

**MERKMALE**

**BVV 2-Klassifizierung**

Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**

Lazard Asset Management LLC, New York

**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: 111735898

Klasse II: 1179845

Klasse III: 111735916

**Bloomberg**

Klasse I: PRWCBCH SW

Klasse II: PRIOBCM SW

Klasse III: PRWCBIC SW

**ISIN**

Klasse I: CH1117358981

Klasse II: CH0011798458

Klasse III: CH1117359161

**Referenzwährung**

Schweizer Franken (CHF)

**Datum der Lancierung**

26. Januar 2001

**Jahresabschluss**

31. März

**Offizielle Benchmark**

Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

**Publikation der Kurse**

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

**Emissionspreis**

CHF 1'000

**NIW am 28.03.2024**

Klasse I: CHF 1'283.37

Klasse II: CHF 1'284.64

Klasse III: CHF 1'285.41

**Veraltetes Vermögen**

CHF 85,5 Mio.

**Liquidität**

Wöchentlich

**Zeichnungstermin**

Donnerstag 17.00 Uhr

**Rückgabetermin**

Montag 17.00 Uhr

**Abrechnungsdatum (Zeichnung)**

Z+3 (Mittwoch)

**Abrechnungsdatum (Rückgaben)**

Z+4 (Donnerstag)

**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: 0.67%

Klasse II: 0.59%\*

Klasse III: 0.59%

\*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**

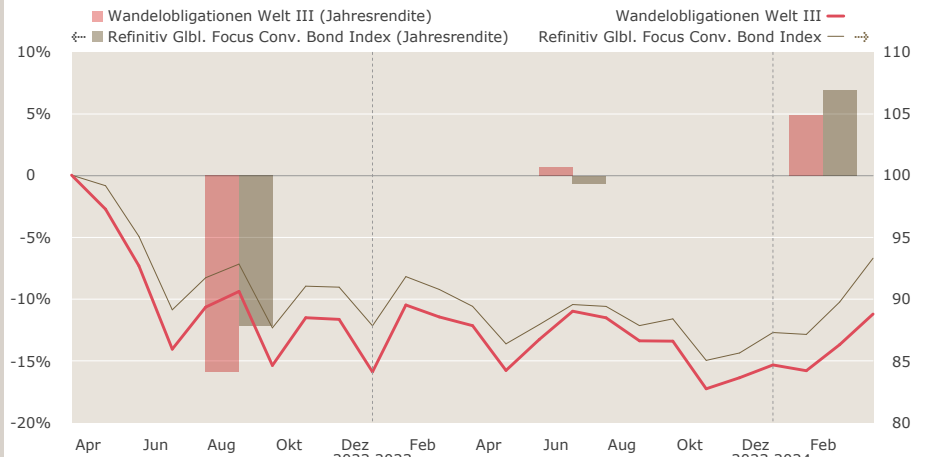
2022-2024

Jahresrendite [%]	Monatsrenditen [%]												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
*Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bon	-12.16	-15.89		-2.71	-4.72	-7.28	3.96	1.42	-6.62	4.57	-0.15	-4.81	2022
	-0.62	0.67	6.44	-1.08	-0.80	-4.13	2.98	2.63	-0.60	-2.11	-0.03	-4.46	2023
	6.89	4.87	-0.55	2.51	2.87								2024

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Kumulierte Performance**

2022-2024, 01.04.2022=100



**Vergleichsanalyse**

(01.04.2022 – 31.03.2024)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Wandelobligationen Welt III	-11.21%	-0.43%	-5.77%	6.44%	41.67%	-7.28%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-6.69%	-0.24%	-3.40%	4.54%	45.83%	-6.26%

	1. Quartal 2024	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Wandelobligationen Welt III	4.87%	-17.26%	0.71	3.62%	12.56%	-0.50
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	6.89%	-14.96%	0.85	3.04%	10.53%	-0.36

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.98	0.96	-0.0184	1.17	3.12%

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

**MERKMALE**

**BVV 2-Klassifizierung**

Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**

Lazard Asset Management LLC, New York

**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: 111735898

Klasse II: 1179845

Klasse III: 111735916

**Bloomberg**

Klasse I: PRWCBCH SW

Klasse II: PRIOBCM SW

Klasse III: PRWCBIC SW

**ISIN**

Klasse I: CH1117358981

Klasse II: CH0011798458

Klasse III: CH1117359161

**Referenzwährung**

Schweizer Franken (CHF)

**Datum der Lancierung**

26. Januar 2001

**Jahresabschluss**

31. März

**Offizielle Benchmark**

Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

**Publikation der Kurse**

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung

**Emissionspreis**

CHF 1'000

**NIW am 28.03.2024**

Klasse I: CHF 1'283.37

Klasse II: CHF 1'284.64

Klasse III: CHF 1'285.41

**Veraltetes Vermögen**

CHF 85,5 Mio.

**Liquidität**

Wöchentlich

**Zeichnungstermin**

Donnerstag 17.00 Uhr

**Rückgabetermin**

Montag 17.00 Uhr

**Abrechnungsdatum (Zeichnung)**

Z+3 (Mittwoch)

**Abrechnungsdatum (Rückgaben)**

Z+4 (Donnerstag)

**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: 0.67%

Klasse II: 0.59%\*

Klasse III: 0.59%

\*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.

**Mehrenditen**

Wandelobligationen Welt III vs. Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index

Annualisierte Mehrrendite [%]

Monatliche Mehrrendite [%]

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez		
2022	-6.42			-1.90	-0.58	-1.02	1.05	0.22	-1.05	0.71	-0.06	-1.38	2022	
2023	2.58	1.91	0.05	0.71	-0.73	1.17	0.79	-0.43	-0.37	-0.65	-0.65	0.38	-0.70	2023
2024	-4.28	-0.38	-0.50	-1.08									2024	

**Kennzahlen**

1 Jahr

(31.03.2023 – 31.03.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt III	1.07%	9.04%	0.08	2.32%	2.72%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	4.36%	8.31%	0.47		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt III	-1.38	1.06	-0.0343	-7.06%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-5.05%	4

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

**Kennzahlen**

Seit der Lancierung

(01.04.2022 – 31.03.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt III	-5.77%	12.56%	-0.50	3.12%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-3.40%	10.53%	-0.36		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt III	-0.80	1.17	-0.0184	-17.26%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-14.96%	N/A

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