

1

PRISMA Credit Allocation Europe
CH0276997605

VNI: CHF 1'106,72

Gestion déléguée	Ellipsis Asset Management
Banque dépositaire	Credit Suisse, Zurich
Administrateur	Credit Suisse, Zurich
Distribution	Key Investment Services (KIS) SA, Morges
Auditeur	Ernst & Young, Lausanne
Numéro de valeur / Bloomberg	27 699 760 / PRSCAE SW
Monnaie de référence	Francs suisses (CHF)
Date de lancement	8 mai 2015
Benchmark	Customized Index: 40% eb. rexx® Government Germany 5.5-10.5, 25% Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index, 25% Exane Top ECI 25, 10% EONIA capitalisé, hedgé uniquement depuis le 01.04.2017
Date de fin d'exercice	31 mars
Publication des cours	Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et www.prisma-fondation.ch
Liquidité	hebdomadaire
Prix d'émission	CHF 1000.-
Frais	Aucun frais de souscription. Les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts.
TER KGAST	0,90%
Prisma Fondation d'investissement Rue du Sablon 2 Case postale CH-1110 Morges 1 Tél.: 0848 106 106 www.prisma-fondation.ch info@prisma-fondation.ch	

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.

01

Performances mensuelles

2015-2021

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]													
	*Customized Index Hedged	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov		Déc
0,10	-0,83					0,40	-1,48	1,55	-2,08	-1,21	3,02	0,51	-1,43	2015
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
0,26	0,88	-0,32	-0,55	0,27	0,24	0,31	0,23	0,81	-0,11					2021

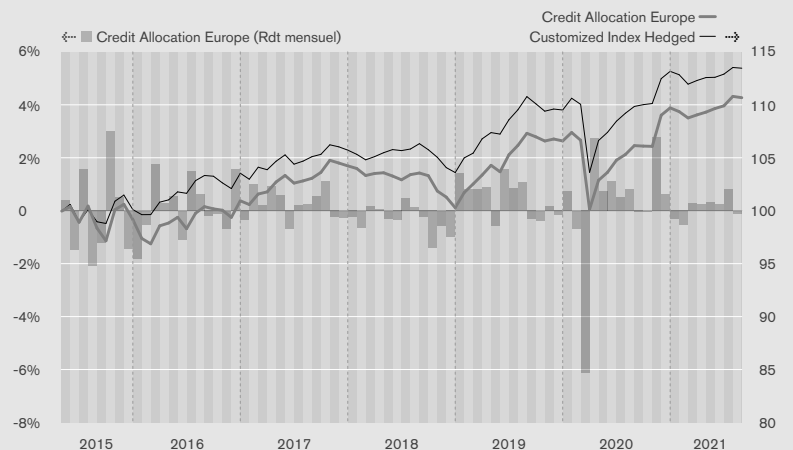


*Customized Index: 40% eb. rexx® Government Germany 5.5-10.5, 25% Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index, 25% Exane Top ECI 25, 10% EONIA capitalisé, hedgé uniquement depuis le 01.04.2017.

02

Performance cumulée

2015-2021, 08.05.2015=100



03

Analyse comparative

(08.05.2015 – 31.08.2021)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
Credit Allocation Europe	10,67%	0,14%	1,61%	3,02%	56,58%	-6,12%
Customized Index Hedged	13,46%	0,17%	2,01%	2,90%	60,53%	-5,84%
	Drawdown maximum	Ratio gains:perdes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	
Credit Allocation Europe	-6,76%	1,30	1,21%	4,20%	0,44	
Customized Index Hedged	-6,46%	1,53	1,06%	3,68%	0,60	
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.	
Customized Index Hedged	0,95	0,91	-0,0059	1,09	1,32%	



*Taux sans risque: Libor 3M