



1

PRISMA ESG World Convertible Bonds II
CH0011798458

NIW: CHF 1'341.87

Delegierte Verwaltung	Lazard Asset Management LLC (seit dem 02.06.2017)
Depotbank	Credit Suisse, Zürich
Administrator	Credit Suisse, Zürich
Vertrieb	Key Investment Services (KIS) AG, Morges
Kontrollstelle	Ernst & Young, Lausanne
Valoren-Nummer / Bloomberg	117 98 45 / PRIOBCM SW
Rechnungswährung	Schweizer Franken (CHF)
Lancierungsdatum	26. Januar 2001
Benchmark	Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index
Abschluss Rechnungsjahr	31 März
Publikation der Kurse	Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und www.prismaanlagestiftung.ch
NIW-Berechnung	Wöchentlich
Ausgabepreis	CHF 1'000.-
Gebühren	Keine Ausgabegebühren. Degressive, nach Anlagedauer berechnete Rücknahmegebühr.
TER KGAST	0.61%
Prisma Anlagestiftung Rue du Sablon 2 CH-1110 Morges Tel.: 0848 106 106 www.prismaanlagestiftung.ch info@prismaanlagestiftung.ch	

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.

01

Monatsrenditen

2015-2022

Jahresrendite [%]	*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	Monatsrenditen [%]												
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
0.57	-1.47	-8.66	5.73	0.95	-0.16	0.11	-2.20	2.13	-1.82	-0.91	4.69	2.27	-2.82	2015
1.77	0.61	-2.99	-2.61	0.28	0.96	3.14	-3.54	2.36	2.19	-0.98	0.28	1.46	0.32	2016
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
-11.08	-12.45	-3.51	-2.17	-0.68	-1.98	-4.72								2022

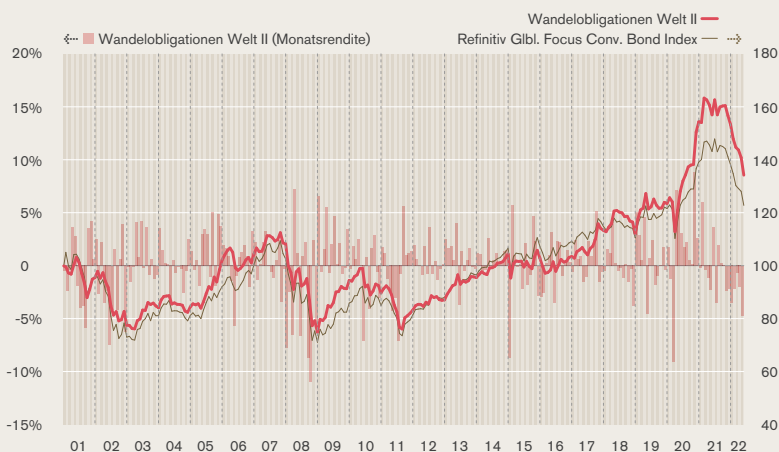
*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.



02

Kumulierte Performance

2001-2022, 26.01.2001=100



03

Vergleichsanalyse

(26.01.2001 – 31.05.2022)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Wandelobligationen Welt II	34.19%	0.16%	1.38%	8.85%	55.25%	-10.99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	22.76%	0.13%	0.96%	8.21%	57.59%	-10.38%
	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	
Wandelobligationen Welt II	-33.45%	1.23	2.98%	10.34%	0.10	
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	-34.99%	1.36	3.04%	10.54%	0.06	
	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error	
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	0.95	0.90	0.0049	0.93	3.46%	

*Risikofreie Rendite: Libor 3M

