

PRISMA ESG Global Credit Allocation

ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT, PARIS

Gestion déléguée depuis le 08.05.2015

Ce groupe de placements propose, sur une durée d'investissement recommandée de trois ans, une gestion dynamique sur l'ensemble des marchés obligataires mondiaux: obligations d'entreprise, obligations convertibles, obligations d'état et instruments monétaires. Il offre ainsi une approche originale d'allocation d'actifs obligataires, basée notamment sur des indicateurs quantitatifs et macroéconomiques, permettant une exposition opportune aux catégories offrant des perspectives de croissance ou de rendement. Le gérant ajuste ainsi ses choix entre des actifs défensifs et risqués pour une gestion flexible face aux cycles des marchés des taux et des marchés du crédit.

PERFORMANCE INDEXÉE*

PRISMA ESG Global Credit Allocation (08.05.2015=100, 05.07.2024=94,89)

— PRISMA ESG Global Credit Allocation
— Customized Index Hedged



PERFORMANCES MENSUELLES*

Performances annuelles [%] | Performances mensuelles [%]

Customized Index Hedged	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.		
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
4,24	4,48	2,84	-2,40	1,90	-0,39	-0,81	0,72	0,01	-1,23	-3,04	-1,85	4,73	4,26	2023
-1,73	-2,57	-1,35	-1,15	0,95	-1,93	0,37	0,56							2024

PERFORMANCES AU 5 JUILLET 2024*

	2021	2022	2023	2024	Depuis le 08.05.15	Vol. ann.
PRISMA ESG Global Credit Allocation	0,11%	-15,35%	4,48%	-2,31%	-5,11%	5,33%
Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged	-0,95%	-16,72%	4,24%	-1,08%	-3,74%	4,43%

*Les performances se réfèrent à la classe II.

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Obligations

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 05.07.2024

Classe I: CHF 947,79

Classe II: CHF 948,90

Classe III: CHF 949,51

Fortune sous gestion

CHF 58,5 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

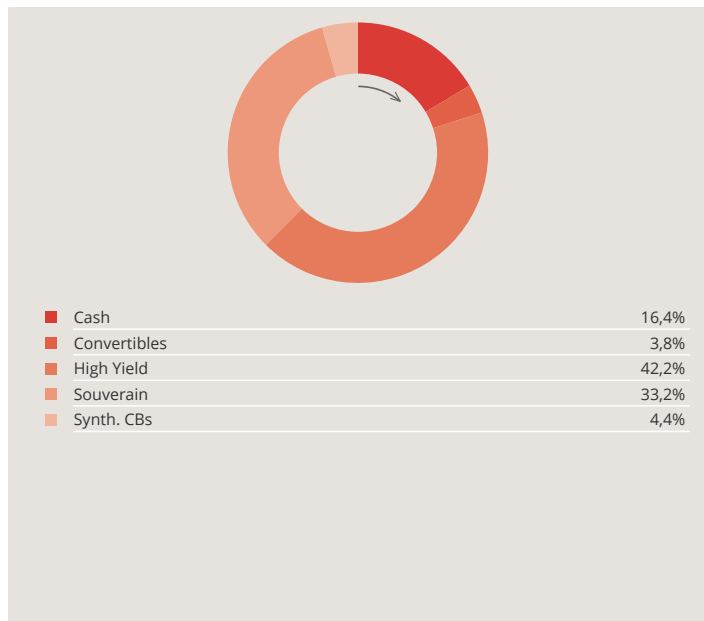
Classe I: 1,04%

Classe II: 0,94%*

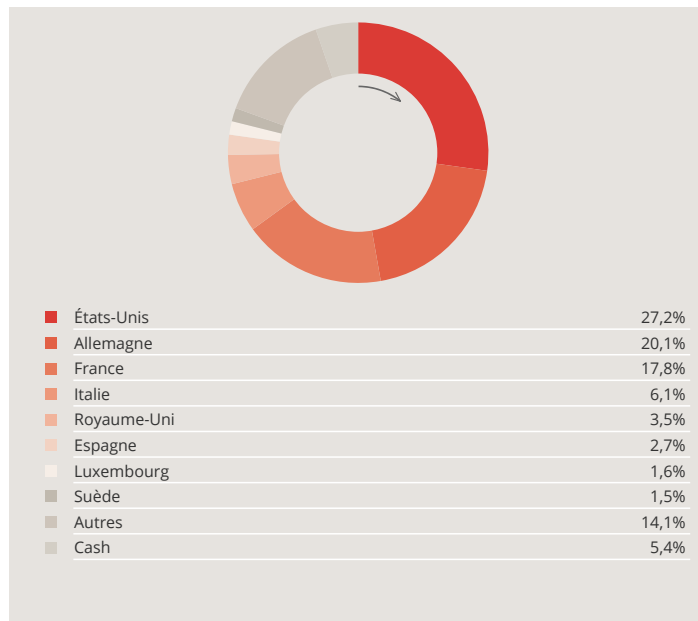
Classe III: 0,96%

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

RÉPARTITION PAR CLASSES D'ACTIFS



RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



POINTS CLÉS

- [+] Une allocation exposée aux segments obligataires mondiaux;
- [+] Un processus de gestion flexible, basé sur la vision top-down d'Ellipsis AM et une approche quantitative;
- [+] Un accès aux gestions spécialisées d'Ellipsis-AM.

CLASSIFICATION SFDR

Le fonds sous-jacent est classifié «Article 8».

LA FONDATION D'INVESTISSEMENT PRISMA ENTRE PROFESSIONNELS DE LA PRÉVOYANCE

PRISMA est une fondation d'investissement à but non lucratif créée en 2000 sous l'impulsion d'institutions de prévoyance du 2^e pilier. Aujourd'hui, PRISMA figure comme l'une des rares institutions en Suisse pilotée par des professionnels de la prévoyance pour des professionnels de la prévoyance. La Fondation compte un grand nombre de membres-investisseurs, auxquels elle offre avec la plus grande transparence la gestion d'une gamme de placements diversifiée et innovante. Architecture ouverte, PRISMA gère des approches et des techniques de gestion spécialisées avec un ratio rendement/risque attrayant et répondant aux attentes spécifiques des caisses de pension.

Avec une volonté affirmée de ne pas reproduire ce qui existe déjà, PRISMA propose des solutions d'investissement spécifiques et novatrices.

GROUPES DE PLACEMENTS

Actions

PRISMA ESG SPI® Efficient
 PRISMA Global Residential Real Estate
 PRISMA ESG Sustainable SOCIETY
 PRISMA ESG China Equities
 PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities

Obligations

PRISMA ESG World Convertible Bonds
 PRISMA ESG Global Credit Allocation
 PRISMA ESG CHF Bonds

Infrastructure

PRISMA ESG Global Infrastructure

Produits Alternatifs

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1
 PRISMA Alternative Multi-Manager
 PRISMA SHARP

Immobilier

PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate
 PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Fondation - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tél. 0848 106 106 - info@prisma-fondation.ch - www.prisma-fondation.ch

Ce document commercial est exclusivement conçu à des fins d'information et ne constitue pas un conseil en investissement de produits financiers. Du fait de leur simplification, les informations contenues dans ce document peuvent n'être que partielles. Elles peuvent être subjectives et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Toutes ces données ont été établies de bonne foi sur la base d'informations de marché. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. La responsabilité de PRISMA Fondation ne saurait être engagée par une prise de décision sur la base de ces informations. Il est recommandé aux investisseurs qui envisagent d'investir dans ce produit, de ne pas fonder leur décision sur les seuls éléments contenus dans ce document. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus sans frais auprès de PRISMA Fondation.