

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: PRWCBCW SW

Klasse II: PRIOBCM SW

Klasse III: PRWCBCI 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 Anlagengestiftung

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 Anlagengestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

Monatsrenditen

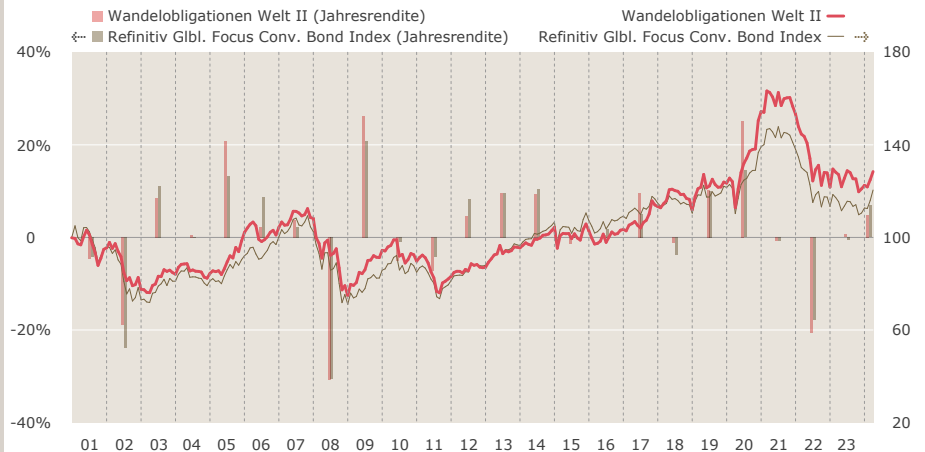
2017-2024

| Jahresrendite [%] | Monatsrenditen [%] | Monatsrenditen | | | | | | | | | | | | |
|-------------------|--------------------|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| | | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | |
| 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 |
| -0.62 | 0.64 | 6.44 | -1.08 | -0.80 | -4.13 | 2.98 | 2.63 | -0.60 | -2.11 | -0.03 | -4.46 | 1.08 | 1.24 | 2023 |
| 6.89 | 4.86 | -0.55 | 2.51 | 2.87 | | | | | | | | | | 2024 |

*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

Kumulierte Performance

2001-2024, 26.01.2001=100



Vergleichsanalyse

(26.01.2001 – 31.03.2024)

| | Kumulierte Performance | Arithm. Durchschnitt | Annualisierte Performance | Bester Monat | Positive Monate | Schlechtester Monat |
|-------------------------------|------------------------|----------------------|---------------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| Wandelobligationen Welt II | 28.46% | 0.14% | 1.08% | 8.85% | 54.48% | -10.99% |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 20.48% | 0.11% | 0.80% | 8.21% | 56.99% | -10.38% |

| | 1. Quartal 2024 | Max. Drawdown | Gewinn/Verlust Ratio | Standard-Abweichung | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* |
|-------------------------------|-----------------|---------------|----------------------|---------------------|---------------------------|--------------------|
| Wandelobligationen Welt II | 4.86% | -33.45% | 1.20 | 3.03% | 10.51% | 0.03 |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 6.89% | -34.99% | 1.33 | 3.04% | 10.53% | 0.00 |

| | Korrel.* | R2* | Ann. Jensen's Alpha* | Beta* | Ann. Tracking Error |
|-------------------------------|----------|------|----------------------|-------|---------------------|
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 0.95 | 0.90 | 0.0028 | 0.94 | 3.42% |

*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.

Mehrrenditen

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

| | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2017 | 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 |
| 2018 | 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 |
| 2019 | 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 |
| 2020 | 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 |
| 2021 | 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 |
| 2022 | -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 |
| 2023 | 2.52 | 1.90 | 0.05 | 0.71 | -0.73 | 1.17 | 0.79 | -0.43 | -0.37 | -0.65 | -0.65 | 0.37 | -0.70 |
| 2024 | -4.30 | -0.38 | -0.51 | -1.08 | | | | | | | | | |

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 II | 1.04% | 9.04% | 0.07 | 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 II | -1.39 | 1.06 | -0.0346 | -7.07% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -5.05% | 4 |

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

5 Jahre

(31.03.2019 – 31.03.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

| | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-------------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Wandelobligationen Welt II | 1.09% | 12.21% | 0.06 | 2.94% | - |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 0.38% | 10.36% | 0.00 | | |

| | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-------------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Wandelobligationen Welt II | 0.24 | 1.15 | 0.0070 | -26.69% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -25.74% | N/A |

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Kennzahlen

10 Jahre

(31.03.2014 - 31.03.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

| | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-------------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Wandelobligationen Welt II | 2.85% | 10.41% | 0.23 | 2.53% | - |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 1.94% | 9.09% | 0.17 | | |

| | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-------------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Wandelobligationen Welt II | 0.35 | 1.11 | 0.0071 | -26.69% | N/A |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | | | | -25.74% | N/A |

*Risikofreie Rendite: SNB Interest Rate Target Range 3 Months