PRISMA ESG World Convertible Bonds II

Rapport trimestriel | Septembre 2026

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2
Obligations

Gestion déléguée / gérant
Lazard Asset Management LLC

Banque dépositaire
UBS Switzerland AG, Zurich

Administrateur
UBS Switzerland AG, Zurich

Distribution
Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur
BDO SA

Numéro de valeur
Classe I: 111735898
Classe II: 1179845

Ticker Bloomberg
Classe I: PRWCBCH SW
Classe II: PRIOBCM SW

Code ISIN
Classe I: CH1117358981
Classe II: CH0011798458

Devise de référence
Franc suisse (CHF)

Date de lancement
26 janvier 2001

Date de fin d'exercice
31 mars

Benchmark officiel
FTSE Global Focus Convertible Bond Index [CHF]

Publication des cours
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission
CHF 1'000

VNI au 30.09.2026
Classe I: CHF 1'481,69
Classe II: CHF 1'499,74

Fortune sous gestion
CHF 26,7 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 31.03.2026
Classe I: 0,64%
Classe II: 0,57%

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, PRISMA Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

Performances mensuelles

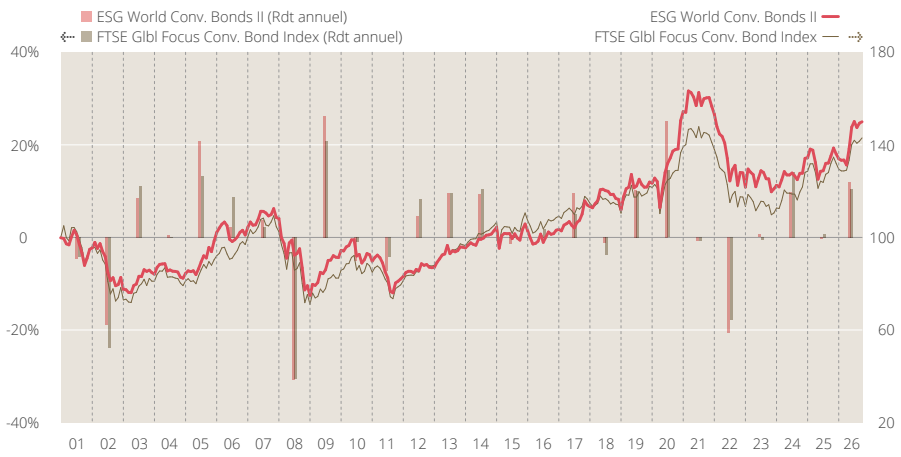
2019–2026

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
*FTSE Glbl Focus Conv. Bond Inde		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
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.

Performance cumulée

2001–2026, 26.01.2001=100



Analyse comparative

(26.01.2001 – 30.09.2026)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
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%

	3e trim. 2026	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
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

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
FTSE Glbl Focus Conv. Bo	0,95	0,90	0,0022	0,95	3,37%

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

PRISMA ESG World Convertible Bonds II

Rapport trimestriel | Septembre 2026

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2
Obligations

Gestion déléguée / gérant
Lazard Asset Management LLC

Banque dépositaire
UBS Switzerland AG, Zurich

Administrateur
UBS Switzerland AG, Zurich

Distribution
Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur
BDO SA

Numéro de valeur
Classe I: 111735898
Classe II: 1179845

Ticker Bloomberg
Classe I: PRWCBCH SW
Classe II: PRIOBCM SW

Code ISIN
Classe I: CH1117358981
Classe II: CH0011798458

Devise de référence
Franc suisse (CHF)

Date de lancement
26 janvier 2001

Date de fin d'exercice
31 mars

Benchmark officiel
FTSE Global Focus Convertible Bond Index [CHF]

Publication des cours
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission
CHF 1'000

VNI au 30.09.2026
Classe I: CHF 1'481,69
Classe II: CHF 1'499,74

Fortune sous gestion
CHF 26,7 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 31.03.2026
Classe I: 0,64%
Classe II: 0,57%

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, PRISMA Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

Excess Returns

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

Excess returns annuels [%]	Excess returns mensuels [%]												
	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
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

Chiffres clés

1 an

(30.09.2025 – 30.09.2026, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. 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		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG World Conv. Bonds II	0,67	1,29	0,0017	-5,29%	2
FTSE Glbl Focus Conv. Bo				-4,42%	3

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Chiffres clés

5 ans

(30.09.2021 – 30.09.2026, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. 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		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	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

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Chiffres clés

10 ans

(30.09.2016 – 30.09.2026, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. 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		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	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

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months