | 26 juin 2015 |
| Benchmark | MSCI EM TR Net |
| Date de fin d'exercice | 31 mars |
| Publication des cours | Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et www.prisma-fondation.ch |
| Liquidité | hebdomadaire |
| Prix d'émission | CHF 1000.- |

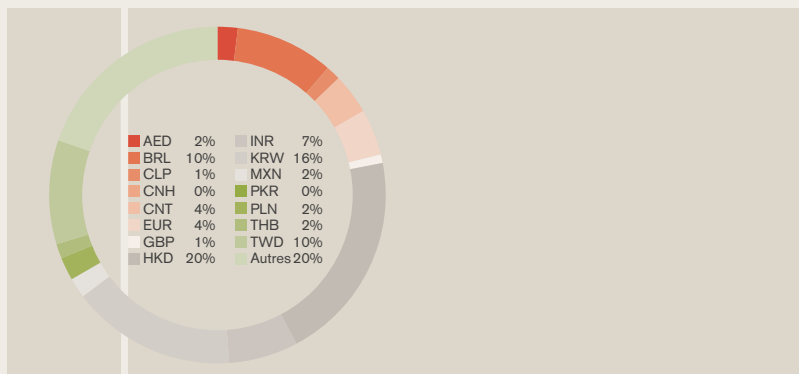
Frais
Aucun frais de souscription.
Les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts.
TER KGAST 1,21%

Prisma Fondation d'investissement
Rue du Sablon 2
CH-1110 Morges
Tél.: 0848 106 106
www.prisma-fondation.ch
info@prisma-fondation.ch

04

Répartition monétaire

Avant hedging



05

Performances mensuelles

2015-2022

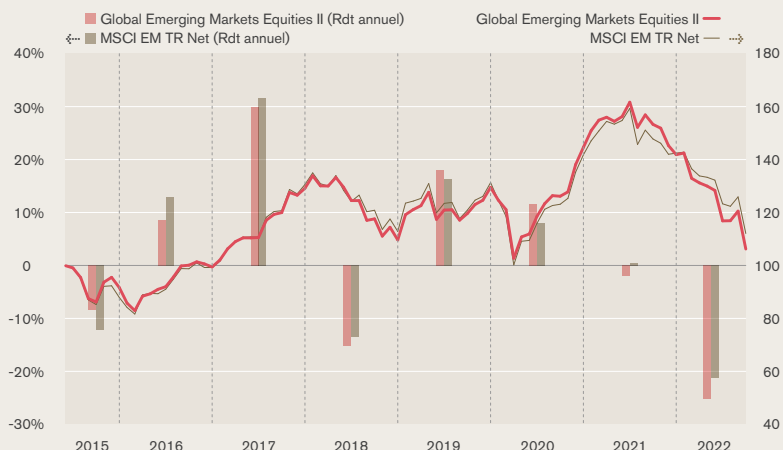
| Performances annuelles [%] | | Performances mensuelles [%] | | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------|--------|-----------------------------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|------|-------|------|
| MSCI EM TR Net | | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc | | | |
| -12,11 | -8,37 | | | | | | | | -0,95 | -3,64 | -8,36 | -1,46 | 8,67 | 1,97 | -4,07 | 2015 |
| 12,89 | 8,50 | -6,41 | -3,30 | 6,57 | 1,03 | 1,89 | 1,09 | 4,01 | 4,35 | 0,28 | 1,27 | -0,77 | -1,16 | | | 2016 |
| 31,63 | 29,91 | 2,64 | 4,14 | 2,56 | 1,31 | -0,02 | 0,14 | 5,90 | 1,88 | 0,57 | 6,34 | -0,81 | 2,08 | | | 2017 |
| -13,59 | -15,12 | 3,65 | -2,84 | -0,05 | 2,48 | -2,78 | -3,87 | -0,01 | -5,99 | 0,48 | -5,54 | 3,03 | -4,19 | | | 2018 |
| 16,34 | 18,10 | 8,71 | 1,62 | 1,22 | 4,13 | -8,03 | 3,01 | 0,10 | -3,26 | 2,16 | 2,85 | 1,30 | 3,89 | | | 2019 |
| 7,99 | 11,69 | -3,72 | -2,85 | -15,20 | 7,86 | 0,99 | 5,97 | 4,06 | 2,43 | -0,17 | 1,30 | 8,10 | 4,89 | | | 2020 |
| 0,46 | -1,91 | 4,35 | 2,64 | 0,71 | -0,99 | 1,16 | 3,49 | -5,88 | 3,09 | -2,29 | -0,93 | -4,33 | -2,37 | | | 2021 |
| -21,32 | -25,13 | 0,43 | -6,71 | -1,28 | -0,92 | -1,27 | -8,96 | 0,04 | 3,11 | -11,88 | | | | | | 2022 |



06

Performance cumulée

2015-2022, 26.06.2015=100



Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

3

**PRISMA Global Emerging Markets
Equities II**
CH0276997662

VNI: CHF 1'062,07

| | |
|---|--|
| Gestion déléguée | Schroders, Londres |
| Banque dépositaire | Credit Suisse, Zurich |
| Administrateur | Credit Suisse, Zurich |
| Distribution | Key Investment Services (KIS) SA, Morges |
| Auditeur | Ernst & Young, Lausanne |
| Numéro de valeur / Bloomberg | 276 99 766 / PEMKEQA SW |
| Monnaie de référence | Francs suisses (CHF) |
| Date de lancement | 26 juin 2015 |
| Benchmark | MSCI EM TR Net |
| Date de fin d'exercice | 31 mars |
| Publication des cours Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et www.prisma-fondation.ch | |
| Liquidité | hebdomadaire |
| Prix d'émission | CHF 1000.- |
| Frais Aucun frais de souscription. Les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts. | |
| TER KGAST | 1,21% |
| Prisma Fondation d'investissement Rue du Sablon 2 CH-1110 Morges Tél.: 0848 106 106 www.prisma-fondation.ch info@prisma-fondation.ch | |

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

07

Analyse comparative

(26.06.2015 – 30.09.2022)

| | Performance cumulée | Moyenne arithmétique | Performance annualisée | Meilleur mois | Mois positifs | Moins bon mois |
|------------------------------------|---------------------|----------------------|------------------------|---------------|---------------|----------------|
| Global Emerging Markets Equities I | 6,21% | 0,16% | 0,82% | 8,71% | 57,95% | -15,20% |
| MSCI EM TR Net | 12,08% | 0,23% | 1,57% | 9,47% | 57,95% | -15,44% |

| | 3e trim. 2022 | Drawdown maximum | Ratio gains:pertes | Ecart-type | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* |
|------------------------------------|---------------|------------------|--------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -9,10% | -34,31% | 1,38 | 4,35% | 15,08% | 0,03 |
| MSCI EM TR Net | -9,09% | -29,65% | 1,38 | 4,45% | 15,41% | 0,08 |

| | Corrél.* | R2* | Alpha de Jensen ann.* | Bêta* | Tracking Err. ann. |
|----------------|----------|------|-----------------------|-------|--------------------|
| MSCI EM TR Net | 0,98 | 0,95 | -0,0068 | 0,96 | 3,43% |

*Taux sans risque: Libor 3M

08

Excess Returns

Global Emerging Markets Equities II vs. MSCI EM TR Net

| Excess returns annuels [%] | Excess returns mensuels [%] | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------|-----------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc | |
| 6,72 | | | | | | -0,23 | 0,65 | 0,12 | 0,54 | 0,59 | 1,76 | 0,73 | 2015 |
| -9,72 | -2,12 | -0,34 | -2,30 | 0,40 | 2,03 | -0,81 | -0,19 | 0,15 | 0,35 | -0,99 | 0,97 | -1,16 | 2016 |
| -4,49 | 0,26 | -0,47 | 0,09 | -0,32 | -0,09 | 0,17 | -0,86 | 0,06 | 0,29 | -0,29 | 0,48 | -0,72 | 2017 |
| -2,62 | 0,30 | 0,18 | 0,65 | -0,58 | 1,43 | -0,68 | -1,90 | -1,04 | 0,01 | 0,44 | -0,42 | -0,21 | 2018 |
| 4,12 | -0,76 | 0,98 | 0,41 | -0,34 | 0,43 | 0,02 | -0,20 | 1,66 | -0,54 | -0,28 | 0,16 | -0,24 | 2019 |
| 8,12 | 1,33 | 2,08 | 0,24 | -1,03 | 0,70 | 0,09 | -0,53 | 1,26 | -0,57 | -0,52 | 0,19 | -0,13 | 2020 |
| -4,70 | 0,63 | 0,09 | -1,68 | -0,31 | 0,26 | 0,53 | 2,67 | -0,63 | -0,07 | 0,16 | -1,47 | -2,68 | 2021 |
| -5,85 | 0,18 | -2,30 | 0,68 | -0,54 | -0,46 | -2,20 | 0,80 | 0,21 | -0,90 | | | | 2022 |

09

Chiffres clés 1 an

(30.09.2021 – 30.09.2022, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|------------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -30,71% | 14,88% | -2,37 | 4,34% | 4,28% |
| MSCI EM TR Net | -24,15% | 12,79% | -2,09 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|------------------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -2,09 | 1,13 | -0,0541 | -30,71% | N/A |
| MSCI EM TR Net | | | | -24,15% | N/A |

*Taux sans risque: Libor 3M



4

Chiffres clés 5 ans

10

(30.09.2017 – 30.09.2022, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|------------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -2,41% | 16,00% | -0,17 | 3,53% | - |
| MSCI EM TR Net | -1,47% | 16,29% | -0,11 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|------------------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -0,27 | 0,96 | -0,0102 | -34,31% | N/A |
| MSCI EM TR Net | | | | -29,65% | N/A |

*Taux sans risque: Libor 3M



11

Chiffres clés Depuis le lancement

(26.06.2015 – 30.09.2022, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|------------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| Global Emerging Markets Equities I | 0,82% | 15,08% | 0,03 | 3,43% | - |
| MSCI EM TR Net | 1,57% | 15,41% | 0,08 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|------------------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| Global Emerging Markets Equities I | -0,21 | 0,96 | -0,0068 | -34,31% | N/A |
| MSCI EM TR Net | | | | -29,65% | N/A |

*Taux sans risque: Libor 3M

