

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

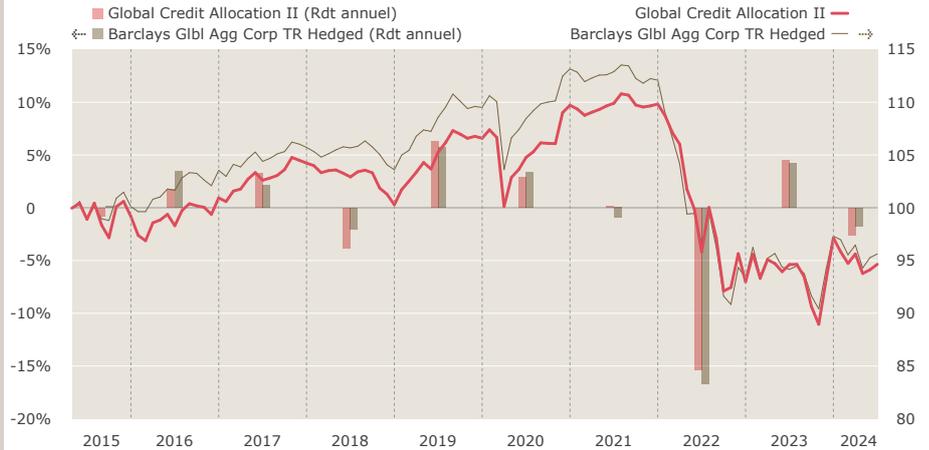
2017-2024

| Performances annuelles [%] | | Performances mensuelles [%] | | | | | | | | | | | | |
|-------------------------------|--------|-----------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| *Barclays Gbl Agg Corp TR Hed | | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | 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 |

*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

Performance cumulée

2015-2024, 08.05.2015=100



Analyse comparative

(08.05.2015 - 30.06.2024)

| | Performance cumulée | Moyenne arithmétique | Performance annualisée | Meilleur mois | Mois positifs | Moins bon mois |
|-----------------------------|---------------------|----------------------|------------------------|---------------|---------------|----------------|
| Global Credit Allocation II | -5,36% | -0,04% | -0,60% | 4,73% | 51,82% | -6,12% |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | -4,38% | -0,03% | -0,49% | 4,15% | 53,64% | -5,84% |

| | 2e trim. 2024 | Drawdown maximum | Ratio gains:pertes | Ecart-type | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* |
|-----------------------------|---------------|------------------|--------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| Global Credit Allocation II | -1,02% | -19,71% | 1,08 | 1,68% | 5,83% | -0,17 |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | -0,88% | -20,37% | 1,16 | 1,56% | 5,39% | -0,16 |

| | Corrél.* | R2* | Alpha de Jensen ann.* | Bêta* | Tracking Err. ann. |
|----------------------------|----------|------|-----------------------|-------|--------------------|
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | 0,94 | 0,89 | -0,0010 | 1,02 | 1,96% |

*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 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 | |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2017 | 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 |
| 2018 | -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 |
| 2019 | 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 |
| 2020 | -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 |
| 2021 | 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 |
| 2022 | 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 |
| 2023 | 0,49 | -0,27 | 0,37 | 0,17 | -0,87 | 0,54 | 0,95 | -0,33 | -0,47 | -0,78 | -0,50 | 0,58 | 0,91 |
| 2024 | -1,63 | -0,99 | 0,32 | -0,03 | 0,33 | -0,67 | 0,18 | | | | | | |

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 II | 0,02% | 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 II | -0,75 | 1,15 | -0,0170 | -6,00% | 2 |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | | | | -4,32% | 2 |

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

Chiffres clés

5 ans

(30.06.2019 – 30.06.2024, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|-----------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| Global Credit Allocation II | -2,11% | 7,22% | -0,35 | 2,25% | - |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | -2,51% | 6,85% | -0,42 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|-----------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| Global Credit Allocation II | 0,18 | 1,00 | 0,0041 | -19,71% | N/A |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | | | | -20,37% | N/A |

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

Chiffres clés

Depuis le lancement

(08.05.2015 – 30.06.2024, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|-----------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| Global Credit Allocation II | -0,60% | 5,83% | -0,17 | 1,96% | - |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | -0,49% | 5,39% | -0,16 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|-----------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| Global Credit Allocation II | -0,06 | 1,02 | -0,0010 | -19,71% | N/A |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H | | | | -20,37% | N/A |

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