PRISMA ESG Global Credit Allocation I

Quartalsbericht | Juni 2025

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, LSEG, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

Emissionspreis
CHF 1'000

NIW am 30.06.2025
Klasse I: CHF 949.95
Klasse II: CHF 951.52
Klasse III: CHF 952.42

Verwaltetes Vermögen
CHF 57.1 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.

Monatsrenditen

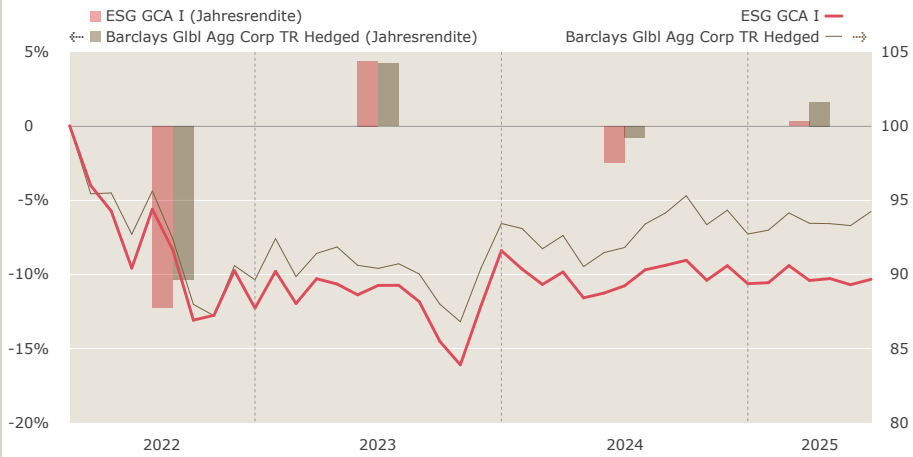
2022–2025

Jahresrendite [%]		Monatsrenditen [%]												
*Barclays Glbl Agg Corp TR Hed		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	2022
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	2023
-0.76	-2.43	-1.35	-1.16	0.94	-1.94	0.37	0.55	1.21	0.34	0.38	-1.49	1.09	-1.34	2024
1.64	0.33	0.07	1.29	-1.11	0.14	-0.46	0.41							2025

*Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged.

Kumulierte Performance

2022–2025, 01.04.2022=100



Vergleichsanalyse

(01.04.2022 – 30.06.2025)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
ESG GCA I	-10.33%	-0.25%	-3.30%	4.73%	51.28%	-5.16%
Barclays Glbl Agg Corp TR H	-5.75%	-0.13%	-1.81%	4.15%	48.72%	-4.78%

	2. Quartal 2025	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
ESG GCA I	0.09%	-16.10%	1.05	2.29%	7.94%	-0.47
Barclays Glbl Agg Corp TR H	0.85%	-13.19%	0.95	2.14%	7.42%	-0.30

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Barclays Glbl Agg Corp TR H	0.95	0.90	-0.0150	1.01	2.51%

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

PRISMA ESG Global Credit Allocation I

Quartalsbericht | Juni 2025

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, LSEG, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

Emissionspreis
CHF 1'000

NIW am 30.06.2025
Klasse I: CHF 949.95
Klasse II: CHF 951.52
Klasse III: CHF 952.42

Verwaltetes Vermögen
CHF 57.1 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

ESG GCA I vs. Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged

Annualisierte Mehrrendite [%]	Monatliche Mehrrendite [%]												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
-3.39				0.56	-1.86	-1.17	1.25	0.46	-0.39	1.25	-0.42	-1.74	2022
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
-3.30	-0.99	0.31	-0.03	0.33	-0.68	0.18	-0.52	-0.48	-0.85	0.56	0.05	0.37	2024
-2.65	-0.21	0.04	-0.37	0.17	-0.32	-0.61							2025

Kennzahlen

1 Jahr

(30.06.2024 – 30.06.2025, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
ESG GCA I	0.49%	3.34%	0.03	1.46%	1.96%
Barclays Glbl Agg Corp TR H	2.65%	4.18%	0.54		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
ESG GCA I	-1.45	0.76	-0.0158	-1.82%	N/A
Barclays Glbl Agg Corp TR H				-2.71%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

Seit der Lancierung

(01.04.2022 – 30.06.2025, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
ESG GCA I	-3.30%	7.94%	-0.47	2.51%	-
Barclays Glbl Agg Corp TR H	-1.81%	7.42%	-0.30		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
ESG GCA I	-0.61	1.01	-0.0150	-16.10%	N/A
Barclays Glbl Agg Corp TR H				-13.19%	N/A

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months