

**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.

**Monatsrenditen**

2022-2023

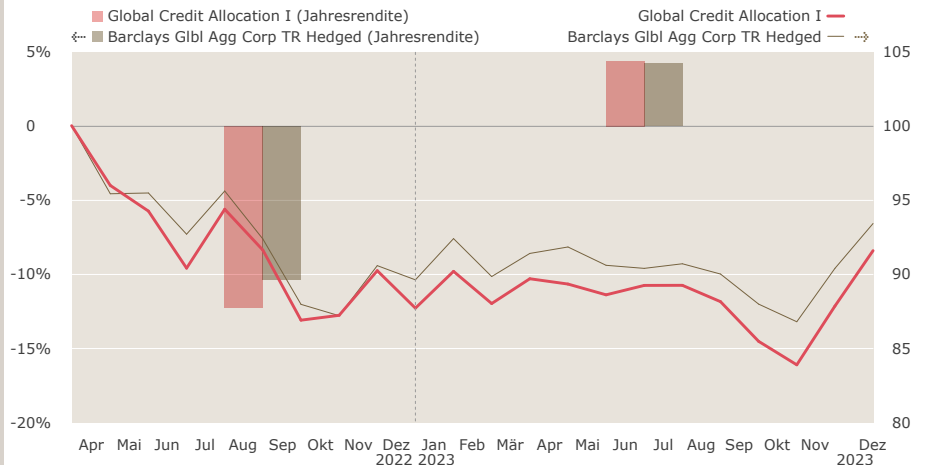
Jahresrendite [%]	Monatsrenditen [%]	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
-10.36	-12.27				-3.99	-1.80	-4.09	4.40	-2.92	-5.16	0.38	3.45	-2.80
4.24	4.42	2.83	-2.41	1.90	-0.40	-0.81	0.72	0.01	-1.24	-3.04	-1.85	4.73	4.26

\*Barclays Gbl Agg Corp TR Hed

\*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

**Kumulierte Performance**

2022-2023, 01.04.2022=100



**Vergleichsanalyse**

(01.04.2022 – 31.12.2023)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Global Credit Allocation I	-8.39%	-0.37%	-4.89%	4.73%	42.86%	-5.16%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-6.56%	-0.29%	-3.80%	4.15%	42.86%	-4.78%

	4. Quartal 2023	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Global Credit Allocation I	7.16%	-16.10%	0.75	3.01%	10.42%	-0.52
Barclays Gbl Agg Corp TR H	6.18%	-13.19%	0.75	2.71%	9.39%	-0.45

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0.95	0.91	-0.0089	1.06	3.14%

\*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 I vs. Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged  
Annualisierte Monatl. Mehrrendite [%]

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez		
2022	-3.39			0.56	-1.86	-1.17	1.25	0.46	-0.39	1.25	-0.42	-1.74	2022	
2023	0.38	-0.27	0.36	0.16	-0.88	0.53	0.95	-0.34	-0.47	-0.78	-0.50	0.58	0.91	2023

**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 I	4.42%	8.84%	0.45	2.22%	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 I	0.08	1.09	-0.0016	-7.00%	2
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-6.07%	2

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

**Kennzahlen**

Seit der Lancierung

(01.04.2022 – 31.12.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation I	-4.89%	10.42%	-0.52	3.14%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-3.80%	9.39%	-0.45		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation I	-0.36	1.06	-0.0089	-16.10%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-13.19%	N/A

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