

**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 29.09.2023**

Classe I: CHF 1'252,11

Classe II: CHF 1'253,04

Classe III: CHF 1'253,61

**Fortune sous gestion**

CHF 81,8 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**

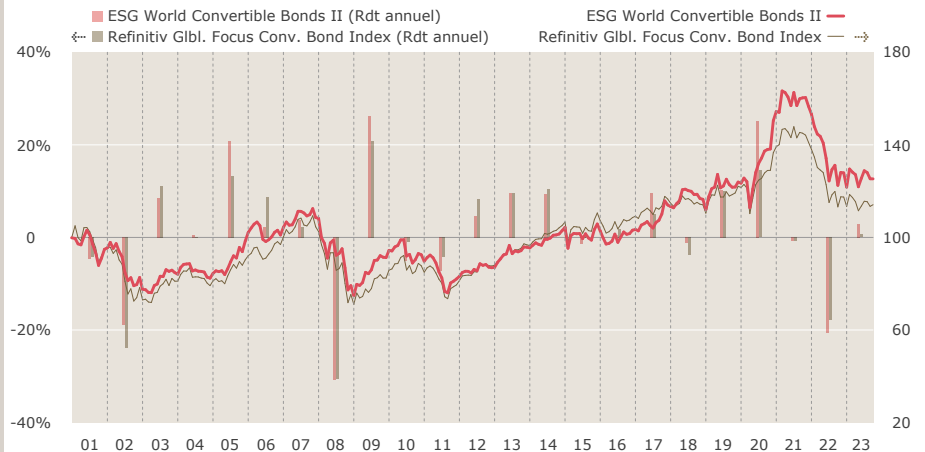
2016-2023

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	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
0,64	2,94	6,44	-1,08	-0,80	-4,13	2,98	2,63	-0,60	-2,11	-0,03				2023

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Performance cumulée**

2001-2023, 26.01.2001=100



**Analyse comparative**

(26.01.2001 - 30.09.2023)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG World Convertible Bo	25,30%	0,13%	1,00%	8,85%	54,21%	-10,99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	14,13%	0,10%	0,58%	8,21%	56,78%	-10,38%

	3e trim. 2023	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG World Convertible Bo	-2,73%	-33,45%	1,18	3,04%	10,55%	0,02
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-1,30%	-34,99%	1,31	3,05%	10,56%	-0,02

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,95	0,90	0,0040	0,95	3,44%

\*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: 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 29.09.2023

Classe I: CHF 1'252,11

Classe II: CHF 1'253,04

Classe III: CHF 1'253,61

### Fortune sous gestion

CHF 81,8 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
	4,68	1,90	0,05	0,71	-0,73	1,17	0,79	-0,43	-0,37	-0,65				2023

## Chiffres clés

1 an

(30.09.2022 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	2,29%	11,65%	0,16	3,20%	2,74%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0,83%	8,89%	0,05		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,45	1,29	0,0131	-5,93%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-5,93%	N/A

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

## Chiffres clés

5 ans

(30.09.2018 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	1,10%	12,32%	0,06	2,91%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-0,18%	10,31%	-0,05		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,44	1,17	0,0136	-25,46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24,57%	N/A

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

## Chiffres clés

10 ans

(30.09.2013 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG World Convertible Bo	2,89%	10,26%	0,24	2,50%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	1,82%	8,90%	0,16		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Convertible Bo	0,42	1,12	0,0087	-25,46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24,57%	N/A

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