

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 (CHF): ouverte aux investisseurs qui souscrivent et maintiennent pour CHF 30 millions (ou équivalent) au minimum. Libellée en franc suisse et couverte contre le risque de change.

Caractéristiques du fonds

Structure légale	FCP
Domicile du fonds	Luxembourg
Gestionnaire du fonds	Frederic Sonney Maxime Borel
Date de création	08.03.2022
N° de valeur / ISIN	58470355 / LU2264524948
Devise de référence	CHF
Liquidité	Hebdomadaire
VNI	CHF 99.81
Cours extrêmes 2024	CHF 105.77 / 99.10
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) : 0.12% / 0.12%

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 CHF (%)

	1 mois	3 mois	YTD	1 an	annualisées	
					3 ans	5 ans
Fonds	-0.37	-1.58	-2.02	-6.12	-	-
Volatilité⁽¹⁾				5.06	-	-
Ratio de Sharpe⁽¹⁾				-1.53	-	-



* 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.

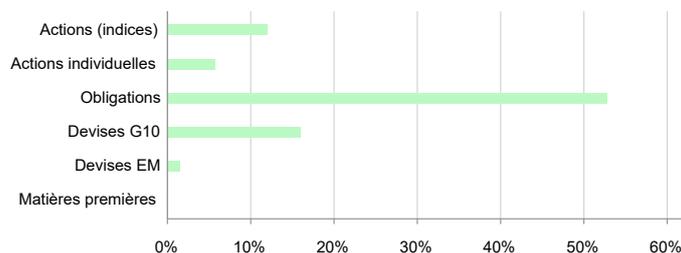
Données au 30.09.2024

Contribution à la performance brute (en %)

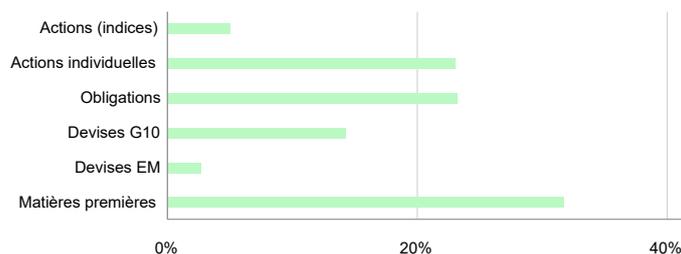
	Allocation*	mtd	ytd*	itd
Equity Market Neutral	33.42	-0.63	-0.19	1.15
Equity MN Value	6.86	-0.64	-1.06	0.88
Equity MN Momentum	5.55	-0.25	1.43	4.11
Equity MN LowBeta	6.02	-0.07	2.01	0.37
Equity MN Size	8.35	0.36	-2.09	-3.87
Equity MN Quality	6.63	-0.04	-0.48	-0.34
Trend following	33.45	0.68	-2.96	-1.16
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
Macro Trading	33.14	-0.44	0.97	1.47
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
Total	100.00	-0.39	-2.18	1.45

* en % du risque total

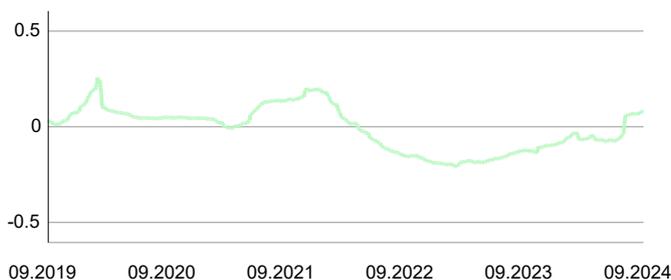
Exposition nette, par classe d'actifs



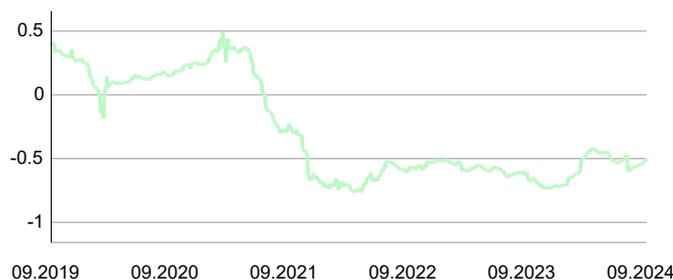
Exposition brute par classe d'actifs (en % de l'expo. actuelle de 3.18x)



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	-0.19%
Performance annualisée	-0.07%
Ratio de Sharpe ⁽¹⁾	-0.15
Mois positifs	50.00%
Baisse max. ⁽¹⁾	-6.12%
Taux hors risque	0.88%

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

Performances mensuelles en CHF (%)

	2020	2021	2022	2023	2024
	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds
Janvier				-2.07	1.51
Février				1.71	0.35
Mars			-0.36	-2.12	1.93
Avril			3.10	1.43	-2.07
Mai			0.89	-0.09	-0.77
Juin			1.83	0.53	-1.33
Juillet			-2.59	-0.16	1.27
Août			1.32	0.49	-2.45
Septembre			0.40	1.25	-0.37
Octobre			1.44	-0.50	
Novembre			-0.48	-2.58	
Décembre			-0.20	-1.15	
Année			5.38	-3.33	-2.02

Données au 30.09.2024

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

BCV Asset Management
Talstrasse 70
8001 Zürich
Tél. 044/ 388 71 30
Email: 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

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

⁽¹⁾ 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). 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).