PRISMA
Fondation d'investissement · Anlagestiftung

PRISMA ESG World Convertible Bonds

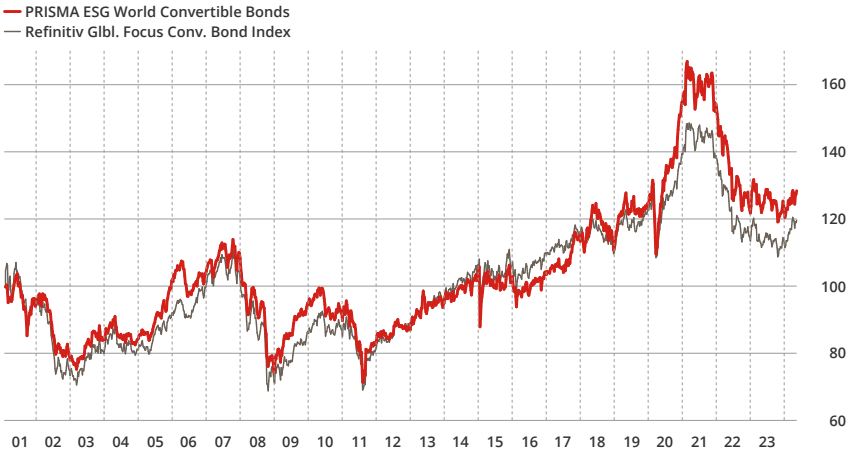
LAZARD ASSET MANAGEMENT LLC, NEW YORK

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 duration.

PERFORMANCE INDEXÉE*

PRISMA ESG World Convertible Bonds (26.01.2001=100, 10.05.2024=128,40)



PERFORMANCES MENSUELLES*

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
Refinitiv Glbl. 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
5,72	3,66	-0,55	2,51	2,87	-1,15									2024

PERFORMANCES AU 10 MAI 2024*

	2021	2022	2023	2024	Depuis le 26.01.01	Vol. ann.
PRISMA ESG World Convertible Bonds	-0,74%	-20,57%	0,64%	4,81%	28,40%	11,43%
Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index	-0,80%	-17,86%	-0,62%	6,14%	19,63%	11,66%

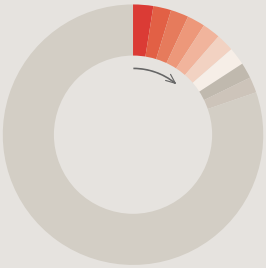
*Les performances se réfèrent à la classe II.

Copyright © 2024 PRISMA Fondation, tous droits réservés.

CARACTÉRISTIQUES

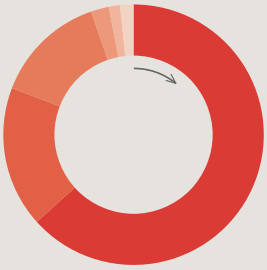
Classification OPP 2
Obligations
Banque dépositaire
Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich
Administrateur
Credit Suisse Funds SA, Zurich
Distribution
Key Investment Services (KIS) SA, Morges
Auditeur
Ernst & Young SA, Lausanne
Numéro de valeur
Classe I: 111735898
Classe II: 1179845
Classe III: 111735916
Ticker Bloomberg
Classe I: 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 10.05.2024
Classe I: CHF 1'282,63
Classe II: CHF 1'283,98
Classe III: CHF 1'284,80
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 31.03.2023
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



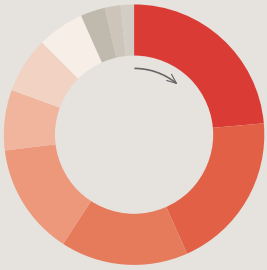
DEXCOM INC	2,4%
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,3%
UBER TECHNOLOGIES INC	2,3%
STX 3 1/2 06/01/28	2,2%
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,2%
ON SEMICONDUCTOR	2,2%
FORD MOTOR CO	2,1%
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	2,0%
PANW 0 3/8 06/01/25	1,9%
Autres	80,3%

RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



États-Unis	63,4%
Europe	17,4%
Asie	14,0%
Japon	2,3%
Autres	1,2%
Cash	1,7%

RÉPARTITION SECTORIELLE



Technologie	23,6%
Consommation discrétionnaire	19,8%
Industries	15,7%
Santé	13,9%
Télécommunications	7,5%
Sociétés financières	6,9%
Services aux collectivités	5,8%
Energie	3,0%
Matériaux de base	2,0%
Cash	1,7%

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 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 2e 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 - 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.

Copyright © 2024 PRISMA Fondation, tous droits réservés.