

# 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, 05.07.2024=128,75)

— 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.		
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
-0,62	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	2023
5,36	4,35	-0,55	2,51	2,87	-1,15	-0,01	0,67							2024

## PERFORMANCES AU 5 JUILLET 2024\*

	2021	2022	2023	2024	Depuis le 26.01.01	Vol. ann.
PRISMA ESG World Convertible Bonds	-0,74%	-20,57%	0,64%	5,10%	28,75%	11,41%
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index	-0,80%	-17,86%	-0,62%	5,88%	19,34%	11,64%

\*Les performances se réfèrent à la classe II.

## 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, Lausanne

### Numéro de valeur

Classe I: 111735898

Classe II: 1179845

Classe III: 111735916

### Ticker Bloomberg

Classe I: PRWCBCB 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 05.07.2024

Classe I: CHF 1'286,10

Classe II: CHF 1'287,53

Classe III: CHF 1'288,40

### Fortune sous gestion

CHF 85,7 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

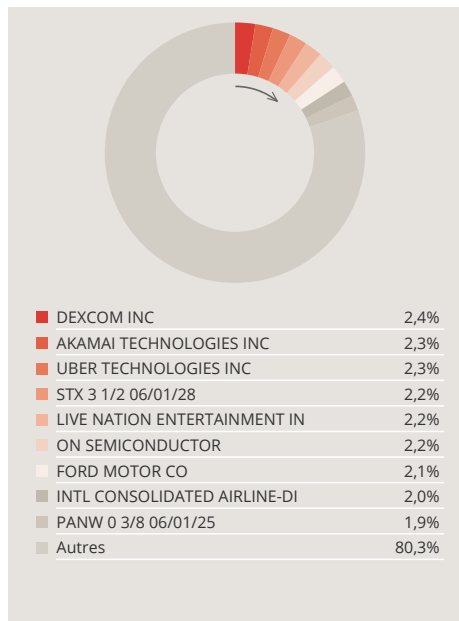
Classe I: 0,67%

Classe II: 0,59%\*

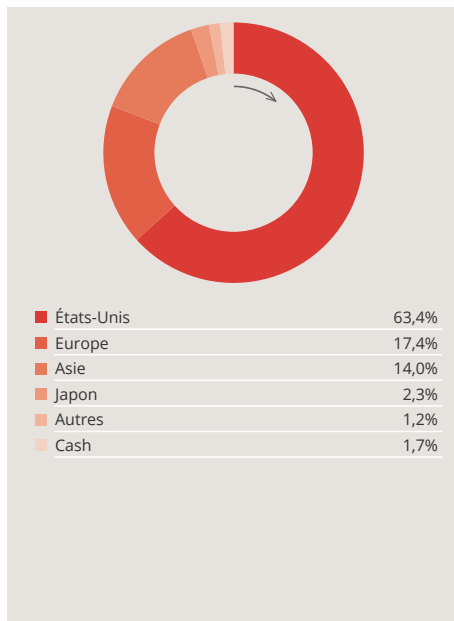
Classe III: 0,59%

\*valeur impactée par les mouvements de fortune qui ont eu lieu lors de la création des classes I et III le 01.04.2022

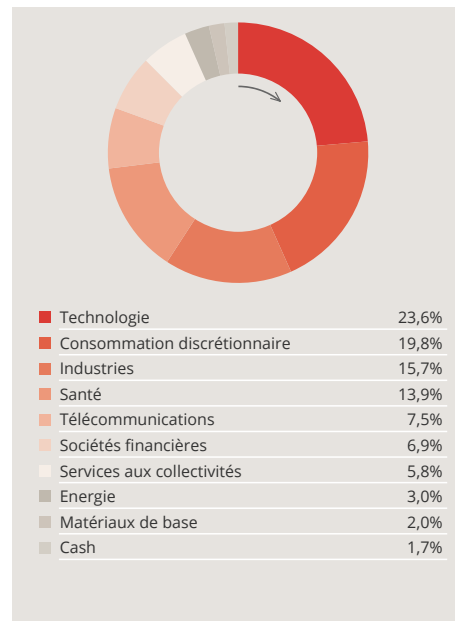
## POSITIONS PRINCIPALES



## 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<sup>e</sup> 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 ESG Global Emerging Markets Equities

### Obligations

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

### Infrastructure

PRISMA ESG Global Infrastructure

### Produits Alternatifs

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1  
PRISMA Alternative Multi-Manager  
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](mailto:info@prisma-fondation.ch) - [www.prisma-fondation.ch](http://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.