

## MERKMALE

### BVV 2-Klassifizierung

Obligationen

### Delegierte Verwaltung / Manager

Ellipsis Asset Management, Paris

### 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: PRSCAIA 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 29.09.2023

Klasse I: CHF 905.58

Klasse II: CHF 906.29

Klasse III: CHF 906.67

### Verwaltetes Vermögen

CHF 56.4 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

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

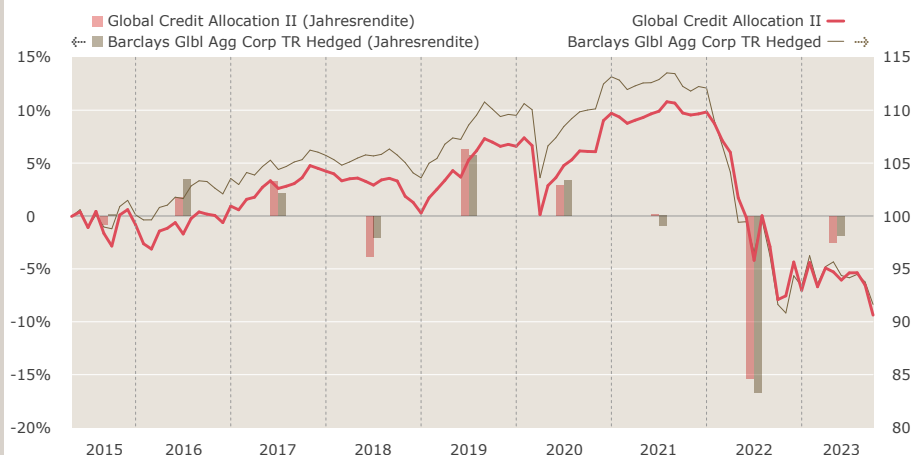
2016–2023

| Jahresrendite<br>[%]             |        | Monatsrenditen<br>[%] |       |       |       |       |       |      |       |       |       |       |       |      |
|----------------------------------|--------|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| *Barclays Gbl<br>Agg Corp TR Hed |        | Jan                   | Feb   | Mär   | Apr   | Mai   | Jun   | Jul  | Aug   | Sep   | Okt   | Nov   | Dez   |      |
| 3.43                             | 1.78   | -1.80                 | -0.52 | 1.75  | 0.27  | 0.54  | -1.08 | 1.48 | 0.63  | -0.21 | -0.13 | -0.67 | 1.57  | 2016 |
| 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 |
| -1.83                            | -2.52  | 2.84                  | -2.40 | 1.90  | -0.39 | -0.81 | 0.72  | 0.01 | -1.23 | -3.04 |       |       |       | 2023 |

\*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

## Kumulierte Performance

2015–2023, 08.05.2015=100



## Vergleichsanalyse

(08.05.2015 – 30.09.2023)

|                                | Kumulierte<br>Performance | Arithm.<br>Durchschnitt | Annualisierte<br>Performance | Beste Monat             | Positive<br>Monate           | Schlechtester<br>Monat |
|--------------------------------|---------------------------|-------------------------|------------------------------|-------------------------|------------------------------|------------------------|
| Global Credit<br>Allocation II | -9.37%                    | -0.08%                  | -1.16%                       | 4.40%                   | 51.49%                       | -6.12%                 |
| Barclays Gbl<br>Agg Corp TR H  | -8.36%                    | -0.08%                  | -1.03%                       | 3.88%                   | 53.47%                       | -5.84%                 |
|                                | 3. Quartal<br>2023        | Max.<br>Drawdown        | Gewinn/Verlus<br>t Ratio     | Standard-<br>Abweichung | Annualisierte<br>Volatilität | Ann.<br>Sharpe-Ratio*  |
| Global Credit<br>Allocation II | -4.22%                    | -18.20%                 | 1.06                         | 1.60%                   | 5.55%                        | -0.28                  |
| Barclays Gbl<br>Agg Corp TR H  | -2.67%                    | -19.99%                 | 1.15                         | 1.50%                   | 5.18%                        | -0.27                  |
|                                | Korrel.*                  | R2*                     | Ann. Jensen's<br>Alpha*      | Beta*                   | Ann. Tracking<br>Error       |                        |
| Barclays Gbl<br>Agg Corp TR H  | 0.94                      | 0.88                    | -0.0013                      | 1.00                    | 1.95%                        |                        |

\*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

## MERKMALE

**BVV 2-Klassifizierung**  
Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**  
Ellipsis Asset Management, Paris

**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: PRSCAIA 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 29.09.2023**  
Klasse I: CHF 905.58  
Klasse II: CHF 906.29  
Klasse III: CHF 906.67

**Verwaltetes Vermögen**  
CHF 56.4 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

Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlichen  
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

Global Credit Allocation II vs. Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged  
Annualisierte Monatl. Mehrrendite [%]

|  |       | Jan   | Feb   | Mär   | Apr   | Mai   | Jun   | Jul   | Aug   | Sep   | Okt   | Nov   | Dez   |      |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
|  | -3.39 | -1.33 | -0.52 | 0.57  | 0.06  | -0.20 | -0.95 | 0.31  | 0.15  | -0.14 | 0.48  | -0.15 | 0.15  | 2016 |
|  | 2.39  | 0.20  | -0.12 | 0.43  | 0.15  | 0.03  | 0.14  | -0.07 | -0.16 | 0.33  | 0.25  | -0.07 | 0.04  | 2017 |
|  | -3.48 | 0.14  | -0.14 | -0.10 | -0.29 | -0.58 | -0.25 | 0.33  | -0.33 | 0.30  | -0.73 | 0.37  | -0.54 | 2018 |
|  | 1.25  | 0.09  | 0.37  | -0.46 | 0.34  | -0.46 | 0.29  | -0.03 | -0.06 | 0.30  | 0.27  | -0.01 | -0.09 | 2019 |
|  | -0.83 | -0.27 | -0.16 | -0.28 | -0.16 | 0.00  | 0.13  | -0.18 | 0.21  | -0.20 | -0.12 | 0.64  | 0.02  | 2020 |
|  | 2.10  | -0.04 | 0.24  | -0.04 | -0.01 | 0.29  | -0.04 | 0.26  | -0.05 | 0.22  | 0.22  | -0.29 | 0.29  | 2021 |
|  | 2.30  | 1.79  | 0.68  | 1.29  | 0.49  | -1.85 | -1.17 | 1.26  | 0.47  | -0.38 | 1.25  | -0.42 | -1.74 | 2022 |
|  | -1.35 | -0.27 | 0.37  | 0.17  | -0.87 | 0.54  | 0.95  | -0.33 | -0.47 | -0.78 |       |       |       | 2023 |

## Kennzahlen

1 Jahr

(30.09.2022 – 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

|                             | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Global Credit Allocation II | -1.60%                    | 7.33%                     | -0.27              | 2.92%               | -                           |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  | 0.02%                     | 7.02%                     | -0.05              |                     |                             |

|                             | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-----------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Global Credit Allocation II | -0.56            | 0.96  | -0.0164              | -5.25%        | N/A             |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  |                  |       |                      | -4.79%        | N/A             |

\*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

## Kennzahlen

5 Jahre

(30.09.2018 – 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

|                             | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Global Credit Allocation II | -2.58%                    | 6.59%                     | -0.45              | 2.20%               | -                           |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  | -2.82%                    | 6.33%                     | -0.51              |                     |                             |

|                             | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-----------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Global Credit Allocation II | 0.11             | 0.98  | 0.0019               | -18.20%       | N/A             |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  |                  |       |                      | -19.99%       | N/A             |

\*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

## Kennzahlen

Seit der Lancierung

(08.05.2015 – 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

|                             | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-----------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Global Credit Allocation II | -1.16%                    | 5.55%                     | -0.28              | 1.95%               | -                           |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  | -1.03%                    | 5.18%                     | -0.27              |                     |                             |

|                             | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-----------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Global Credit Allocation II | -0.07            | 1.00  | -0.0013              | -18.20%       | N/A             |
| Barclays Gbl Agg Corp TR H  |                  |       |                      | -19.99%       | N/A             |

\*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months