

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

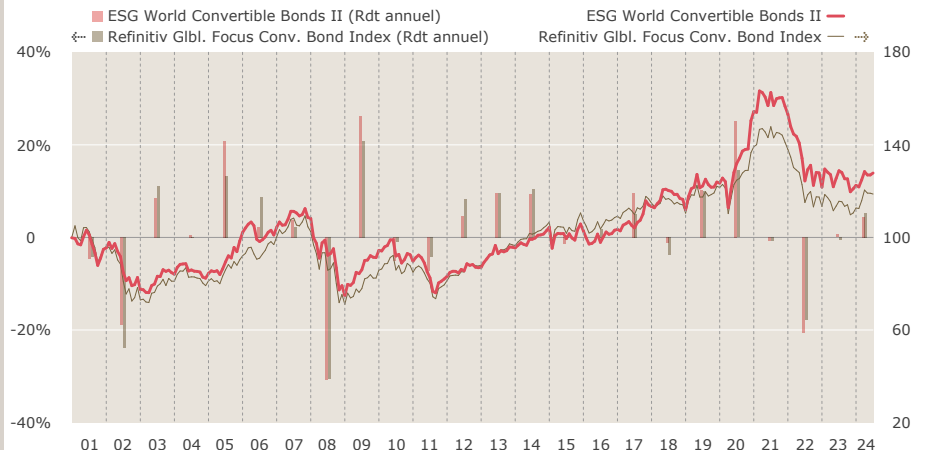
2017-2024

| Performances annuelles [%] | | Performances mensuelles [%] | | | | | | | | | | | |
|---------------------------------|--------|-----------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| *Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon | | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Jun | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc |
| 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 |
| -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 |
| 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 |
| 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 |
| -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 |
| -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 |
| -0,62 | 0,64 | 6,44 | -1,08 | -0,80 | -4,13 | 2,98 | 2,63 | -0,60 | -2,11 | -0,03 | -4,46 | 1,08 | 1,24 |
| 5,36 | 4,35 | -0,55 | 2,51 | 2,87 | -1,15 | -0,01 | 0,67 | | | | | | |

*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

Performance cumulée

2001-2024, 26.01.2001=100



Analyse comparative

(26.01.2001 – 30.06.2024)

| | Performance cumulée | Moyenne arithmétique | Performance annualisée | Meilleur mois | Mois positifs | Moins bon mois |
|-------------------------------|---------------------|----------------------|------------------------|---------------|---------------|----------------|
| ESG World Convertible Bo | 27,83% | 0,13% | 1,05% | 8,85% | 54,26% | -10,99% |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 18,74% | 0,11% | 0,73% | 8,21% | 56,38% | -10,38% |

| | 2e trim. 2024 | Drawdown maximum | Ratio gains:pertes | Ecart-type | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* |
|-------------------------------|---------------|------------------|--------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| ESG World Convertible Bo | -0,49% | -33,45% | 1,19 | 3,02% | 10,46% | 0,03 |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | -1,44% | -34,99% | 1,29 | 3,02% | 10,48% | -0,00 |

| | Corrél.* | R2* | Alpha de Jensen ann.* | Bêta* | Tracking Err. ann. |
|-------------------------------|----------|------|-----------------------|-------|--------------------|
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 0,95 | 0,90 | 0,0031 | 0,94 | 3,40% |

*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 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 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 | |
|--|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| | 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 |
| | 2,52 | 1,90 | 0,05 | 0,71 | -0,73 | 1,17 | 0,79 | -0,43 | -0,37 | -0,65 | -0,65 | 0,37 | -0,70 | 2023 |
| | -2,13 | -0,38 | -0,51 | -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 | -0,77% | 6,93% | -0,17 | 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 | -1,81 | 0,94 | -0,0329 | -7,07% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -5,05% | 4 |

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

Chiffres clés

5 ans

(30.06.2019 – 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 | 0,90% | 11,87% | 0,04 | 2,93% | - |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 0,22% | 10,07% | -0,02 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|-------------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| ESG World Convertible Bo | 0,23 | 1,15 | 0,0070 | -26,69% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -25,74% | N/A |

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

Chiffres clés

10 ans

(30.06.2014 – 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 | 2,57% | 10,39% | 0,21 | 2,54% | - |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 1,59% | 9,08% | 0,13 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|-------------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| ESG World Convertible Bo | 0,38 | 1,11 | 0,0082 | -26,69% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -25,74% | N/A |

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