PRISMA ESG World Convertible Bonds II

Quartalsbericht | September 2026

MERKMALE

BVV 2-Klassifizierung
Obligationen

Delegierte Verwaltung / Manager
Lazard Asset Management LLC

Depotbank
UBS Switzerland AG, Zürich

Administrator
UBS Switzerland AG, Zürich

Vertrieb
Key Investment Services (KIS) AG, Morges

Kontrollstelle
BDO AG

Valoren-Nummer
Klasse I: 111735898
Klasse II: 1179845

Bloomberg
Klasse I: PRWCBCH SW
Klasse II: PRIOBCM SW

ISIN
Klasse I: CH1117358981
Klasse II: CH0011798458

Referenzwährung
Schweizer Franken (CHF)

Datum der Lancierung
26. Januar 2001

Jahresabschluss
31. März

Offizielle Benchmark
FTSE Global Focus Convertible Bond Index [CHF]

Publikation der Kurse
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

Emissionspreis
CHF 1'000

NIW am 30.09.2026
Klasse I: CHF 1'481.69
Klasse II: CHF 1'499.74

Verwaltetes Vermögen
CHF 26.7 Mio.

Liquidität
Wöchentlich

Zeichnungstermin
Donnerstag 17.00 Uhr

Rückgabetermin
Montag 17.00 Uhr

Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+3 (Mittwoch)

Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+4 (Donnerstag)

Zeichnungsgebühren
Keine Zeichnungsgebühren

Rückgabegebühren
Rücknahmegebühren sind degressiv und werden gemäss Anlagedauer berechnet.
- 0.50% ab 0 bis 6 Monate
- 0.25% ab 6 bis 12 Monate
- 0% ab 12 Monaten

TER KGAST am 31.03.2026
Klasse I: 0.64%
Klasse II: 0.57%

Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich geltenden Quellen stammen, übernimmt die PRISMA Anlagestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

Monatsrenditen

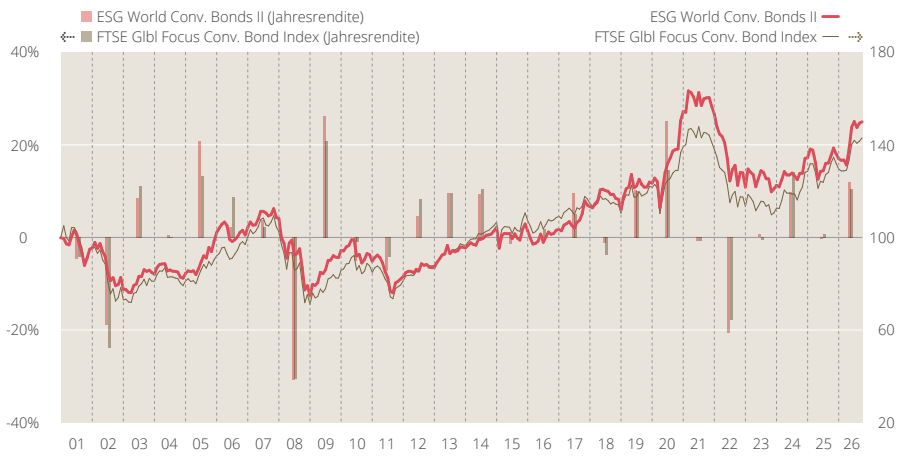
2019–2026

Jahresrendite [%]		Monatsrenditen [%]												
*FTSE Glbl Focus Conv. Bond Inde		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
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
14.09	9.73	-0.55	2.51	2.87	-1.15	-0.01	0.67	-0.97	-1.29	2.21	0.02	5.05	0.17	2024
0.71	-0.33	2.79	-0.35	-3.84	-5.49	2.74	0.17	2.50	0.08	2.38	2.49	-1.84	-1.54	2025
10.44	11.94	-0.48	0.08	-1.61	5.33	6.77	1.66	-1.75	1.30	0.40				2026

*FTSE Global Focus Convertible Bond Index.

Kumulierte Performance

2001–2026, 26.01.2001=100



Vergleichsanalyse

(26.01.2001 – 30.09.2026)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
ESG World Conv. Bonds II	49.97%	0.18%	1.59%	8.85%	55.02%	-10.99%
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	43.00%	0.16%	1.40%	8.21%	56.96%	-10.38%

	3. Quartal 2026	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
ESG World Conv. Bonds II	-0.08%	-33.45%	1.22	2.99%	10.37%	0.08
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	0.73%	-34.99%	1.32	2.98%	10.31%	0.06

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	0.95	0.90	0.0022	0.95	3.37%

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

MERKMALE

BVV 2-Klassifizierung
Obligationen

Delegierte Verwaltung / Manager
Lazard Asset Management LLC

Depotbank
UBS Switzerland AG, Zürich

Administrator
UBS Switzerland AG, Zürich

Vertrieb
Key Investment Services (KIS) AG, Morges

Kontrollstelle
BDO AG

Valoren-Nummer
Klasse I: 111735898
Klasse II: 1179845

Bloomberg
Klasse I: PRWCBCH SW
Klasse II: PRIOBCM SW

ISIN
Klasse I: CH1117358981
Klasse II: CH0011798458

Referenzwährung
Schweizer Franken (CHF)

Datum der Lancierung
26. Januar 2001

Jahresabschluss
31. März

Offizielle Benchmark
FTSE Global Focus Convertible Bond Index [CHF]

Publikation der Kurse
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

Emissionspreis
CHF 1'000

NIW am 30.09.2026
Klasse I: CHF 1'481.69
Klasse II: CHF 1'499.74

Verwaltetes Vermögen
CHF 26.7 Mio.

Liquidität
Wöchentlich

Zeichnungstermin
Donnerstag 17.00 Uhr

Rückgabetermin
Montag 17.00 Uhr

Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+3 (Mittwoch)

Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+4 (Donnerstag)

Zeichnungsgebühren
Keine Zeichnungsgebühren

Rückgabegebühren
Rücknahmegebühren sind degressiv und werden gemäss Anlagedauer berechnet.
- 0.50% ab 0 bis 6 Monate
- 0.25% ab 6 bis 12 Monate
- 0% ab 12 Monaten

TER KGAST am 31.03.2026
Klasse I: 0.64%
Klasse II: 0.57%

Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich geltenden Quellen stammen, übernimmt die PRISMA Anlagestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

Mehrrenditen

ESG World Conv. Bonds II vs. FTSE Global Focus Convertible Bond Index

Annualisierte Mehrrendite [%]	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Monatliche Mehrrendite [%]
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
-9.75	-0.38	-0.51	-1.08	-0.05	0.03	0.98	-0.94	0.82	-0.74	-1.84	-0.11	-0.18	2024
-2.08	0.28	-0.36	-0.99	-0.15	0.22	0.59	-0.34	-0.49	-0.79	0.50	0.13	0.38	2025
3.34	0.10	0.08	-1.88	1.98	1.74	0.33	-0.85	0.65	-0.59				2026

Kennzahlen

1 Jahr

(30.09.2025 – 30.09.2026, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
ESG World Conv. Bonds II	10.88%	9.74%	1.04	3.53%	2.44%
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	8.29%	7.14%	1.08		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
ESG World Conv. Bonds II	0.67	1.29	0.0017	-5.29%	2
FTSE Glbl Focus Conv. Bo				-4.42%	3

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

5 Jahre

(30.09.2021 – 30.09.2026, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
ESG World Conv. Bonds II	-1.32%	10.43%	-0.16	2.89%	-
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	-0.28%	9.09%	-0.07		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
ESG World Conv. Bonds II	-0.36	1.11	-0.0098	-25.38%	N/A
FTSE Glbl Focus Conv. Bo				-24.29%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

10 Jahre

(30.09.2016 – 30.09.2026, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
ESG World Conv. Bonds II	4.00%	10.29%	0.34	2.83%	-
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	2.93%	8.84%	0.28		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
ESG World Conv. Bonds II	0.36	1.12	0.0072	-26.69%	N/A
FTSE Glbl Focus Conv. Bo				-25.74%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months