

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Obligations

Gestion déléguée / gérant

Ellipsis Asset Management, Paris

Banque dépositaire

Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich

Administrateur

Credit Suisse Funds SA, Zurich

Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur

Ernst & Young SA, Lausanne

Numéro de valeur

Classe I: 117069211

Classe II: 27699760

Classe III: 117069250

Ticker Bloomberg

Classe I: PRGCAIO SW

Classe II: PRSCAEA SW

Classe III: PRGCAIC SW

Code ISIN

Classe I: CH1170692110

Classe II: CH0276997605

Classe III: CH1170692508

Devise de référence

Franc suisse (CHF)

Date de lancement

8 mai 2015

Date de fin d'exercice

31 mars

Benchmark officiel

Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged (Customized Index Hedged jusqu'au 31.12.2021)

Publication des cours

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission

CHF 1'000

VNI au 30.09.2024

Classe I: CHF 963,59

Classe II: CHF 964,83

Classe III: CHF 965,52

Fortune sous gestion

CHF 59,4 mio

Liquidité

hebdomadaire

Délai de souscription

jeudi 10h00

Délai de rachat de parts

jeudi 10h00

Date de règlement / souscription

T+2 (mardi)

Date de règlement / rachat de parts

T+2 (mardi)

Frais de souscription

aucun frais de souscription

Frais de rachat

les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts:

- 0,50% de 0 à 6 mois

- 0,25% de 6 à 12 mois

- 0% dès 12 mois

TER KGAST au 31.03.2024

Classe I: 1,09%

Classe II: 1,04%

Classe III: 1,01%

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.

Performances mensuelles

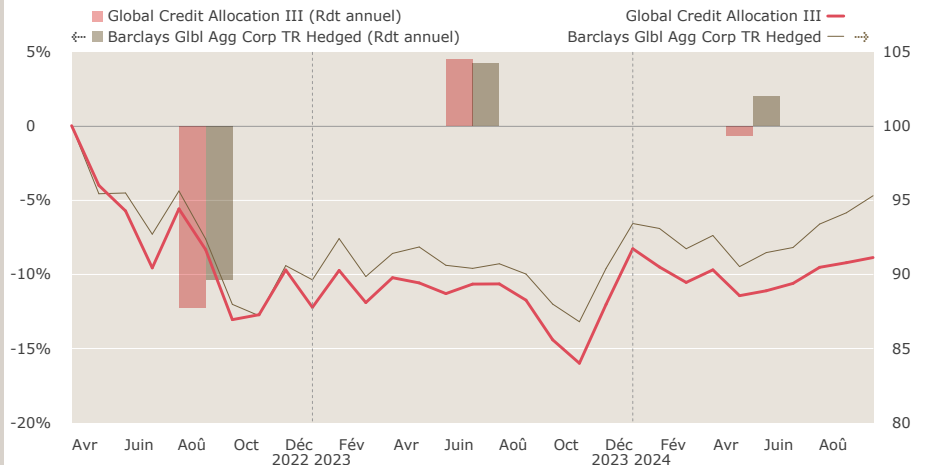
2022-2024

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]													
*Barclays Gbl Agg Corp TR Hed	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc		
-10,36	-12,22			-3,99	-1,80	-4,08	4,41	-2,92	-5,16	0,38	3,46	-2,80	2022	
4,24	4,51	2,84	-2,40	1,91	-0,39	-0,81	0,72	0,01	-1,23	-3,03	-1,85	4,73	4,27	2023
2,01	-0,65	-1,34	-1,15	0,95	-1,93	0,37	0,56	1,22	0,34	0,38				2024

*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

Performance cumulée

2022-2024, 01.04.2022=100



Analyse comparative

(01.04.2022 – 30.09.2024)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
Global Credit Allocation III	-8,86%	-0,28%	-3,64%	4,73%	50,00%	-5,16%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-4,69%	-0,13%	-1,90%	4,15%	50,00%	-4,78%
	3e trim. 2024	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
Global Credit Allocation III	1,95%	-16,00%	1,00	2,57%	8,90%	-0,46
Barclays Gbl Agg Corp TR H	3,81%	-13,19%	1,00	2,37%	8,21%	-0,28
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.	
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0,95	0,90	-0,0173	1,03	2,78%	

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Obligations

Gestion déléguée / gérant

Ellipsis Asset Management, Paris

Banque dépositaire

Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich

Administrateur

Credit Suisse Funds SA, Zurich

Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur

Ernst & Young SA, Lausanne

Numéro de valeur

Classe I: 117069211

Classe II: 27699760

Classe III: 117069250

Ticker Bloomberg

Classe I: PRGCAIO SW

Classe II: PRSCAEA SW

Classe III: PRGCAIC SW

Code ISIN

Classe I: CH1170692110

Classe II: CH0276997605

Classe III: CH1170692508

Devise de référence

Franc suisse (CHF)

Date de lancement

8 mai 2015

Date de fin d'exercice

31 mars

Benchmark officiel

Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged (Customized Index Hedged jusqu'au 31.12.2021)

Publication des cours

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission

CHF 1'000

VNI au 30.09.2024

Classe I: CHF 963,59

Classe II: CHF 964,83

Classe III: CHF 965,52

Fortune sous gestion

CHF 59,4 mio

Liquidité

hebdomadaire

Délai de souscription

jeudi 10h00

Délai de rachat de parts

jeudi 10h00

Date de règlement / souscription

T+2 (mardi)

Date de règlement / rachat de parts

T+2 (mardi)

Frais de souscription

aucun frais de souscription

Frais de rachat

les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts:

- 0,50% de 0 à 6 mois

- 0,25% de 6 à 12 mois

- 0% dès 12 mois

TER KGAST au 31.03.2024

Classe I: 1,09%

Classe II: 1,04%

Classe III: 1,01%

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.

Excess Returns

Global Credit Allocation III vs. Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged

Excess returns annuels [%]

Excess returns mensuels [%]

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc		
2022	-3,30			0,57	-1,85	-1,16	1,26	0,47	-0,38	1,25	-0,42	-1,74	2022	
2023	0,55	-0,27	0,37	0,17	-0,87	0,54	0,95	-0,33	-0,46	-0,78	-0,50	0,58	0,92	2023
2024	-5,34	-0,99	0,32	-0,03	0,34	-0,67	0,18	-0,51	-0,47	-0,84			2024	

Chiffres clés

1 an

(30.09.2023 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation III	6,49%	7,42%	0,81	2,08%	0,02%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	8,31%	6,56%	1,17		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation III	-0,82	1,08	-0,0232	-3,45%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-3,11%	4

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Chiffres clés

Depuis le lancement

(01.04.2022 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation III	-3,64%	8,90%	-0,46	2,78%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-1,90%	8,21%	-0,28		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation III	-0,64	1,03	-0,0173	-16,00%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-13,19%	N/A

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months