

## 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: PRWCBCB SW

Klasse II: PRIOBCM SW

Klasse III: PRWCBCB SW

### ISIN

Klasse I: CH1117358981

Klasse II: CH0011798458

Klasse III: CH1117359161

### Referenzwährung

Schweizer Franken (CHF)

### Datum der Lancierung

26. Januar 2021

### 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 30.06.2023

Klasse I: CHF 1'287.48

Klasse II: CHF 1'288.25

Klasse III: CHF 1'288.73

### Verwaltetes Vermögen

CHF 83.7 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 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: 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.

## Quartalsbericht des Verwalters

Im 2. Quartal standen die Zeichen für Risikoanlagen auf grün. Ihnen gaben das unerwartet widerstandsfähige Wirtschaftswachstum, solide Quartalszahlen und die geringere Zinsvolatilität Auftrieb. Obwohl die hohe Inflation die Zentralbanken auf der ganzen Welt dazu veranlasste, wachsam zu bleiben, konzentrierte sich der Markt auf die sich verdichtenden Anzeichen einer Disinflation und die Hoffnung auf ein baldiges Ende des Zinserhöhungszyklus. Trotz der weltweiten Abschwächung im verarbeitenden Gewerbe und im Immobiliensektor erwies sich der private Konsum als erstaunlich widerstandsfähig. Vor diesem Hintergrund bewährten sich die internationale Wandelanleihen, da sich ihre Branchenallokation und ihre konvexen Strukturen günstig auswirkten.

Im Berichtszeitraum legte die Anlagegruppe PRISMA ESG World Convertible Bonds 1.33% zu. Der Vergleichsindex Refinitiv Global Focus Convertible Bonds gewann 0.17%. Die Aktien bleiben im Portfolio übergewichtet: Ihr Anteil wurde im Quartal auf 59.1% erhöht. Im Index machten sie 54.4% aus. Die Zinssensitivität sank im Quartal auf 1.51 und entsprach somit jener der Benchmark (1.52).

In den USA haben wir unser Engagement in den Sektoren Halbleiter, Medien und Versorger ausgebaut und unser Engagement in den Sektoren Zahlungsdienste, Software, Social Media und Automobilbranche reduziert. In Europa wurde die Allokation im Bekleidungs- und Immobiliensektor verringert. In Asien haben wir unser Engagement in Halbleiter verstärkt und im Gegenzug jenes in Nicht-Basis-Konsumgütern zurückgenommen.

Die Outperformance im Quartal ist vor allem der Titelauswahl zu verdanken. Unsere wachstumsstarken Small- und Mid-Cap-Titel in den USA, insbesondere in den Bereichen Software, IT-Sicherheit und Halbleiter, generierten relativ gesehen ein Plus. Auch die Recovery-Papiere, insbesondere in der Kreuzfahrt- und Eventbranche in den USA, die tourismusgebundenen Sektoren in Europa (Fluggesellschaften, Hotels) Elektronikunternehmen in Asien haben sich positiv bemerkbar gemacht. Besonders erfolgreich war unsere Titelauswahl im Gesundheitswesen, dies dank eines gewinnbringenden M&A-Deals. Hingegen schwächten unsere Technologietitel in Europa sowie der Bekleidungs- und Kommunikationssektor in Asien das relative Quartalsergebnis.

An den Aktienmärkten gab es im bisherigen Jahr nur einige wenige Gewinner. Diese waren bei den Mega-Cap-Unternehmen, die im Wandelanleihen-Universum nicht anzutreffen sind, zu suchen. Nachdem die bei den Wandelanleihen stark vertretenen Small- und Mid-Cap-Wachstumstitel den grössten Teil der Jahre 2021 und 2022 enttäuschten, ging es mit ihnen erst gegen Ende des 2. Quartals wieder bergauf. Wir gehen davon aus, dass viele dieser Unternehmen solide Ergebnisse vorweisen werden und weniger empfindlich auf makroökonomische Faktoren reagieren, was ihre Papiere für Anleger attraktiver machen dürfte. Eine beträchtliche Anzahl von Recovery-Unternehmen übertraf auch im 2. Quartal die Konsenserwartungen: Das Finanzergebnis und erhöht die Rentabilität. Viele Unternehmen melden zudem für die kommenden Quartale hohe Buchungsvolumen. Schliesslich bietet die Struktur der Wandelanleihen, die sich häufig durch eine attraktive versicherungsmathematische Rendite und eine hohe Aktiensensitivität auszeichnen, die Chance, an der Erholung der Aktienmärkte zu partizipieren und schützt in volatilen Perioden gleichzeitig vor Kursverlusten.

**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: 11179845  
Klasse III: 111735916

**Bloomberg**  
Klasse I: PRWCBC 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 30.06.2023**  
Klasse I: CHF 1'287.48  
Klasse II: CHF 1'288.25  
Klasse III: CHF 1'288.73

**Veraltetes Vermögen**  
CHF 83.7 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.

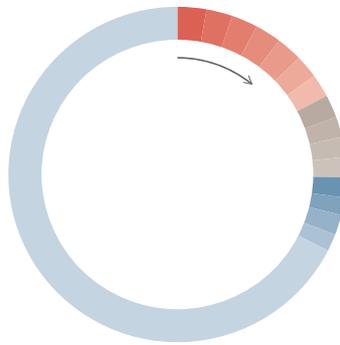
- 0.50% ab 0 bis 6 Monate  
- 0.25% ab 6 bis 12 Monate  
- 0% ab 12 Monaten

**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

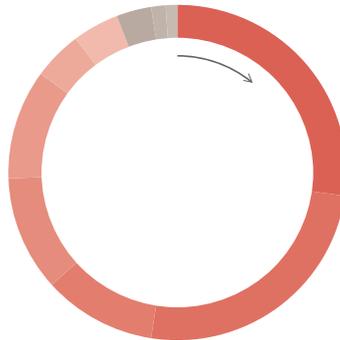
Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich geltenden Quellen stammen, übernimmt die Prisma Anlagestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

**Grösste Positionen**



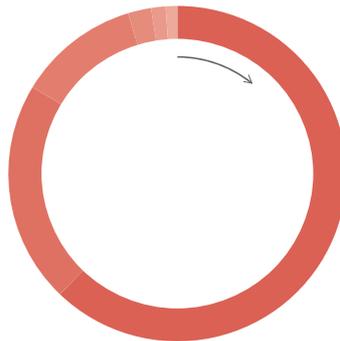
FORD MOTOR CO	2.8%
ON 0 1/2 03/01/29	2.5%
SOUTHWEST AIRLINES CO	2.5%
AIRBNB INC-CLASS A	2.4%
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2.4%
DEXCOM INC	2.4%
PANW 0 3/8 06/01/25	2.2%
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2.1%
LYV 3 1/8 01/15/29	2.1%
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1.9%
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1.9%
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	1.9%
SIKA AG-REG	1.9%
HUBSPOT INC	1.8%
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1.7%
Übrige	67.5%

**Aufteilung nach Sektoren**



Nicht-Basiskonsumgüter	27.2%
Technologie	25.4%
Gesundheitswesen	10.9%
Industrieunternehmen	10.9%
Telekommunikation	10.6%
Finanz-Dienstleistungen	4.9%
Versorger	4.4%
Grundstoffe	3.4%
Energie	1.2%
Cash	1.2%

**Geographische Aufteilung**



USA	62.3%
Europa	21.4%
Asien	11.6%
Japan	2.2%
Übrige	1.4%
Cash	1.2%

**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: PRWCBCB 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 30.06.2023**

Klasse I: CHF 1'287.48

Klasse II: CHF 1'288.25

Klasse III: CHF 1'288.73

**Verwaltetes Vermögen**

CHF 83.7 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%\*

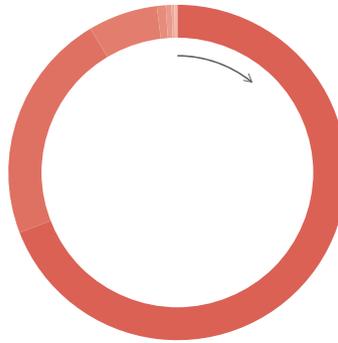
Klasse III: 0.59%

\*Wert beeinflusst durch

Vermögensbewegungen, die bei der Gründung der Klassen I und III am 01.04.2022 stattgefunden haben

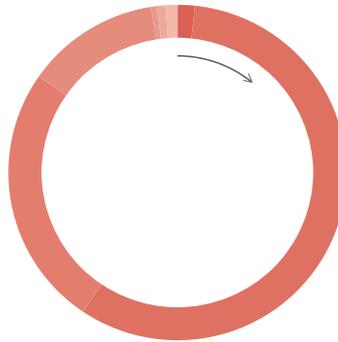
Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlichen geltenden Quellen stammen, übernimmt die Prisma Anlagestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

**Aufteilung nach Währungen**



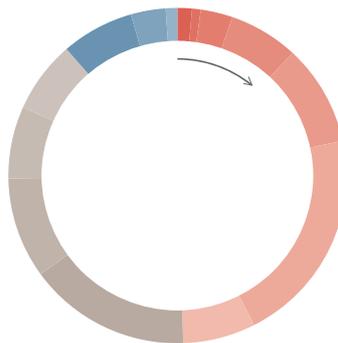
■ USD	69.1%
■ EUR	22.3%
■ JPY	6.7%
■ HKD	0.8%
■ SGD	0.5%
■ GBP	0.4%
■ CHF	0.2%

**Aufteilung nach Fälligkeit**



■ 0-1 years	1.7%
■ 1-3 years	57.7%
■ 3-5 years	25.5%
■ 5-10 years	12.8%
■ 10+ years	0.4%
■ Equity	0.9%
■ Cash	1.2%

**Aufteilung nach Ratings**



■ AA	1.3%
■ AA-	1.0%
■ A+	3.1%
■ A-	6.6%
■ BBB+	9.8%
■ BBB	20.7%
■ BBB-	7.0%
■ BB+	15.5%
■ BB	9.8%
■ BB-	6.8%
■ B+	6.9%
■ B	7.0%
■ B-	3.4%
■ Cash	1.2%

**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: PRWCBC SW

Klasse II: PRIOBCM SW

Klasse III: PRWCBC 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 30.06.2023**

Klasse I: CHF 1'287.48

Klasse II: CHF 1'288.25

Klasse III: CHF 1'288.73

**Veraltetes Vermögen**

CHF 83.7 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**

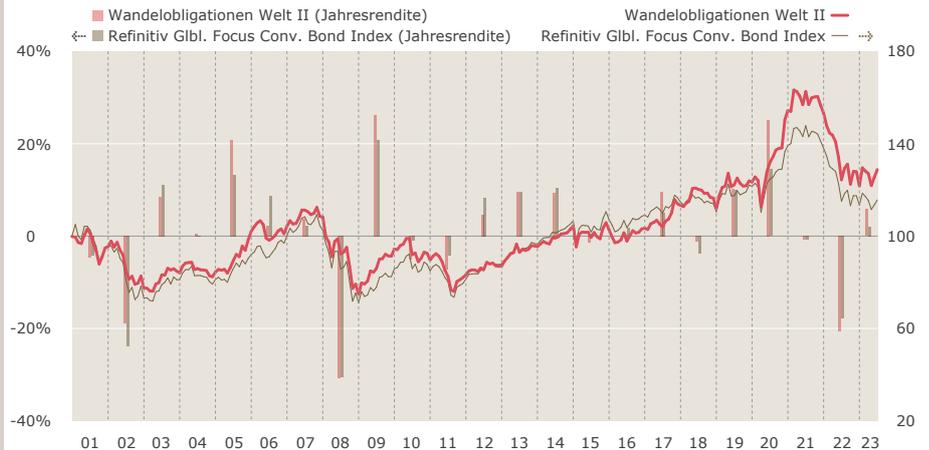
2016–2023

Jahresrendite [%]	Monatsrenditen [%]	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
1.77	0.61	-2.99	-2.61	0.28	0.96	3.14	-3.54	2.36	2.19	-0.98	0.28	1.46	0.32	2016
5.15	9.55	-0.59	2.41	0.59	0.86	-1.54	-1.08	2.30	0.86	2.53	5.18	-1.54	-0.61	2017
-3.71	-1.17	-0.46	1.55	1.16	4.08	0.19	-0.52	-0.23	-1.19	0.12	-1.54	-0.30	-3.84	2018
10.03	10.23	5.02	2.91	0.55	4.54	-4.58	0.68	2.38	-1.85	-0.94	0.08	1.76	-0.38	2019
14.47	25.07	1.77	-1.24	-9.08	7.17	5.89	3.08	1.76	2.21	0.51	0.17	8.85	2.63	2020
-0.80	-0.74	-0.22	6.00	-0.42	-1.19	-2.32	3.61	-3.48	1.89	0.24	0.08	-2.36	-2.17	2021
-17.86	-20.57	-3.51	-2.17	-0.68	-1.98	-4.72	-7.28	3.96	1.42	-6.62	4.56	-0.15	-4.82	2022
1.96	5.83	6.44	-1.08	-0.80	-4.13	2.98	2.63							2023

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Kumulierte Performance**

2001–2023, 26.01.2001=100



**Vergleichsanalyse**

(26.01.2001 – 30.06.2023)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Wandelobligationen Welt II	28.83%	0.14%	1.13%	8.85%	54.81%	-10.99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	15.63%	0.10%	0.65%	8.21%	57.04%	-10.38%

	2. Quartal 2023	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Wandelobligationen Welt II	1.33%	-33.45%	1.21	3.06%	10.59%	0.10
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.17%	-34.99%	1.33	3.06%	10.61%	0.06

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.95	0.90	0.0049	0.93	3.45%

\*Risikofreie Rendite: Libor 3M

## 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 30.06.2023**  
Klasse I: CHF 1'287.48  
Klasse II: CHF 1'288.25  
Klasse III: CHF 1'288.73

**Veraltetes Vermögen**  
CHF 83.7 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 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

Wandelobligationen Welt II vs. Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index  
Annualisierte Mehrrendite [%] | Monatliche Mehrrendite [%]

		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
	-2.35	-0.77	0.22	-0.28	-0.32	0.26	-0.65	0.57	0.16	-0.44	-0.09	0.46	-0.20	2016
	9.46	0.29	-0.01	-0.14	-0.06	-0.55	0.39	-0.33	1.38	1.39	1.44	-0.57	0.97	2017
	4.96	0.66	1.17	0.47	1.26	1.42	-0.80	0.50	0.10	-0.50	-0.85	-0.07	-0.69	2018
	0.45	0.28	0.62	0.69	0.89	-0.41	0.66	0.47	-0.33	-1.47	-0.52	-0.65	0.05	2019
	25.38	0.69	0.05	0.02	1.17	0.81	1.52	1.13	0.40	-0.37	0.13	2.94	0.75	2020
	0.12	-0.87	1.27	-0.64	-0.20	-0.64	0.31	-0.22	0.25	0.49	0.65	-0.22	-0.01	2021
	-4.39	-1.09	1.17	0.17	-1.17	-0.59	-1.02	1.04	0.21	-1.05	0.71	-0.06	-1.38	2022
	8.04	1.90	0.05	0.71	-0.73	1.17	0.79							2023

## Kennzahlen

1 Jahr

(30.06.2022 – 30.06.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	3.55%	14.02%		3.36%	2.84%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.48%	10.95%			

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.89			-7.20%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-6.96%	N/A

\*Risikofreie Rendite: Libor 3M

## Kennzahlen

5 Jahre

(30.06.2018 – 30.06.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	1.39%	12.29%	0.41	2.89%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-0.20%	10.30%	0.30		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.55	1.13	0.0136	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24.57%	N/A

\*Risikofreie Rendite: Libor 3M

## 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 30.06.2023

Klasse I: CHF 1'287.48

Klasse II: CHF 1'288.25

Klasse III: CHF 1'288.73

### Verwaltetes Vermögen

CHF 83.7 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 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.

## Kennzahlen

10 Jahre

(30.06.2013 - 30.06.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	3.32%	10.23%	0.52	2.49%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	2.13%	8.88%	0.45		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.46	1.09	0.0083	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24.57%	N/A

\*Risikofreie Rendite: Libor 3M