

**MERKMALE**

**BVV 2-Klassifizierung**

Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**

Ellipsis Asset Management, Paris

**Depotbank**

UBS Switzerland AG, Zürich

**Administrator**

UBS Switzerland AG, 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 31.12.2024**

Klasse I: CHF 946.82

Klasse II: CHF 948.15

Klasse III: CHF 948.91

**Veraltetes Vermögen**

CHF 58.4 Mio.

**Liquidität**

Wöchentlich

**Zeichnungstermin**

Donnerstag 10.00 Uhr

**Rückgabetermin**

Donnerstag 10.00 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 31.03.2024**

Klasse I: 1.09%

Klasse II: 1.04%

Klasse III: 1.01%

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**

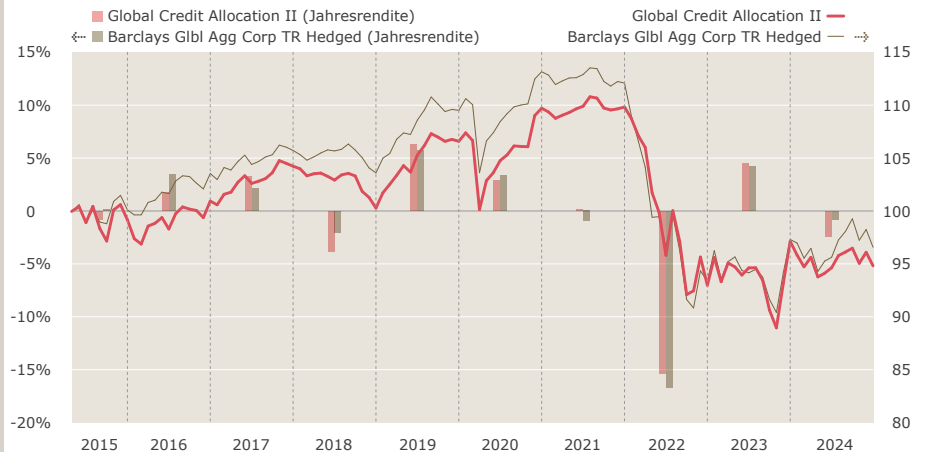
2017-2024

Jahresrendite [%]	Monatsrenditen [%]	Monatsrenditen												
		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
-0.76	-2.39	-1.35	-1.15	0.95	-1.93	0.37	0.56	1.21	0.34	0.38	-1.48	1.10	-1.34	2024

\*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

**Kumulierte Performance**

2015-2024, 08.05.2015=100



**Vergleichsanalyse**

(08.05.2015 - 31.12.2024)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Global Credit Allocation II	-5.19%	-0.03%	-0.55%	4.73%	52.59%	-6.12%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-3.43%	-0.02%	-0.36%	4.15%	54.31%	-5.84%

	4. Quartal 2024	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Global Credit Allocation II	-1.73%	-19.71%	1.11	1.66%	5.74%	-0.16
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-2.71%	-20.37%	1.19	1.55%	5.38%	-0.14

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Barclays Gbl Agg Corp TR H	0.94	0.89	-0.0019	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**  
UBS Switzerland AG, Zürich

**Administrator**  
UBS Switzerland AG, 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 31.12.2024**  
Klasse I: CHF 946.82  
Klasse II: CHF 948.15  
Klasse III: CHF 948.91

**Verwaltetes Vermögen**  
CHF 58.4 Mio.

**Liquidität**  
Wöchentlich

**Zeichnungstermin**  
Donnerstag 10.00 Uhr

**Rückgabetermin**  
Donnerstag 10.00 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 31.03.2024**  
Klasse I: 1.09%  
Klasse II: 1.04%  
Klasse III: 1.01%

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.

**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		
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	2017
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	2018
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	2019
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	2020
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	2021
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	2022
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	2023
2024	-3.20	-0.99	0.32	-0.03	0.33	-0.67	0.18	-0.51	-0.47	-0.84	0.57	0.05	0.37	2024

**Kennzahlen**

1 Jahr

(31.12.2023 – 31.12.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	-2.39%	4.00%	-0.70	1.84%	2.04%
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-0.76%	5.00%	-0.23		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	-0.90	0.75	-0.0193	-3.46%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-3.11%	4

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

**Kennzahlen**

5 Jahre

(31.12.2019 – 31.12.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	-2.31%	7.28%	-0.37	2.32%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-2.48%	7.00%	-0.41		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	0.07	0.98	0.0013	-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 - 31.12.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Global Credit Allocation II	-0.55%	5.74%	-0.16	1.95%	-
Barclays Gbl Agg Corp TR H	-0.36%	5.38%	-0.14		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Global Credit Allocation II	-0.10	1.00	-0.0019	-19.71%	N/A
Barclays Gbl Agg Corp TR H				-20.37%	N/A

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