

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: 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 29.12.2023

Klasse I: CHF 970.45

Klasse II: CHF 971.33

Klasse III: CHF 971.81

Veraltetes Vermögen

CHF 60.5 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 Anlagendauer 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.

Monatsrenditen

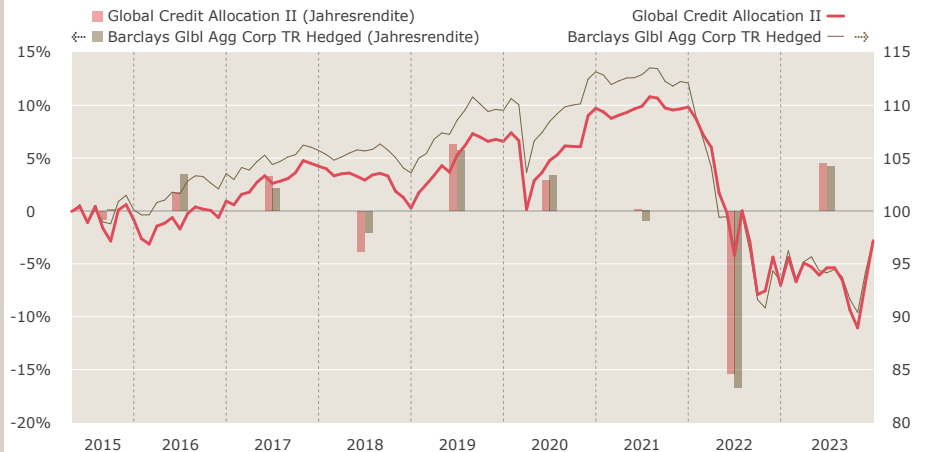
2016–2023

Jahresrendite [%]		Monatsrenditen [%]												
*Barclays Gbl 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
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

*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

Kumulierte Performance

2015–2023, 08.05.2015=100



Vergleichsanalyse

(08.05.2015 – 31.12.2023)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Global Credit Allocation II	-2.87%	-0.01%	-0.34%	4.73%	51.92%	-6.12%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-2.69%	-0.01%	-0.31%	4.15%	53.85%	-5.84%

	4. Quartal 2023	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Global Credit Allocation II	7.18%	-19.71%	1.08	1.71%	5.92%	-0.12
Barclays Gbl Agg Corp TR H	6.18%	-20.37%	1.17	1.57%	5.45%	-0.13

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0.94	0.89	-0.0000	1.02	1.97%

*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: 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 29.12.2023
Klasse I: CHF 970.45
Klasse II: CHF 971.33
Klasse III: CHF 971.81

Veraltetes Vermögen
CHF 60.5 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 Monatliche Mehrrendite [%]

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2016	-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
2017	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
2018	-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
2019	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
2020	-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
2021	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
2022	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
2023	0.49	-0.27	0.37	0.17	-0.87	0.54	0.95	-0.33	-0.47	-0.78	-0.50	0.58	0.91

Kennzahlen

1 Jahr

(31.12.2022 – 31.12.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	4.48%	8.84%	0.46	2.21%	2.16%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	4.24%	7.88%	0.48		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	0.10	1.09	-0.0011	-6.96%	2
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-6.07%	2

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

5 Jahre

(31.12.2018 – 31.12.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	-0.64%	7.22%	-0.14	2.21%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-1.25%	6.82%	-0.24		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	0.28	1.01	0.0063	-19.71%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-20.37%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

Seit der Lancierung

(08.05.2015 - 31.12.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	-0.34%	5.92%	-0.12	1.97%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-0.31%	5.45%	-0.13		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	-0.01	1.02	-0.0000	-19.71%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-20.37%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months