

**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 29.09.2023**

Classe I: CHF 905,58

Classe II: CHF 906,29

Classe III: CHF 906,67

**Fortune sous gestion**

CHF 56,4 mio

**Liquidité**

hebdomadaire

**Délai de souscription**

jeudi 17h00

**Délai de rachat de parts**

jeudi 17h00

**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 31.03.2023**

Classe I: 1,04%

Classe II: 0,94%\*

Classe III: 0,96%

\*valeur impactée par les mouvements de fortune qui ont eu lieu lors de la création des classes I et III le 01.04.2022

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**

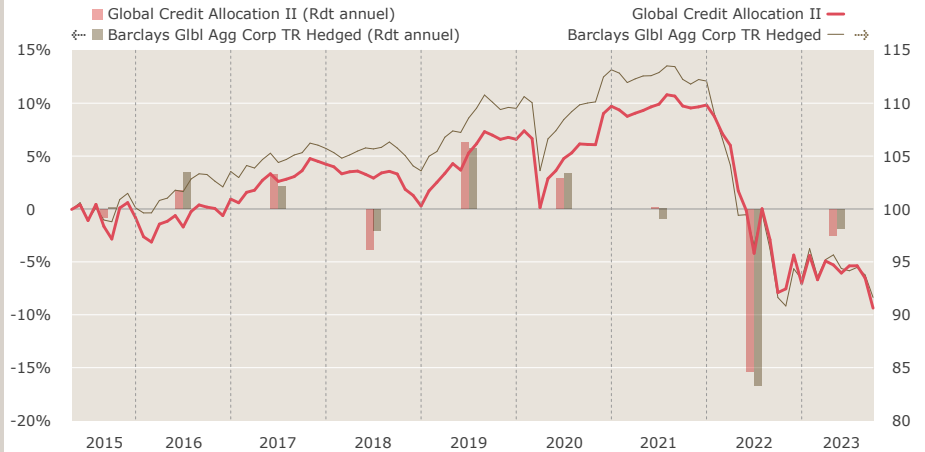
2016-2023

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
*Barclays Gbl Agg Corp TR Hed		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
3,43	1,78	-1,80	-0,52	1,75	0,27	0,54	-1,08	1,48	0,63	-0,21	-0,13	-0,67	1,57	2016
2,11	3,27	-0,35	0,99	0,20	0,92	0,60	-0,70	0,20	0,24	0,54	1,10	-0,25	-0,26	2017
-2,00	-3,79	-0,24	-0,64	0,19	0,06	-0,30	-0,34	0,47	0,15	-0,24	-1,40	-0,56	-0,99	2018
5,70	6,29	1,43	0,80	0,82	0,89	-0,59	1,56	0,84	1,07	-0,31	-0,37	0,18	-0,17	2019
3,33	2,93	0,75	-0,68	-6,12	2,74	0,73	1,11	0,51	0,80	-0,04	-0,02	2,78	0,63	2020
-0,95	0,11	-0,32	-0,55	0,27	0,24	0,31	0,23	0,81	-0,11	-0,85	-0,17	0,10	0,16	2021
-16,72	-15,35	-1,00	-1,48	-1,03	-4,06	-1,80	-4,08	4,40	-2,92	-5,16	0,38	3,46	-2,80	2022
-1,83	-2,52	2,84	-2,40	1,90	-0,39	-0,81	0,72	0,01	-1,23	-3,04				2023

\*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

**Performance cumulée**

2015-2023, 08.05.2015=100



**Analyse comparative**

(08.05.2015 – 30.09.2023)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
Global Credit Allocation II	-9,37%	-0,08%	-1,16%	4,40%	51,49%	-6,12%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-8,36%	-0,08%	-1,03%	3,88%	53,47%	-5,84%

	3e trim. 2023	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
Global Credit Allocation II	-4,22%	-18,20%	1,06	1,60%	5,55%	-0,28
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-2,67%	-19,99%	1,15	1,50%	5,18%	-0,27

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0,94	0,88	-0,0013	1,00	1,95%

\*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 29.09.2023**

Classe I: CHF 905,58

Classe II: CHF 906,29

Classe III: CHF 906,67

**Fortune sous gestion**

CHF 56,4 mio

**Liquidité**

hebdomadaire

**Délai de souscription**

jeudi 17h00

**Délai de rachat de parts**

jeudi 17h00

**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 31.03.2023**

Classe I: 1,04%

Classe II: 0,94%\*

Classe III: 0,96%

\*valeur impactée par les mouvements de fortune qui ont eu lieu lors de la création des classes I et III le 01.04.2022

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 II 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	
	-3,39	-1,33	-0,52	0,57	0,06	-0,20	-0,95	0,31	0,15	-0,14	0,48	-0,15	0,15	2016
	2,39	0,20	-0,12	0,43	0,15	0,03	0,14	-0,07	-0,16	0,33	0,25	-0,07	0,04	2017
	-3,48	0,14	-0,14	-0,10	-0,29	-0,58	-0,25	0,33	-0,33	0,30	-0,73	0,37	-0,54	2018
	1,25	0,09	0,37	-0,46	0,34	-0,46	0,29	-0,03	-0,06	0,30	0,27	-0,01	-0,09	2019
	-0,83	-0,27	-0,16	-0,28	-0,16	0,00	0,13	-0,18	0,21	-0,20	-0,12	0,64	0,02	2020
	2,10	-0,04	0,24	-0,04	-0,01	0,29	-0,04	0,26	-0,05	0,22	0,22	-0,29	0,29	2021
	2,30	1,79	0,68	1,29	0,49	-1,85	-1,17	1,26	0,47	-0,38	1,25	-0,42	-1,74	2022
	-1,35	-0,27	0,37	0,17	-0,87	0,54	0,95	-0,33	-0,47	-0,78				2023

**Chiffres clés**

1 an

(30.09.2022 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation II	-1,60%	7,33%	-0,27	2,92%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0,02%	7,02%	-0,05		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation II	-0,56	0,96	-0,0164	-5,25%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-4,79%	N/A

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

**Chiffres clés**

5 ans

(30.09.2018 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation II	-2,58%	6,59%	-0,45	2,20%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-2,82%	6,33%	-0,51		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation II	0,11	0,98	0,0019	-18,20%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-19,99%	N/A

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

## Chiffres clés

Depuis le lancement

(08.05.2015 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation II	-1,16%	5,55%	-0,28	1,95%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-1,03%	5,18%	-0,27		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation II	-0,07	1,00	-0,0013	-18,20%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-19,99%	N/A

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