



1

PRISMA ESG World Convertible Bonds
CH0011798458

VNI: CHF 1'599,38

Gestion déléguée Lazard Asset Management LLC (depuis le 02.06.2017)

Banque dépositaire Credit Suisse, Zurich

Administrateur Credit Suisse, Zurich

Distribution Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur Ernst & Young, Lausanne

Numéro de valeur / Bloomberg 117 98 45 / PRIOBCM SW

Monnaie de référence Francs suisses (CHF)

Date de lancement 26 janvier 2001

Benchmark Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

Date de fin d'exercice 31 mars

Publication des cours
Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et
www.prisma-fondation.ch

Liquidité hebdomadaire

Prix d'émission CHF 1000.-

Frais
Aucun frais de souscription.
Les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts.

TER KGAST 0,62%

Prisma Fondation d'investissement
Rue du Sablon 2
Case postale
CH-1110 Morges 1
Tél.: 0848 106 106
www.prisma-fondation.ch
info@prisma-fondation.ch

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.

01

Performances mensuelles

2014-2021

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
10,52	9,32	1,18	1,11	-0,69	-0,40	2,64	0,05	0,54	1,22	0,12	0,39	1,40	1,42	2014
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
4,46	3,58	-0,22	6,00	-0,42	-1,19	-2,32	3,61	-3,48	1,89					2021

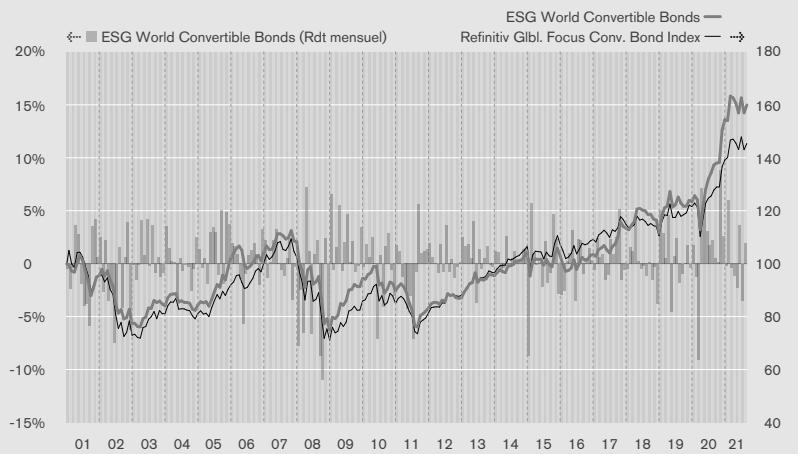
*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.



02

Performance cumulée

2001-2021, 26.01.2001=100



03

Analyse comparative

(26.01.2001 – 31.08.2021)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG World Convertible Bond	59,94%	0,23%	2,30%	8,85%	56,45%	-10,99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	45,38%	0,20%	1,83%	8,21%	59,68%	-10,38%
	Drawdown maximum	Ratio gains:perdes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	
ESG World Convertible Bond	-33,45%	1,30	3,00%	10,38%	0,16	
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	-34,99%	1,48	3,07%	10,62%	0,12	
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.	
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	0,95	0,90	0,0056	0,92	3,48%	

*Taux sans risque: Libor 3M

