

## PRISMA SHARP

### ROTHSCHILD & CO, GENÈVE

Gestion déléguée depuis le 25.09.2015

Evolution de la stratégie «Smart», la stratégie SHARP en reprend les mêmes bases: une très large gamme de classe d'actifs liquides et un système d'allocation dynamique, tout en augmentant sa flexibilité et sa réactivité. SHARP vise à surperformer un portefeuille traditionnel 50% actions / 50% obligations sur le long terme au travers d'un processus d'allocation systématique à une large variété de primes de risque, couplé à une gestion adaptative des risques de marché. La monnaie de référence est le USD 100% couvert. Le groupe de placements est quant à lui évalué en USD.

### PERFORMANCE INDEXÉE\*

PRISMA SHARP (31.12.2020=100, 04.04.2025=105,51)



### PERFORMANCES MENSUELLES\*

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]												
	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	
3,54	-1,87	-1,29	0,52	1,78	0,64	0,95	2,71	0,24	-3,23	1,93	-0,38	1,66	2021
-12,17	-2,91	-0,95	0,47	-3,91	-1,15	-3,25	2,49	-2,54	-3,25	1,56	2,20	-1,38	2022
9,44	3,41	-2,29	2,30	0,56	-1,24	1,74	2,34	-1,74	-3,25	-2,11	5,56	4,23	2023
7,54	0,19	1,20	3,17	-2,21	2,24	1,22	1,86	0,73	1,76	-2,57	2,36	-2,46	2024
1,68	2,44	0,73	-1,46										2025

### PERFORMANCES AU 4 AVRIL 2025\*

	2022	2023	2024	2025	Depuis le 31.12.20	Vol. ann.
PRISMA SHARP	-12,17%	9,44%	7,54%	-1,41%	5,51%	7,93%

\*Les performances se réfèrent à la classe II.

Copyright © 2025 PRISMA Fondation, tous droits réservés.

### CARACTÉRISTIQUES

#### Classification OPP 2

Produits Alternatifs

#### Banque dépositaire

UBS Switzerland AG, Zurich

#### Administrateur

UBS Switzerland AG, Zurich

#### Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

#### Auditeur

Ernst & Young SA, Lausanne

#### Numéro de valeur

27699704

#### Ticker Bloomberg

PRSPOT SW

#### Code ISIN

CH0276997043

#### Devise de référence

Dollar US (USD)

#### Date de lancement

31 décembre 2020

#### Date de fin d'exercice

31 mars

#### Publication des cours

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

#### Prix d'émission

USD 1'220,77

#### VNI au 04.04.2025

USD 1'288,04

#### Fortune sous gestion

USD 43,7 mio

#### Liquidité

hebdomadaire

#### Délai de souscription

jeudi 11h00

#### Délai de rachat de parts

jeudi 11h00

#### Date de règlement / souscription

T+3 (mercredi)

#### Date de règlement / rachat de parts

T+4 (jeudi)

#### Commission de gestion

0,39% p.a. (hors TVA)

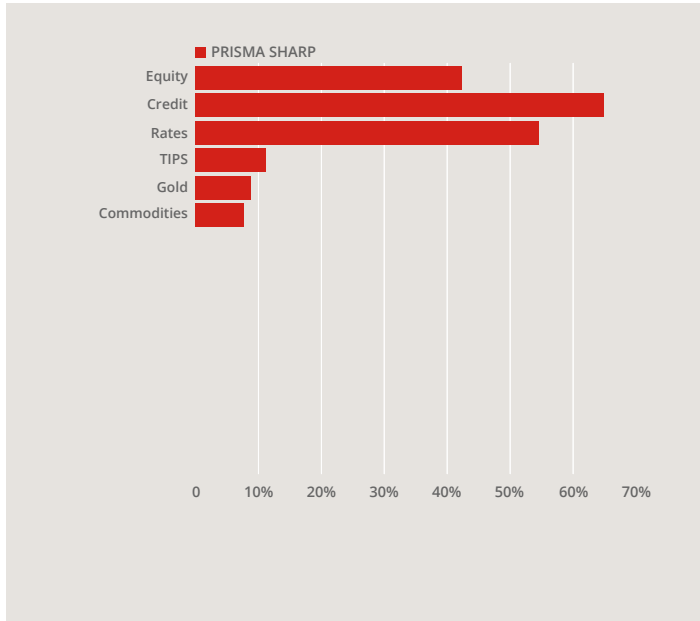
+ Commission de performance de 12% avec High Water Mark

#### TER KGAST au 31.03.2024

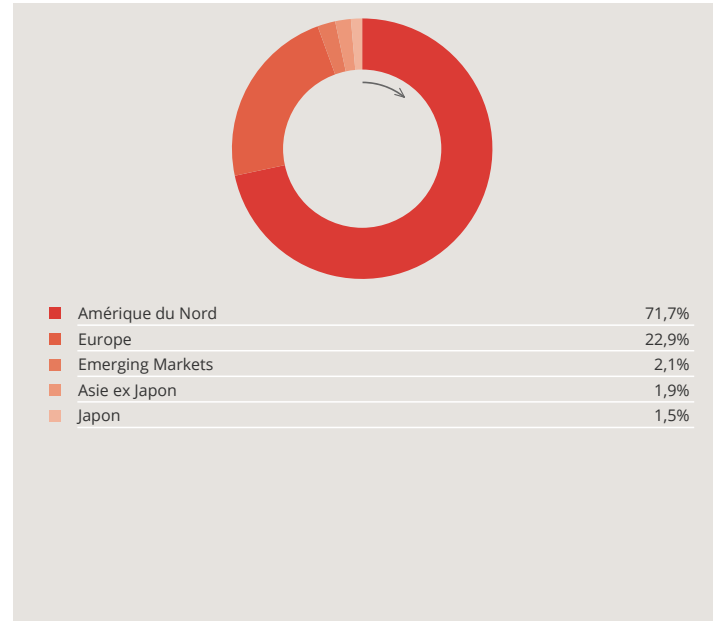
0,88%\*

\*Le TER de PRISMA SHARP peut potentiellement être inférieur au TER KGAST publié, car un rabais sur les commissions de gestion est accordé aux investisseurs qui ont une fortune sous gestion supérieure à CHF 10 millions. Ce rabais est à la charge du gérant et est versé une fois par an.

## RÉPARTITION PAR CLASSES D'ACTIFS



## RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



## STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

- [+] A pour objectif d'offrir une performance stable, en limitant les risques extrêmes;
- [+] Processus systématique ancré sur des principes économiques fondamentaux et implémenté au travers de techniques quantitatives avancées:
  1. Allocation stratégique équilibrée en risques sur un univers multi-classes d'actifs offrant une exposition diversifiée sur les actions, les taux, les devises, les crédits et les actifs réels;
  2. Modèles dynamiques de gestion des risques afin d'améliorer le profil risque-rendement et de renforcer la protection du capital en cas de volatilité extrême.

- [+] Principalement «long-only», tout en conservant la flexibilité de passer «short» sur certains marchés en cas de scénarios extrêmes;
- [+] Utilisation d'instruments liquides uniquement;
- [+] Conforme à la régulation UCITS IV.

## 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 Global Emerging Markets Equities

### Obligations

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

### Infrastructure

PRISMA ESG Global Infrastructure

### Produits Alternatifs

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1  
 PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 2  
 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.