

**CARACTÉRISTIQUES**

**Classification OPP 2**

Obligations

**Gestion déléguée / gérant**

Lazard Asset Management LLC, New York

**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: 111735898

Classe II: 1179845

Classe III: 111735916

**Ticker Bloomberg**

Classe I: PRWCBCH SW

Classe II: PRIOBCM SW

Classe III: PRWCBIC SW

**Code ISIN**

Classe I: CH1117358981

Classe II: CH0011798458

Classe III: CH1117359161

**Devise de référence**

Franc suisse (CHF)

**Date de lancement**

26 janvier 2001

**Date de fin d'exercice**

31 mars

**Benchmark officiel**

Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

**Publication des cours**

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

**Prix d'émission**

CHF 1'000

**VNI au 28.06.2024**

Classe I: CHF 1'276,86

Classe II: CHF 1'278,29

Classe III: CHF 1'279,15

**Fortune sous gestion**

CHF 85,1 mio

**Liquidité**

hebdomadaire

**Délai de souscription**

jeudi 17h00

**Délai de rachat de parts**

lundi 17h00

**Date de règlement / souscription**

T+3 (mercredi)

**Date de règlement / rachat de parts**

T+4 (jeudi)

**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: 0,67%

Classe II: 0,59%\*

Classe III: 0,59%

\*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**

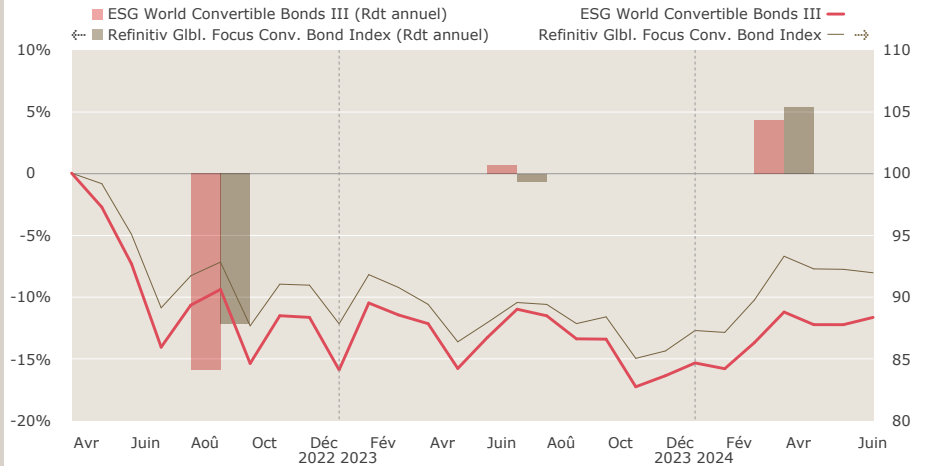
2022-2024

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]													
*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc		
-12,16	-15,89			-2,71	-4,72	-7,28	3,96	1,42	-6,62	4,57	-0,15	-4,81	2022	
-0,62	0,67	6,44	-1,08	-0,80	-4,13	2,98	2,63	-0,60	-2,11	-0,03	-4,46	1,08	1,24	2023
5,36	4,36	-0,55	2,51	2,87	-1,15	-0,00	0,67							2024

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**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
ESG World Convertible Bo	-11,64%	-0,40%	-5,35%	6,44%	40,74%	-7,28%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-8,03%	-0,27%	-3,65%	4,54%	40,74%	-6,26%

	2e trim. 2024	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG World Convertible Bo	-0,49%	-17,26%	0,69	3,42%	11,85%	-0,49
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-1,44%	-14,96%	0,69	2,86%	9,92%	-0,41

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,98	0,95	-0,0109	1,17	3,05%

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

**CARACTÉRISTIQUES**

**Classification OPP 2**

Obligations

**Gestion déléguée / gérant**

Lazard Asset Management LLC, New York

**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: 111735898

Classe II: 1179845

Classe III: 111735916

**Ticker Bloomberg**

Classe I: PRWCBCH SW

Classe II: PRIOBCM SW

Classe III: PRWCBIC SW

**Code ISIN**

Classe I: CH1117358981

Classe II: CH0011798458

Classe III: CH1117359161

**Devise de référence**

Franc suisse (CHF)

**Date de lancement**

26 janvier 2001

**Date de fin d'exercice**

31 mars

**Benchmark officiel**

Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

**Publication des cours**

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

**Prix d'émission**

CHF 1'000

**VNI au 28.06.2024**

Classe I: CHF 1'276,86

Classe II: CHF 1'278,29

Classe III: CHF 1'279,15

**Fortune sous gestion**

CHF 85,1 mio

**Liquidité**

hebdomadaire

**Délai de souscription**

jeudi 17h00

**Délai de rachat de parts**

lundi 17h00

**Date de règlement / souscription**

T+3 (mercredi)

**Date de règlement / rachat de parts**

T+4 (jeudi)

**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: 0,67%

Classe II: 0,59%\*

Classe III: 0,59%

\*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**

ESG World Convertible Bonds III vs. Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

Excess returns annuels [%]

Excess returns mensuels [%]

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc		
2022	-6,42			-1,90	-0,58	-1,02	1,05	0,22	-1,05	0,71	-0,06	-1,38	2022	
2023	2,58	1,91	0,05	0,71	-0,73	1,17	0,79	-0,43	-0,37	-0,65	-0,65	0,38	-0,70	2023
2024	-2,09	-0,38	-0,50	-1,08	-0,05	0,03	0,98						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
ESG World Convertible Bo	-0,74%	6,93%	-0,16	1,89%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	2,69%	7,20%	0,32		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	-1,80	0,94	-0,0326	-7,06%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-5,05%	4

\*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
ESG World Convertible Bo	-5,35%	11,85%	-0,49	3,05%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-3,65%	9,92%	-0,41		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	-0,59	1,17	-0,0109	-17,26%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-14,96%	N/A

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