

PRISMA ESG World Convertible Bonds

LAZARD ASSET MANAGEMENT LLC, NEW YORK

Gestion déléguée depuis le 19.05.2017

Le groupe de placements investit dans des obligations convertibles émises par des émetteurs domiciliés dans le monde entier, sans restriction géographique ni sectorielle. L'objectif de gestion est d'obtenir une performance nette supérieure à celle de son indice de référence sur le moyen/long terme. Le gérant dispose d'une grande flexibilité de gestion pour atteindre cet objectif, notamment en termes de sensibilité aux actions (delta), de risque de crédit, d'exposition aux monnaies étrangères (qui peuvent être couvertes de manière opportuniste) et de durée.

PERFORMANCE INDEXÉE

PRISMA ESG World Convertible Bonds (26.01.2001=100, 05.08.2022=132,70)

— PRISMA ESG World Convertible Bonds
— Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bond Index



PERFORMANCES MENSUELLES

Performances annuelles [%] | Performances mensuelles [%]

Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bond Index	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.		
0,57	-1,47	-8,66	5,73	0,95	-0,16	0,11	-2,20	2,13	-1,82	-0,91	4,69	2,27	-2,82	2015
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
-14,22	-15,61	-3,51	-2,17	-0,68	-1,98	-4,72	-7,28	3,96						2022

PERFORMANCES AU 5 AOÛT 2022

	2019	2020	2021	2022	Depuis le 26.01.01	Vol. ann.
PRISMA ESG World Convertible Bonds	10,23%	25,07%	-0,74%	-13,41%	32,71%	11,55%
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index	10,03%	14,47%	-0,80%	-12,34%	21,03%	11,91%

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Obligations

Banque dépositaire

Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich

Administrateur

Credit Suisse Funds SA, Zurich

Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur

Ernst & Young SA

Numéro de valeur

Classe I: 111735898

Classe II: 11179845

Classe III: 111735916

Ticker Bloomberg

Classe II: PRIOBCM 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 05.08.2022

CHF 1'327,05

Fortune sous gestion

CHF 85,5 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

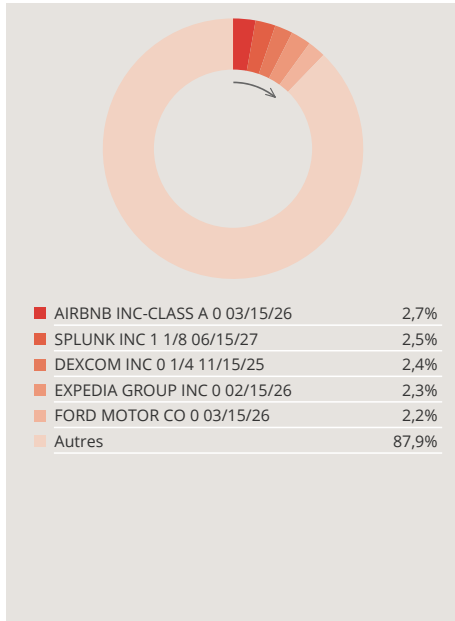
- 0% dès 12 mois

TER KGAST au 31.03.2022

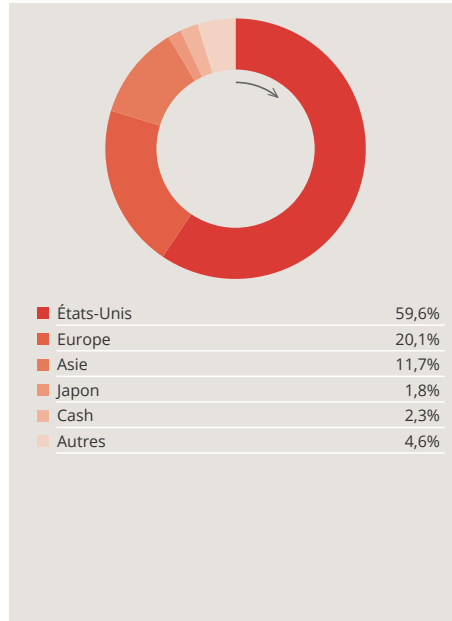
Classe II: 0,61%(Performance Fee: 1,33%)*

*y.c. Performance Fee si le groupe de placements surperforme son indice de référence. TER hors Performance Fee: 0,62%. Le groupe de placements a surperformé son indice de référence de 10,82%.

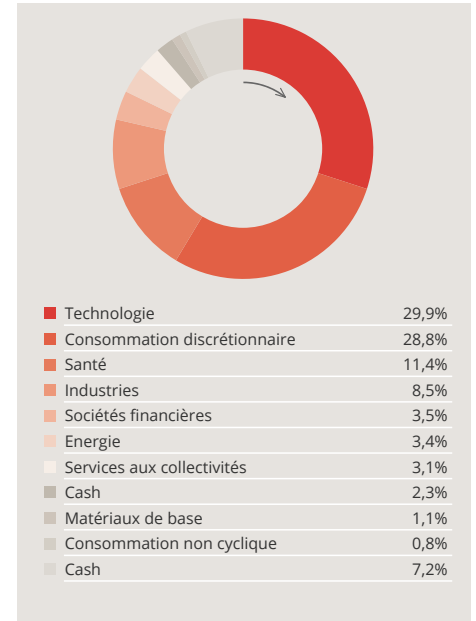
POSITIONS PRINCIPALES



RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



RÉPARTITION SECTORIELLE



POLITIQUE ESG

Sélection négative

- [+] Titres exclus par l'Association suisse pour des investissements responsables (ASIR);
- [+] Titres exclus par le fonds souverain norvégien;
- [+] Niveau de controverse «5» (le plus élevé) selon l'agence Sustainalytics de Morningstar;
- [+] Notation Sustainalytics supérieure à 50.

Intégration dans la sélection des titres

- [+] Prise en compte des risques ESG lors de l'analyse des émetteurs.

LA FONDATION D'INVESTISSEMENT PRISMA ENTRE PROFESSIONNELS DE LA PRÉVOYANCE

PRISMA est une fondation d'investissement à but non lucratif créée en 2000 sous l'impulsion d'institutions de prévoyance du 2^e pilier. Aujourd'hui, PRISMA figure comme l'une des rares institutions en Suisse pilotée par des professionnels de la prévoyance pour des professionnels de la prévoyance. La Fondation compte un grand nombre de membres-investisseurs, auxquels elle offre avec la plus grande transparence la gestion d'une gamme de placements diversifiée et innovante. Architecture ouverte, PRISMA gère des approches et des techniques de gestion spécialisées avec un ratio rendement/risque attrayant et répondant aux attentes spécifiques des caisses de pension.

Avec une volonté affirmée de ne pas reproduire ce qui existe déjà, PRISMA propose des solutions d'investissement spécifiques et novatrices.

GROUPES DE PLACEMENTS

Actions

PRISMA ESG SPI® Efficient
 PRISMA Global Residential Real Estate
 PRISMA ESG Sustainable SOCIETY
 PRISMA ESG China Equities
 PRISMA Global Emerging Markets Equities

Obligations

PRISMA ESG World Convertible Bonds
 PRISMA Global Credit Allocation
 PRISMA ESG CHF Bonds
 PRISMA Renminbi Bonds

Produits Alternatifs

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1
 PRISMA SHARP

Immobilier

PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate
 PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Fondation - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tél. 0848 106 106 - info@prisma-fondation.ch - www.prisma-fondation.ch

Ce document commercial est exclusivement conçu à des fins d'information et ne constitue pas un conseil en investissement de produits financiers. Du fait de leur simplification, les informations contenues dans ce document peuvent n'être que partielles. Elles peuvent être subjectives et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Toutes ces données ont été établies de bonne foi sur la base d'informations de marché. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. La responsabilité de PRISMA Fondation ne saurait être engagée par une prise de décision sur la base de ces informations. Il est recommandé aux investisseurs qui envisagent d'investir dans ce produit, de ne pas fonder leur décision sur les seuls éléments contenus dans ce document. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus sans frais auprès de PRISMA Fondation.