

Données au 30.09.2024

### Objectifs et univers d'investissement

|                 |                        |
|-----------------|------------------------|
| Classe d'actifs | Fonds alternatif UCITS |
| Catégorie       | Fonds alternatifs      |

Le fonds BCV Systematic Premia Global recherche l'appréciation du capital à long terme et une faible corrélation aux principales classes d'actifs. Il vise donc à générer un rendement absolu positif indépendamment des conditions de marché, et offre ainsi un grand potentiel de diversification aux portefeuilles traditionnels. Il poursuit cet objectif en investissant dans un large éventail de primes de risques alternatives qui permettent de répliquer des expositions à des stratégies du type Equity Market Neutral, Trend Following et Macro Trading. Ces stratégies sont implémentées dans différentes classes d'actifs telles que les actions, les devises, les obligations et les matières premières.

Classe C (USD): ouverte aux investisseurs qui souscrivent et maintiennent pour CHF 30 millions (ou équivalent) au minimum. Libellée en dollar des Etats-Unis.

### Caractéristiques du fonds

|                        |                                 |
|------------------------|---------------------------------|
| Structure légale       | FCP                             |
| Domicile du fonds      | Luxembourg                      |
| Gestionnaire du fonds  | Frederic Sonney<br>Maxime Borel |
| Date de création       | 08.03.2022                      |
| N° de valeur / ISIN    | 58470318 / LU2264523890         |
| Devise de référence    | USD                             |
| Liquidité              | Hebdomadaire                    |
| VNI                    | USD 108.59                      |
| Cours extrêmes 2024    | USD 112.80 / 107.08             |
| Fortune en millions    | USD 35.61                       |
| Commission forfaitaire | 0.75%                           |
| TER au 30.06.2024      | 0.78%                           |
| Dernière distribution  | aucune distribution             |

Frais accessoires à l'émission / au rachat (en faveur du fonds) :  
0.10% / 0.10%

### Emission et rachat de parts

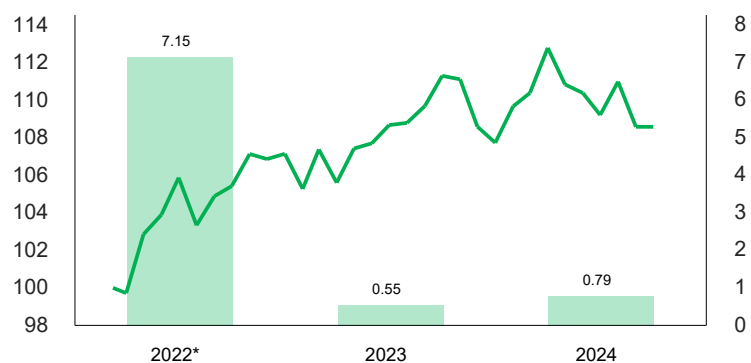
|   |                          |
|---|--------------------------|
| Jour / heure limite ordres client                     | J-1 13:15* / J-1 14h00** |
| Date VNI (date de référence pour les cours du marché) | J (=Mardi)               |
| Date valeur   | max. J+3                 |
| Liquidité   | Hebdomadaire             |

\*heure limite auprès de la BCV

\*\*heure limite auprès de EFA

### Performances en USD (%)

|                                      | 1 mois      | 3 mois       | YTD         | 1 an         | annualisées |       |
|--------------------------------------|-------------|--------------|-------------|--------------|-------------|-------|
|                                      |             |              |             |              | 3 ans       | 5 ans |
| <b>Fonds</b>                         | <b>0.00</b> | <b>-0.58</b> | <b>0.79</b> | <b>-2.44</b> | -           | -     |
| <b>Volatilité<sup>(1)</sup></b>      |             |              |             | <b>5.04</b>  | -           | -     |
| <b>Ratio de Sharpe<sup>(1)</sup></b> |             |              |             | <b>-1.60</b> | -           | -     |



\* Depuis le 08/03/2022

### Profil de risque



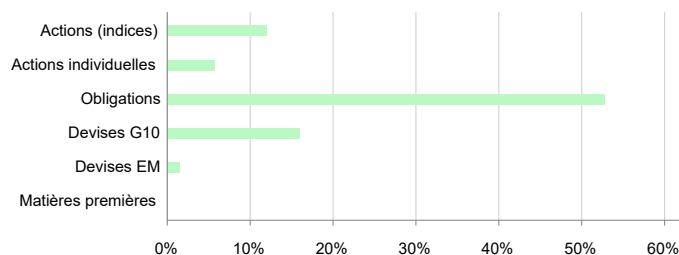
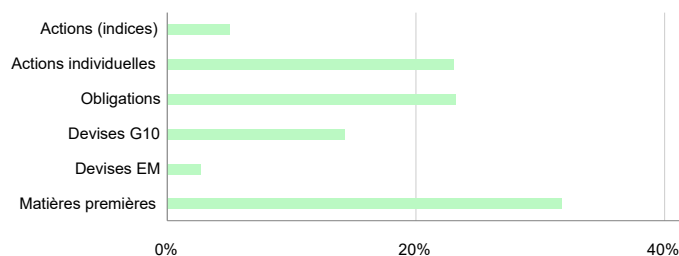
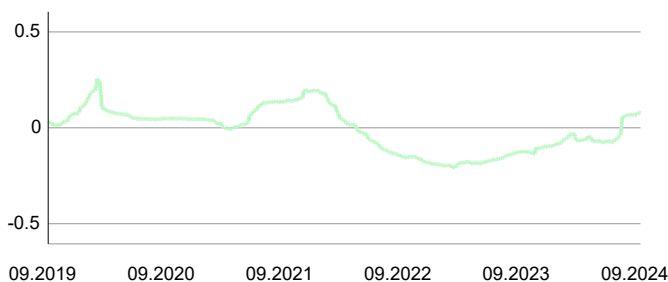
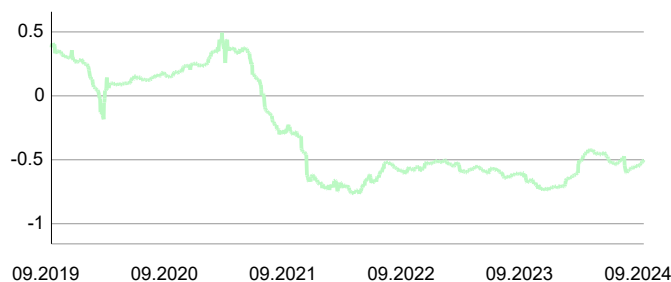
L'indicateur synthétique de risque (SRI) permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres, en prenant en compte les risques de marché et de crédit. Sa méthode de calcul se base sur l'hypothèse que l'investisseur conserve le fonds pendant la période de détention recommandée.

Données au 30.09.2024

**Contribution à la performance brute (en %)**

|                              | Allocation*   | mtd          | ytd*         | itd          |
|------------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>Equity Market Neutral</b> | <b>33.42</b>  | <b>-0.63</b> | <b>-0.19</b> | <b>1.15</b>  |
| Equity MN Value              | 6.86          | -0.64        | -1.06        | 0.88         |
| Equity MN Momentum           | 5.55          | -0.25        | 1.43         | 4.11         |
| Equity MN LowBeta            | 6.02          | -0.07        | 2.01         | 0.37         |
| Equity MN Size               | 8.35          | 0.36         | -2.09        | -3.87        |
| Equity MN Quality            | 6.63          | -0.04        | -0.48        | -0.34        |
| <b>Trend following</b>       | <b>33.45</b>  | <b>0.68</b>  | <b>-2.96</b> | <b>-1.16</b> |
| Trend Equity                 | 11.15         | 0.11         | 0.31         | -1.74        |
| Trend Fixed Income           | 11.15         | 0.35         | -1.58        | 1.74         |
| Trend FX                     | 11.15         | 0.22         | -1.69        | -1.17        |
| <b>Macro Trading</b>         | <b>33.14</b>  | <b>-0.44</b> | <b>0.97</b>  | <b>1.47</b>  |
| FI Carry                     | 9.06          | 0.04         | 0.61         | -0.23        |
| FX Value                     | 6.15          | -0.05        | -0.65        | -1.30        |
| FX Carry                     | 5.82          | 0.06         | 0.73         | 1.50         |
| Commo Carry Cross            | 7.96          | -0.31        | -0.23        | 0.23         |
| Commo Carry Slope            | 4.16          | -0.18        | 0.50         | 1.26         |
| <b>Total</b>                 | <b>100.00</b> | <b>-0.39</b> | <b>-2.18</b> | <b>1.45</b>  |

\* en % du risque total

**Exposition nette, par classe d'actifs**

**Exposition brute par classe d'actifs (en % de l'expo. actuelle de 3.18x)**

**Beta au marché actions, 1 an roulant\*\***

**Beta au marché obligataire, 1 an roulant\*\***


\*\* Statistique simulée avant lancement au 8 mars 2022

**Statistiques sur 3 ans\*\*\* Fonds**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Rendement total                | 8.59%  |
| Performance annualisée         | 3.27%  |
| Ratio de Sharpe <sup>(1)</sup> | -0.24  |
| Mois positifs                  | 63.33% |
| Baisse max. <sup>(1)</sup>     | -3.73% |

Taux hors risque 4.67%

\*\*\* ou depuis le lancement du fonds si moins de 3 ans

**Performances mensuelles en USD (%)**

|              | 2020<br>Fonds | 2021<br>Fonds | 2022<br>Fonds | 2023<br>Fonds | 2024<br>Fonds |
|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Janvier      |               |               |               | -1.75         | 1.80          |
| Février      |               |               |               | 1.99          | 0.65          |
| Mars         |               |               | -0.28         | -1.65         | 2.18          |
| Avril        |               |               | 3.15          | 1.72          | -1.73         |
| Mai          |               |               | 1.01          | 0.26          | -0.41         |
| Juin         |               |               | 1.91          | 0.90          | -1.06         |
| Juillet      |               |               | -2.40         | 0.11          | 1.63          |
| Août         |               |               | 1.50          | 0.83          | -2.17         |
| Septembre    |               |               | 0.51          | 1.47          | 0.00          |
| Octobre      |               |               | 1.62          | -0.17         |               |
| Novembre     |               |               | -0.25         | -2.27         |               |
| Décembre     |               |               | 0.26          | -0.79         |               |
| <b>Année</b> |               |               | <b>7.15</b>   | <b>0.55</b>   | <b>0.79</b>   |

Données au 30.09.2024

BCV Asset Management  
Place St-François 14  
1003 Lausanne  
Tél. 021/212 20 51  
Email: [fonds@bcv.ch](mailto:fonds@bcv.ch)  
Site Internet: [www.bcv.ch/invest](http://www.bcv.ch/invest)

BCV Asset Management  
Talstrasse 70  
8001 Zürich  
Tél. 044/ 388 71 30  
Email: [fonds@bcv.ch](mailto:fonds@bcv.ch)

BCV Fund Desk  
Place St-François 14  
1003 Lausanne - Suisse  
Tél. 021/ 212 40 26  
Fax. 021/ 212 16 56  
Email: [fund.desk@bcv.ch](mailto:fund.desk@bcv.ch)

Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat  
1, Place de Metz  
L-2954 Luxembourg  
Tél. (+352) 4015-1

<sup>(1)</sup> Fréquence de calcul des données de risque: mensuelle

Sources: BCV / GERIFONDS/ EFA  
Copyright BCV

#### INFORMATIONS IMPORTANTES

Ce document est une fiche mensuelle de marketing. Les informations et opinions contenues dans ce document ont été obtenues de sources dignes de foi à la date de la publication. Elles n'engagent pas la responsabilité de la BCV et sont susceptibles de modifications sans préavis. Ce document a été élaboré par le Département Asset Management dans un but purement informatif et ne constitue pas un appel d'offre, une offre d'achat ou de vente, une recommandation personnalisée d'investissement ou une analyse financière au sens des «Directives visant à garantir l'indépendance de l'analyse financière» de l'Association suisse des banquiers. Les rapports annuels et semestriels, les prospectus et contrats de fonds de même que les KID des fonds de placement gérés ou distribués par la BCV peuvent être obtenus gratuitement auprès de la BCV, place St-François 14, 1003 Lausanne, ou auprès de la direction de fonds GERIFONDS SA, représentant du fonds en Suisse ([www.gerifonds.ch](http://www.gerifonds.ch)). Les risques liés à certains placements, en particulier les placements alternatifs, les dérivés et les pays émergents, ne conviennent pas à tous les investisseurs. Pour obtenir de plus amples détails sur les produits, veuillez consulter la brochure Swiss Banking relative aux risques particuliers dans le négoce de titres. La performance historique ne représente pas un indicateur de performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission/achat et du rachat/vente des parts. Le compartiment n'ayant pas d'indice de référence, sa performance n'est pas comparée à un tel indice. Le contenu de ce document a pu être utilisé pour des transactions par le Groupe BCV avant sa communication. La diffusion de ce document et/ou la vente de certains produits peuvent être interdites ou sujettes à des restrictions pour des personnes dépendantes d'autres ordres juridiques que la Suisse (par ex. UE, UK, US et US persons).