PRISMA ESG Global Credit Allocation

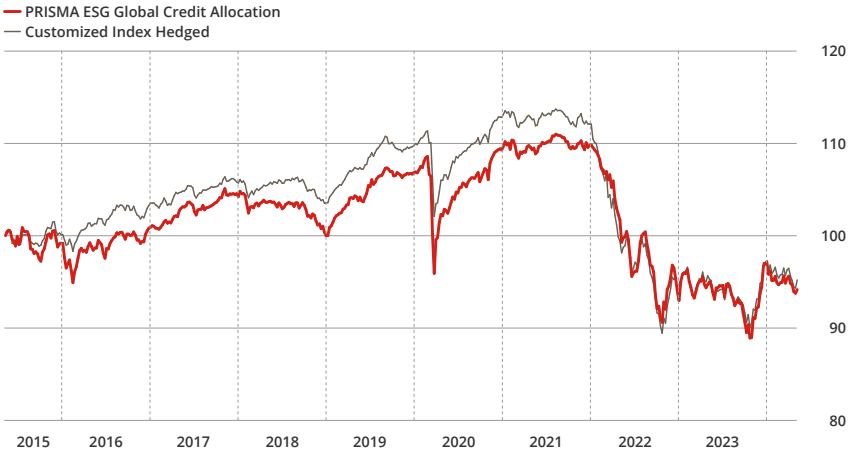
ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT, PARIS

Delegierte Verwaltung seit dem 08.05.2015

Diese aktiv verwaltete Anlagegruppe zeichnet sich durch ein dynamisches Management an allen Anleihenmärkten aus. Investiert wird in Unternehmensanleihen, Wandelanleihen, Staatsanleihen und Geldinstrumente. Empfohlen wird eine Mindestanlagedauer von drei Jahren. Die originelle Anlagestrategie basiert unter anderem auf quantitativen und makroökonomischen Indikatoren, die dafür sorgen, dass die Anlagen in Anleihekategorien mit guten Wachstums- und Renditeaussichten erfolgen. Indem er die risikoarmen und risikoreichen Titel entsprechend gewichtet, kann sich der Verwalter dem Zinsmarkt- und Kreditmarktzyklen flexibel anpassen.

INDEXIERTE PERFORMANCE*

PRISMA ESG Global Credit Allocation (08.05.2015=100, 03.05.2024=94.17)



MONATSRENDITE*

Jahresrendite [%] Customized Index Hedged	Monatsrendite [%] PRISMA ESG Global Credit Allocation	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2.11	3.27	-0.35	0.99	0.20	0.92	0.60	-0.70	0.20	0.24	0.54	1.10	-0.25	-0.26	2017
-2.00	-3.79	-0.24	-0.64	0.19	0.06	-0.30	-0.34	0.47	0.15	-0.24	-1.40	-0.56	-0.99	2018
5.70	6.29	1.43	0.80	0.82	0.89	-0.59	1.56	0.84	1.07	-0.31	-0.37	0.18	-0.17	2019
3.33	2.93	0.75	-0.68	-6.12	2.74	0.73	1.11	0.51	0.80	-0.04	-0.02	2.78	0.63	2020
-0.95	0.11	-0.32	-0.55	0.27	0.24	0.31	0.23	0.81	-0.11	-0.85	-0.17	0.10	0.16	2021
-16.72	-15.35	-1.00	-1.48	-1.03	-4.06	-1.80	-4.08	4.40	-2.92	-5.16	0.38	3.46	-2.80	2022
4.24	4.48	2.84	-2.40	1.90	-0.39	-0.81	0.72	0.01	-1.23	-3.04	-1.85	4.73	4.26	2023
-3.11	-3.46	-1.35	-1.15	0.95	-1.93									2024

PERFORMANCE ZUM 3. MAI 2024*

	2021	2022	2023	2024	Seit dem 08.05.15	Ann. Vol.
PRISMA ESG Global Credit Allocation	0.11%	-15.35%	4.48%	-3.05%	-5.83%	5.37%
Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged	-0.95%	-16.72%	4.24%	-2.16%	-4.79%	4.45%

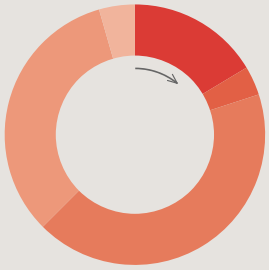
*Die Performances beziehen sich auf die Klasse II.

Copyright © 2024 PRISMA. Alle Rechte vorbehalten.

MERKMALE

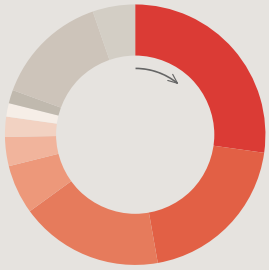
BVV 2-Klassifizierung
Obligationen
Depotbank
Credit Suisse (Suisse) AG, Zürich
Administrator
Credit Suisse Funds SA, Zürich
Vertrieb
Key Investment Services (KIS) AG, Morges
Kontrollstelle
Ernst & Young AG, Lausanne
Valoren-Nummer
Klasse I: 117069211
Klasse II: 27699760
Klasse III: 117069250
Bloomberg
Klasse I: PRGCAIO SW
Klasse II: PRSCAEA SW
Klasse III: PRGCAIC SW
ISIN
Klasse I: CH1170692110
Klasse II: CH0276997605
Klasse III: CH1170692508
Referenzwährung
Schweizer Franken (CHF)
Datum der Lancierung
8. Mai 2015
Jahresabschluss
31. März
Offizielle Benchmark
Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged (Customized Index Hedged bis zum 31.12.2021)
Publikation der Kurse
Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung
Emissionspreis
CHF 1'000
NIW am 03.05.2024
Klasse I: CHF 940.72
Klasse II: CHF 941.73
Klasse III: CHF 942.30
Verwaltetes Vermögen
CHF 58.0 Mio.
Liquidität
Wöchentlich
Zeichnungstermin
Donnerstag 17.00 Uhr
Rückgabetermin
Donnerstag 17.00 Uhr
Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+2 (Dienstag)
Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+2 (Dienstag)
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 31.03.2023
Klasse I: 1.04%
Klasse II: 0.94%*
Klasse III: 0.96%
*Wert beeinflusst durch Vermögensbewegungen, die bei der Gründung der Klassen I und III am 01.04.2022 stattgefunden haben

AUFTEILUNG NACH ANLAGEKLASSEN



Cash	16.4%
Convertibles	3.8%
High Yield	42.2%
Souverain	33.2%
Synth. CBs	4.4%

GEOGRAPHISCHE AUFTEILUNG



USA	27.2%
Deutschland	20.1%
Frankreich	17.8%
Italien	6.1%
Grossbritannien	3.5%
Spanien	2.7%
Luxemburg	1.6%
Schweden	1.5%
Übrige	14.1%
Cash	5.4%

KERNELEMENTE

[+] Allokation in globalen Anleihensegmenten;
[+] Flexibles Portfoliomanagement, basierend auf der Top-Down-Vision von Ellipsis AM und einem quantitativen Ansatz;
[+] Zugang zum spezialisierten Management von Ellipsis-AM.

SFDR- KLASSIFIKATION

Die SFDR-Klassifizierung der Anlagegruppe lautet auf „Artikel 8“.

DIE ANLAGESTIFTUNG PRISMA VON VORSORGEFACHLEUTEN FÜR VORSORGEFACHLEUTE

PRISMA ist eine gemeinnützige Anlagestiftung, die im Jahr 2000 von Vorsorgeeinrichtungen der 2. Säule gegründet wurde. Heute ist PRISMA eine der wenigen nationalen Institutionen, die direkt von Fachleuten Schweizer Pensionskassen geführt wird. Die Anlagestiftung verfügt über eine grosse Anzahl von Mitglieder-Investoren, denen sie die Verwaltung einer diversifizierten und innovativen Palette von Anlageprodukten mit grösstmöglicher Transparenz anbietet. Die offene Architektur von PRISMA ermöglicht spezialisierte Managementansätze und -techniken mit einem attraktiven Risiko-Ertrags-Verhältnis, die den spezifischen Bedürfnissen von Pensionskassen entsprechen.

Mit dem festen Willen, nicht einfach nur Bestehendes zu reproduzieren, sondern eigene Wege zu gehen, schlägt PRISMA spezifische und innovative Anlagelösungen vor.

ANLAGEGRUPPEN

Aktien
PRISMA ESG SPI® Efficient
PRISMA Global Residential Real Estate
PRISMA ESG Sustainable SOCIETY
PRISMA ESG China Equities
PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities

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

Infrastruktur
PRISMA ESG Global Infrastructure

Alternative Anlagen
PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1
PRISMA Alternative Multi-Manager
PRISMA SHARP

Immobilien
PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate
PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Anlagestiftung - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tel. 0848 106 106 - info@prismaanlagestiftung.ch - www.prismaanlagestiftung.ch

Dieses Dokument dient einzig zu Informationszwecken und stellt keine Anlageberatung für Finanzprodukte dar. Aufgrund ihrer Vereinfachung sind die in diesem Dokument enthaltenen Informationen nur teilweise zutreffend. Sie können subjektiv sein und können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Alle diese Angaben wurden in gutem Glauben auf den Grundlagen von Marktinformationen erstellt. Für die aus externen Informationsquellen stammenden Elemente, kann die Richtigkeit nicht garantiert werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die Zukünftige. Die PRISMA Anlagestiftung haftet nicht für Entscheidungen, die auf der Grundlage dieser Informationen getroffen werden. Anlegern, die eine Investition in dieses Produkt erwägen, wird empfohlen, ihre Entscheidung nicht allein auf die in diesem Dokument enthaltenen Elemente zu stützen. Alle Dokumente, die rechtliche Grundlagen für eine eventuelle Anlage bilden, können kostenlos bei der PRISMA Anlagestiftung angefordert werden.

Copyright © 2024 PRISMA. Alle Rechte vorbehalten.