

## 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: PRWCBC 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 30.06.2023

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

### Fortune sous gestion

CHF 83,7 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.

## Commentaire trimestriel du gérant

Le deuxième trimestre s'est révélé favorable aux actifs risqués, soutenus par une croissance économique plus résiliente que prévue, des résultats trimestriels solides et une moindre volatilité sur les taux d'intérêt. Bien que l'inflation élevée ait incité les banques centrales mondiales à rester vigilantes, le marché s'est concentré sur les tendances positives de la désinflation et sur l'anticipation de la fin du cycle de hausse des taux d'intérêt. En effet, malgré des ralentissements observés à l'échelle mondiale dans les secteurs manufacturiers et de l'immobilier, le volet consommation de l'économie s'est révélé plus résilient qu'attendu. Dans ce contexte, les obligations convertibles internationales se sont bien comportées, leur exposition sectorielle et leurs structures convexes, s'avérant avantageuses pour la classe d'actifs.

Sur la période, le groupe de placements PRISMA ESG World Convertible Bonds a enregistré une performance de +1,33%, contre +0,17% pour son indice de référence, le Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index en CHF. Nous avons maintenu une surexposition aux actions, en hausse sur le trimestre, se situant à 59,1% contre 54,4% pour l'indice. La sensibilité taux a baissé sur le trimestre, en ligne avec l'indice, se situant à 1,51 contre 1,52 pour l'indice.

Aux États-Unis, nous avons renforcé notre exposition aux semi-conducteurs, médias et services aux collectivités, et réduit notre exposition aux services de paiement, aux logiciels, aux réseaux sociaux et à l'automobile. En Europe, nous avons réduit notre exposition à l'habillement et à l'immobilier. En Asie, nous avons renforcé notre exposition aux semi-conducteurs et réduit notre exposition à la consommation discrétionnaire.

Sur le trimestre, la sélection de titres explique l'essentiel de la surperformance. Nos titres à forte croissance de petites et moyennes capitalisations aux États-Unis, en particulier dans les logiciels, la sécurité informatique et les semi-conducteurs, ont un impact relatif positif. Nos titres de la «recovery», en particulier les croisiéristes et l'événementiel aux États-Unis, ainsi que les secteurs liés au tourisme en Europe (compagnies aériennes, hôtellerie) et les sociétés de l'électronique en Asie ont bénéficié à la performance relative. Notre sélection de titres dans la santé a été particulièrement bénéfique, un titre ayant fait l'objet d'une opération de fusion-acquisition. Nos titres de la technologie en Europe ainsi que l'habillement et les communications en Asie ont en revanche pesé sur la performance relative.

La performance des marchés actions cette année s'est fortement concentrée sur quelques sociétés de méga-capitalisations que l'on ne retrouve pas dans l'univers des obligations convertibles. En effet, après avoir sous-performé pendant la majeure partie de 2021 et 2022, les actions de croissance de petites et moyennes capitalisations, largement représentées sur le marché des convertibles, n'ont commencé à afficher une dynamique haussière qu'autour de la fin du deuxième trimestre. Nous pensons que bon nombre de ces sociétés afficheront des résultats solides et moins vulnérables aux facteurs macroéconomiques, renforçant l'attrait de ces titres pour les investisseurs. D'autre part, un nombre important de sociétés de la «recovery» a continué à dépasser les attentes du consensus au deuxième trimestre: la persistance des contraintes de l'offre et de la demande reste un élément de soutien pour la performance financière et la rentabilité. De nombreuses sociétés soulignent également le maintien de forts volumes de réservations pour les trimestres à venir. Enfin, la structure des obligations convertibles, dont beaucoup offrent à la fois un rendement actuariel attrayant et une sensibilité actions significative, crée une opportunité de participer à la reprise des marchés actions, tout en conservant une protection à la baisse dans des périodes de volatilité.

## CARACTÉRISTIQUES

### Classification OPP 2

Obligations

### Gestion déléguée / gérant

Lazard Asset Management LLC, New York

### Banque dépositaire

Credit Suisse (Swiss) 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 30.06.2023

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

### Fortune sous gestion

CHF 83,7 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%

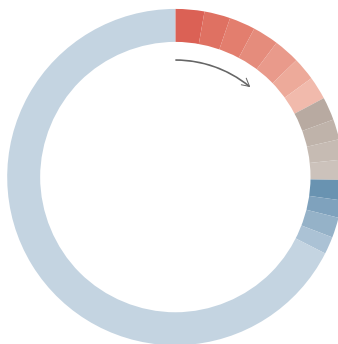
Classe II: 0,59%\*

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

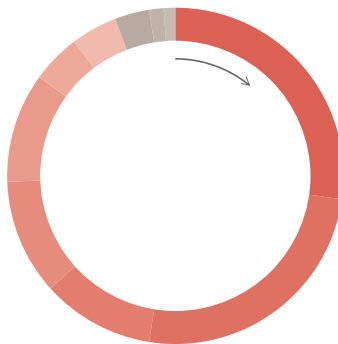
Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

## Positions principales



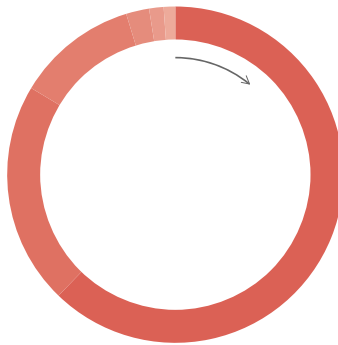
FORD MOTOR CO	2,8%
ON 0 1/2 03/01/29	2,5%
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,5%
AIRBNB INC-CLASS A	2,4%
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,4%
DEXCOM INC	2,4%
PANW 0 3/8 06/01/25	2,2%
AKAMAÏ TECHNOLOGIES INC	2,1%
LYV 3 1/8 01/15/29	2,1%
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,9%
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,9%
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	1,9%
SIKA AG-REG	1,9%
HUBSPOT INC	1,8%
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,7%
Autres	67,5%

## Répartition sectorielle



Consommation discrétionnaire	27,2%
Technologie	25,4%
Santé	10,9%
Industries	10,9%
Télécommunications	10,6%
Sociétés financières	4,9%
Services aux collectivités	4,4%
Matériaux de base	3,4%
Energie	1,2%
Cash	1,2%

## Répartition géographique



États-Unis	62,3%
Europe	21,4%
Asie	11,6%
Japon	2,2%
Autres	1,4%
Cash	1,2%

**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: PRWCBC 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 30.06.2023**

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

**Fortune sous gestion**

CHF 83,7 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%

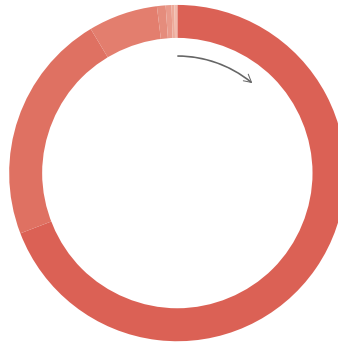
Classe II: 0,59%\*

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

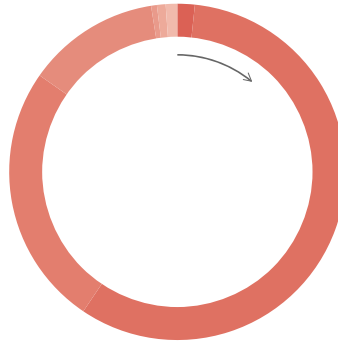
Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

**Répartition monétaire**



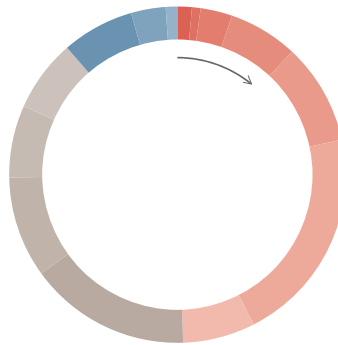
■ USD	69,1%
■ EUR	22,3%
■ JPY	6,7%
■ HKD	0,8%
■ SGD	0,5%
■ GBP	0,4%
■ CHF	0,2%

**Répartition par échéance**



■ 0-1 years	1,7%
■ 1-3 years	57,7%
■ 3-5 years	25,5%
■ 5-10 years	12,8%
■ 10+ years	0,4%
■ Equity	0,9%
■ Cash	1,2%

**Répartition par ratings**



■ AA	1,3%
■ AA-	1,0%
■ A+	3,1%
■ A-	6,6%
■ BBB+	9,8%
■ BBB	20,7%
■ BBB-	7,0%
■ BB+	15,5%
■ BB	9,8%
■ BB-	6,8%
■ B+	6,9%
■ B	7,0%
■ B-	3,4%
■ Cash	1,2%

**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: PRWCBC 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 30.06.2023**

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

**Fortune sous gestion**

CHF 83,7 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**

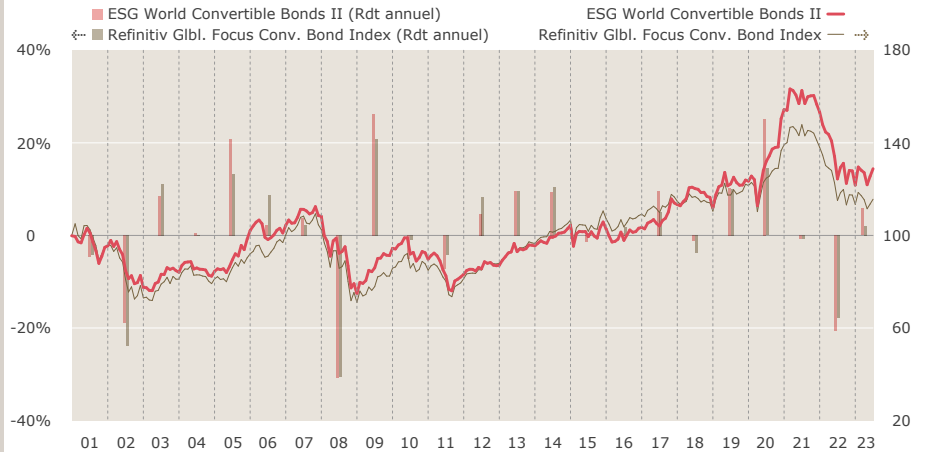
2016-2023

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
1,77	0,61	-2,99	-2,61	0,28	0,96	3,14	-3,54	2,36	2,19	-0,98	0,28	1,46	0,32	2016
5,15	9,55	-0,59	2,41	0,59	0,86	-1,54	-1,08	2,30	0,86	2,53	5,18	-1,54	-0,61	2017
-3,71	-1,17	-0,46	1,55	1,16	4,08	0,19	-0,52	-0,23	-1,19	0,12	-1,54	-0,30	-3,84	2018
10,03	10,23	5,02	2,91	0,55	4,54	-4,58	0,68	2,38	-1,85	-0,94	0,08	1,76	-0,38	2019
14,47	25,07	1,77	-1,24	-9,08	7,17	5,89	3,08	1,76	2,21	0,51	0,17	8,85	2,63	2020
-0,80	-0,74	-0,22	6,00	-0,42	-1,19	-2,32	3,61	-3,48	1,89	0,24	0,08	-2,36	-2,17	2021
-17,86	-20,57	-3,51	-2,17	-0,68	-1,98	-4,72	-7,28	3,96	1,42	-6,62	4,56	-0,15	-4,82	2022
1,96	5,83	6,44	-1,08	-0,80	-4,13	2,98	2,63							2023

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Performance cumulée**

2001-2023, 26.01.2001=100



**Analyse comparative**

(26.01.2001 - 30.06.2023)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG World Convertible Bo	28,83%	0,14%	1,13%	8,85%	54,81%	-10,99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	15,63%	0,10%	0,65%	8,21%	57,04%	-10,38%

	2e trim. 2023	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG World Convertible Bo	1,33%	-33,45%	1,21	3,06%	10,59%	0,10
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,17%	-34,99%	1,33	3,06%	10,61%	0,06

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,95	0,90	0,0049	0,93	3,45%

\*Taux sans risque: Libor 3M

## 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: PRWCBC 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 30.06.2023

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

### Fortune sous gestion

CHF 83,7 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 II vs. Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index  
Excess returns annuels [%] Excess returns mensuels [%]

		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
	-2,35	-0,77	0,22	-0,28	-0,32	0,26	-0,65	0,57	0,16	-0,44	-0,09	0,46	-0,20	2016
	9,46	0,29	-0,01	-0,14	-0,06	-0,55	0,39	-0,33	1,38	1,39	1,44	-0,57	0,97	2017
	4,96	0,66	1,17	0,47	1,26	1,42	-0,80	0,50	0,10	-0,50	-0,85	-0,07	-0,69	2018
	0,45	0,28	0,62	0,69	0,89	-0,41	0,66	0,47	-0,33	-1,47	-0,52	-0,65	0,05	2019
	25,38	0,69	0,05	0,02	1,17	0,81	1,52	1,13	0,40	-0,37	0,13	2,94	0,75	2020
	0,12	-0,87	1,27	-0,64	-0,20	-0,64	0,31	-0,22	0,25	0,49	0,65	-0,22	-0,01	2021
	-4,39	-1,09	1,17	0,17	-1,17	-0,59	-1,02	1,04	0,21	-1,05	0,71	-0,06	-1,38	2022
	8,04	1,90	0,05	0,71	-0,73	1,17	0,79							2023

## Chiffres clés

1 an

(30.06.2022 – 30.06.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	3,55%	14,02%		3,36%	2,84%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,48%	10,95%			

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,89			-7,20%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-6,96%	N/A

\*Taux sans risque: Libor 3M

## Chiffres clés

5 ans

(30.06.2018 – 30.06.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	1,39%	12,29%	0,41	2,89%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-0,20%	10,30%	0,30		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,55	1,13	0,0136	-25,46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24,57%	N/A

\*Taux sans risque: Libor 3M

## 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 30.06.2023

Classe I: CHF 1'287,48

Classe II: CHF 1'288,25

Classe III: CHF 1'288,73

### Fortune sous gestion

CHF 83,7 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.

## Chiffres clés

10 ans

(30.06.2013 – 30.06.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	3,32%	10,23%	0,52	2,49%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	2,13%	8,88%	0,45		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,46	1,09	0,0083	-25,46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24,57%	N/A

\*Taux sans risque: Libor 3M