

# PRISMA ESG Global Credit Allocation

## ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT, PARIS

Delegierte Verwaltung seit dem 08.05.2015

Diese aktiv verwaltete Anlagegruppe zeichnet sich durch ein dynamisches Management an allen Anleihenmärkten aus. Investiert wird in Unternehmensanleihen, Wandelanleihen, Staatsanleihen und Geldinstrumente. Empfohlen wird eine Mindestanlagedauer von drei Jahren. Die originelle Anlagestrategie basiert unter anderem auf quantitativen und makroökonomischen Indikatoren, die dafür sorgen, dass die Anlagen in Anleihekategorien mit guten Wachstums- und Renditeaussichten erfolgen. Indem er die risikoarmen und risikoreichen Titel entsprechend gewichtet, kann sich der Verwalter dem Zinsmarkt- und Kreditmarktzyklen flexibel anpassen.

## INDEXIERTE PERFORMANCE\*

PRISMA ESG Global Credit Allocation (08.05.2015=100, 05.07.2024=94.89)

— PRISMA ESG Global Credit Allocation  
— Customized Index Hedged



## MONATSRENDITE\*

| Jahresrendite [%]       | Monatsrendite [%] |       |       |       |       |       |       |      |       |       |       |       |       |      |
|-------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| Customized Index Hedged |                   | 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 |
| -1.73                   | -2.57             | -1.35 | -1.15 | 0.95  | -1.93 | 0.37  | 0.56  |      |       |       |       |       |       | 2024 |

## PERFORMANCE ZUM 5. JULI 2024\*

|   | 2021   | 2022    | 2023  | 2024   | Seit dem 08.05.15 | Ann. Vol. |
|---|--------|---------|-------|--------|-------------------|-----------|
| PRISMA ESG Global Credit Allocation           | 0.11%  | -15.35% | 4.48% | -2.31% | -5.11%            | 5.33%     |
| Barclays Global Aggregate Corporate TR Hedged | -0.95% | -16.72% | 4.24% | -1.08% | -3.74%            | 4.43%     |

\*Die Performances beziehen sich auf die Klasse II.

## MERKMALE

### BVV 2-Klassifizierung

Obligationen

### 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: 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 05.07.2024

Klasse I: CHF 947.79

Klasse II: CHF 948.90

Klasse III: CHF 949.51

### Veraltetes Vermögen

CHF 58.5 Mio.

### Liquidität

Wöchentlich

### Zeichnungstermin

Donnerstag 17.00 Uhr

### Rückgabetermin

Donnerstag 17.00 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 31.03.2023

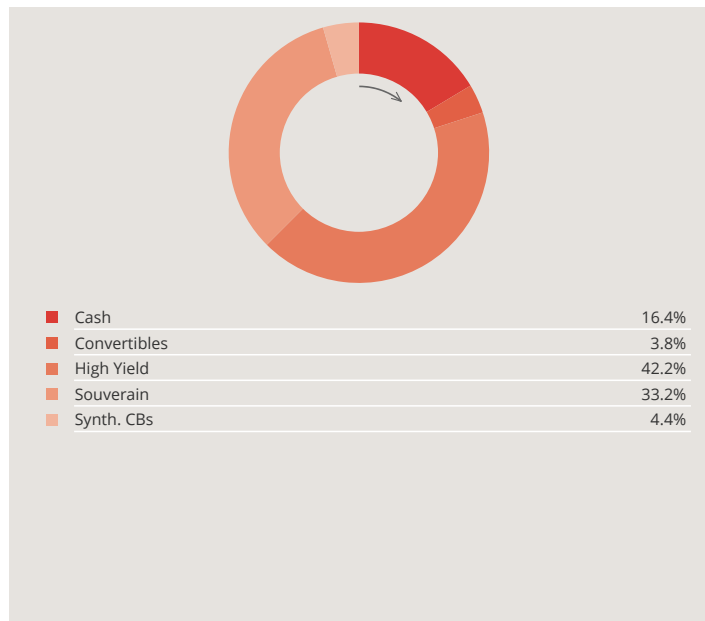
Klasse I: 1.04%

Klasse II: 0.94%\*

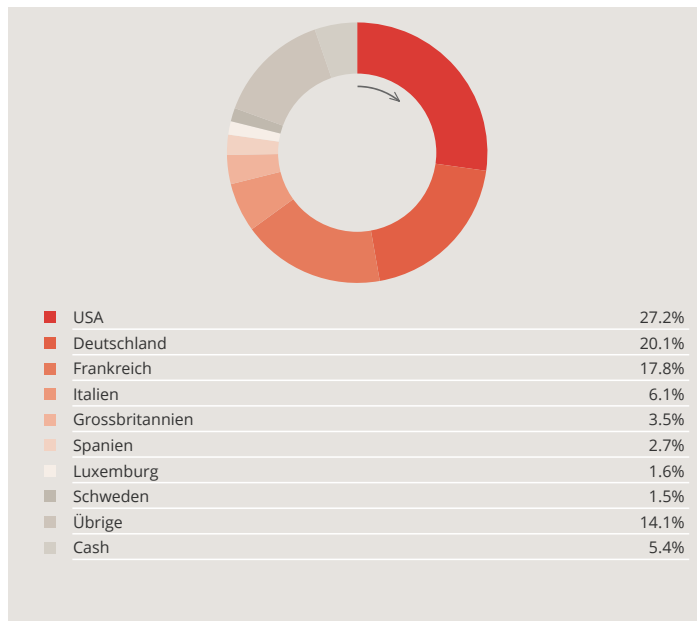
Klasse III: 0.96%

\*Wert beeinflusst durch Vermögensbewegungen, die bei der Gründung der Klassen I und III am 01.04.2022 stattgefunden haben

## AUFTEILUNG NACH ANLAGEKLASSEN



## GEOGRAPHISCHE AUFTEILUNG



## KERNELEMENTE

- [+] Allokation in globalen Anleihsensegmenten;
- [+] Flexibles Portfoliomanagement, basierend auf der Top-Down-Vision von Ellipsis AM und einem quantitativen Ansatz;
- [+] Zugang zum spezialisierten Management von Ellipsis-AM.

## SFDR- KLASSIFIKATION

Die SFDR-Klassifizierung der Anlagegruppe lautet auf „Artikel 8“.

## DIE ANLAGESTIFTUNG PRISMA VON VORSORGEFACHLEUTEN FÜR VORSORGEFACHLEUTE

**PRISMA** ist eine gemeinnützige Anlagestiftung, die im Jahr 2000 von Vorsorgeeinrichtungen der 2. Säule gegründet wurde. Heute ist PRISMA eine der wenigen nationalen Institutionen, die direkt von Fachleuten Schweizer Pensionskassen geführt wird. Die Anlagestiftung verfügt über eine grosse Anzahl von Mitglieder-Investoren, denen sie die Verwaltung einer diversifizierten und innovativen Palette von Anlageprodukten mit grösstmöglicher Transparenz anbietet. Die offene Architektur von PRISMA ermöglicht spezialisierte Managementansätze und -techniken mit einem attraktiven Risiko-Ertrags-Verhältnis, die den spezifischen Bedürfnissen von Pensionskassen entsprechen.

*Mit dem festen Willen, nicht einfach nur Bestehendes zu reproduzieren, sondern eigene Wege zu gehen, schlägt PRISMA spezifische und innovative Anlagelösungen vor.*

## ANLAGEGRUPPEN

### Aktien

PRISMA ESG SPI® Efficient  
PRISMA Global Residential Real Estate  
PRISMA ESG Sustainable SOCIETY  
PRISMA ESG China Equities  
PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities

### Obligationen

PRISMA ESG World Convertible Bonds  
PRISMA ESG Global Credit Allocation  
PRISMA ESG CHF Bonds

### Infrastruktur

PRISMA ESG Global Infrastructure

### Alternative Anlagen

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1  
PRISMA Alternative Multi-Manager  
PRISMA SHARP

### Immobilien

PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate  
PRISMA Redbrix Real Estate

**PRISMA Anlagestiftung** - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tel. 0848 106 106 - info@prismaanlagestiftung.ch - www.prismaanlagestiftung.ch

Dieses Dokument dient einzig zu Informationszwecken und stellt keine Anlageberatung für Finanzprodukte dar. Aufgrund ihrer Vereinfachung sind die in diesem Dokument enthaltenen Informationen nur teilweise zutreffend. Sie können subjektiv sein und können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Alle diese Angaben wurden in gutem Glauben auf den Grundlagen von Marktinformationen erstellt. Für die aus externen Informationsquellen stammenden Elemente, kann die Richtigkeit nicht garantiert werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die Zukünftige. Die PRISMA Anlagestiftung haftet nicht für Entscheidungen, die auf der Grundlage dieser Informationen getroffen werden. Anlegern, die eine Investition in dieses Produkt erwägen, wird empfohlen, ihre Entscheidung nicht allein auf die in diesem Dokument enthaltenen Elemente zu stützen. Alle Dokumente, die rechtliche Grundlagen für eine eventuelle Anlage bilden, können kostenlos bei der PRISMA Anlagestiftung angefordert werden.