

**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 28.06.2024**

Classe I: CHF 945,31

Classe II: CHF 946,40

Classe III: CHF 947,01

**Fortune sous gestion**

CHF 58,3 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**

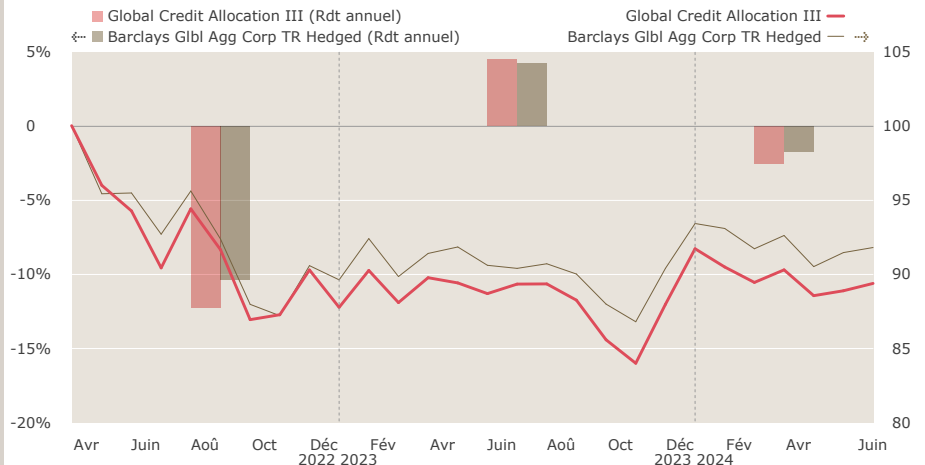
2022-2024

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
-1,73 -2,55	-1,34	-1,15	0,95	-1,93	0,37	0,56							2024

\*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

**Performance cumulée**

2022-2024, 01.04.2022=100



**Analyse comparative**

(01.04.2022 – 30.06.2024)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
Global Credit Allocation III	-10,61%	-0,38%	-4,86%	4,73%	44,44%	-5,16%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-8,18%	-0,29%	-3,72%	4,15%	44,44%	-4,78%

	2e trim. 2024	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
Global Credit Allocation III	-1,01%	-16,00%	0,80	2,69%	9,32%	-0,58
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-0,88%	-13,19%	0,80	2,45%	8,49%	-0,49

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0,95	0,91	-0,0101	1,04	2,88%

\*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 28.06.2024**

Classe I: CHF 945,31

Classe II: CHF 946,40

Classe III: CHF 947,01

**Fortune sous gestion**

CHF 58,3 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 III vs. Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged

Excess returns annuels [%]

Excess returns mensuels [%]

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	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	-1,60	-0,99	0,32	-0,03	0,34	-0,67	0,18							2024

**Chiffres clés**

1 an

(30.06.2023 – 30.06.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation III	0,05%	8,29%	-0,04	2,04%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	1,56%	7,04%	0,17		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation III	-0,73	1,15	-0,0167	-5,99%	2
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-4,32%	2

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

**Chiffres clés**

Depuis le lancement

(01.04.2022 – 30.06.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
Global Credit Allocation III	-4,86%	9,32%	-0,58	2,88%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-3,72%	8,49%	-0,49		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
Global Credit Allocation III	-0,41	1,04	-0,0101	-16,00%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-13,19%	N/A

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