

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 Anlagengestiftung

Emissionspreis

CHF 1'000

NIW am 31.03.2023

Klasse I: CHF 1'270.76

Klasse II: CHF 1'271.39

Klasse III: CHF 1'271.78

Veraltetes Vermögen

CHF 82.4 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 31.03.2022

Klasse I: 0.66%*

Klasse II: 0.61%

Klasse III: 0.58%*

*ex ante (ungeprüft, neue Klasse eingeführt am 01.04.2022)

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

Quartalsbericht des Verwalters

Das Quartal war von äusserst volatilen Zinssätzen und einem allgemein aktienfreundlichen Umfeld, insbesondere in Wachstumssektoren, geprägt. Im Zuge der sich stabilisierenden Zinssätze erholten sich die globalen Aktienmärkte im Januar. Die Hoffnung auf ein schnelles Ende des Zinserhöhungszyklus wurde im Februar angesichts der anhaltenden Inflation und solider makroökonomischer Indikatoren zunichte gemacht. Stattdessen schlugen die Zentralbanken einen schärferen Ton an. Im März, als die Auswirkungen des Zinserhöhungszyklus in den USA und in Europa eine Bankenkrise auslösten, wurden die Zentralbanken wieder akkommodierender. In diesem volatilen Umfeld hielten sich die Wandelanleihen gut: Die Dominanz von Wachstumsunternehmen, kürzere Laufzeiten und konvexe Strukturen erwiesen sich für die Anlageklasse als Vorteil.

Im 1. Quartal 2023 gewann die Anlagegruppe 4.44%. Die Benchmark Thomson Reuters Global Focus Convertible Bond Index legte in CHF 1.79% zu. Die Aktien bleiben im Portfolio übergewichtet. Sie machen 54.00% aus, gegenüber 51.90% im Index. Die Zinssensitivität wurde im Quartalsverlauf erhöht und liegt nun bei 1.76 gegenüber 1.68 im Index.

Wir haben das Engagement in Biotechnologie und Solarenergie ausgebaut und Gewinne aus dem US-amerikanischen Software-Sektor mitgenommen. Ausserdem haben wir durch die Aufstockung konvexerer Wandelanleihestrukturen in den Sektoren Events, Halbleiter, Gesundheit und Onlinehandel die Konvexität erhöht. In Europa haben wir das Engagement in Grundstoffe zurückgefahren und dasjenige in Online-Lieferdienste verstärkt.

Im Quartalsverlauf war die Titelauswahl für den Grossteil der Outperformance verantwortlich. Unsere Papiere aus den Bereichen Software, Cybersicherheit, Biotechnologie und Halbleiter in den USA generierten dank der sich stabilisierenden Zinserhöhungen und solider Quartalsergebnisse ein Plus. Recovery-Unternehmen, insbesondere Kreuzfahrtgesellschaften in den USA und die Tourismusbranche in Europa, notierten ebenfalls mit positivem Vorzeichen. Auch in Asien machte sich die Titelauswahl bezahlt. Dort sorgten die Papiere in Nicht-Basis-Konsumgütern und Technologieausrüstung für Gewinne. Unsere Energietitel in den USA und die Untergewichtung von Grundstoffen in Asien setzten dem Ergebnis zu.

Da die Anlagegruppe weder in amerikanischen Regionalbanken noch in der Credit Suisse Positionen hält und insgesamt nur moderat im Finanzsektor engagiert ist, entkam sie der Volatilität, die gegen Ende des Berichtszeitraums das Bankenwesen erschütterte.

Jetzt, da sich der Zinserhöhungszyklus stabilisiert hat, ist davon auszugehen, dass die zinssensitiven Wachstumssektoren in den kommenden Quartalen nach den Abschlüssen in den Jahren 2021 und 2022 weiter an Fahrt gewinnen. Viele dieser Unternehmen dürften solide Ergebnisse vorlegen und weniger anfällig für eine allfällige Abschwächung der Weltwirtschaft sein. Dadurch werden sie für Anleger attraktiver. Die Quartalsergebnisse der meisten Recovery-Unternehmen übertrafen die Konsensschätzungen. Vermutlich wird die Rückkehr zur vollen Kapazität in ihren Resultaten mehr Gewicht haben als die Rezessionsgefahr. Diese Unternehmen sind im Übrigen gut positioniert, um von der Wiedereröffnung Chinas zu profitieren, das die Ausgaben für Nicht-Basiskonsumgüter erhöhen könnte. Schliesslich sind die Strukturen von Wandelanleihen noch immer sehr konvex: Mehr als 50% der Wandelanleihen von Wachstumsunternehmen weisen eine versicherungsmathematische Rendite von über 5% auf. Diese Wandelanleihen bieten auch ein gewisses Aktienengagement, was im Falle einer Erholung der zugrundeliegenden Aktie für zusätzliche Rendite sorgt.

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 31.03.2023
Klasse I: CHF 1'270.76
Klasse II: CHF 1'271.39
Klasse III: CHF 1'271.78

Verwaltetes Vermögen
CHF 82.4 Mio.

Liquidität
Wöchentlich

Zeichnungstermin
Donnerstag 17.00 Uhr

Rückgabetermin
Montag 17.00 Uhr

Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+3 (Mittwoch)

Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+4 (Donnerstag)

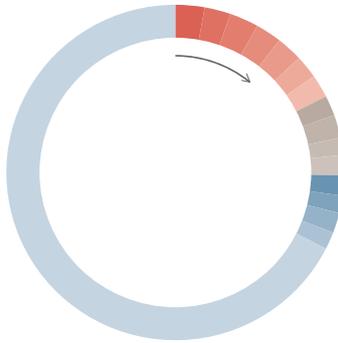
Zeichnungsgebühren
Keine Zeichnungsgebühren

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 31.03.2022
Klasse I: 0.66%*
Klasse II: 0.61%
Klasse III: 0.58%*
*ex ante (ungeprüft, neue Klasse eingeführt am 01.04.2022)

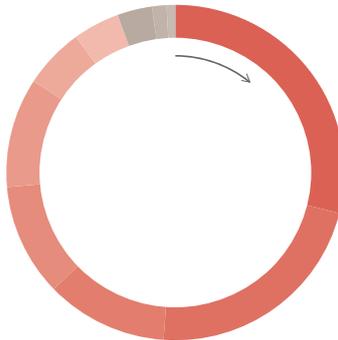
Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich geltenden Quellen stammen, übernimmt die Prisma Anlagestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

Grösste Positionen



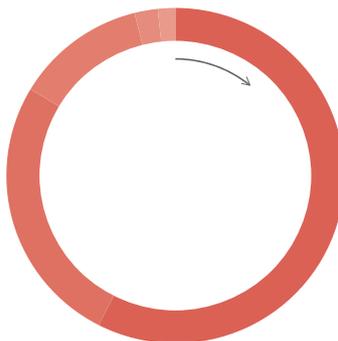
FORD MOTOR CO	2.7%
SIKA AG-REG	2.7%
AIRBNB INC-CLASS A	2.6%
SOUTHWEST AIRLINES CO	2.5%
DEXCOM INC	2.5%
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2.3%
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2.1%
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2.1%
MEITUAN-CLASS B	2.0%
LYV 3 1/8 01/15/29	1.9%
H WORLD GROUP LTD-ADR	1.9%
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	1.8%
PALO ALTO NETWORKS INC	1.8%
NEXTERA ENERGY PARTNERS LP	1.8%
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1.7%
Übrige	67.5%

Aufteilung nach Sektoren



Nicht-Basiskonsumgüter	28.8%
Technologie	22.4%
Gesundheitswesen	11.4%
Industrieunternehmen	10.9%
Telekommunikation	10.7%
Finanz-Dienstleistungen	5.6%
Grundstoffe	4.4%
Versorger	3.5%
Energie	1.3%
Basiskonsumgüter	0.9%

Geographische Aufteilung



USA	57.4%
Europa	26.3%
Asien	12.2%
Japan	2.4%
Übrige	1.6%

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 Anlagengestiftung

Emissionspreis
CHF 1'000

NIW am 31.03.2023
Klasse I: CHF 1'270.76
Klasse II: CHF 1'271.39
Klasse III: CHF 1'271.78

Verwaltetes Vermögen
CHF 82.4 Mio.

Liquidität
Wöchentlich

Zeichnungstermin
Donnerstag 17.00 Uhr

Rückgabetermin
Montag 17.00 Uhr

Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+3 (Mittwoch)

Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+4 (Donnerstag)

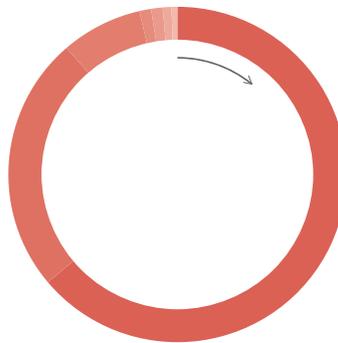
Zeichnungsgebühren
Keine Zeichnungsgebühren

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 31.03.2022
Klasse I: 0.66%*
Klasse II: 0.61%
Klasse III: 0.58%*
*ex ante (ungeprüft, neue Klasse eingeführt am 01.04.2022)

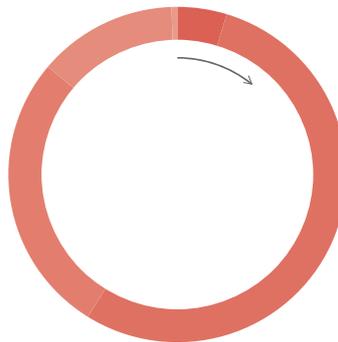
Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich geltenden Quellen stammen, übernimmt die Prisma Anlagengestiftung keine Garantie für deren Verlässlichkeit, Exaktheit und Vollständigkeit. Die vergangenen Performances sind keine Garantie für künftige Resultate.

Aufteilung nach Währungen



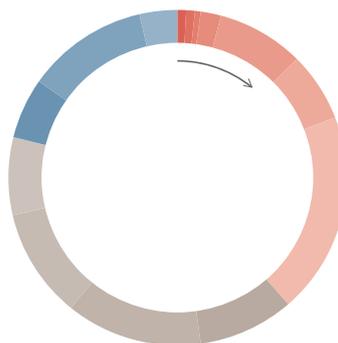
■ USD	64.0%
■ EUR	24.7%
■ JPY	7.8%
■ HKD	1.1%
■ GBP	1.1%
■ CHF	0.9%
■ SGD	0.5%

Aufteilung nach Fälligkeit



■ 0-1 years	4.9%
■ 1-3 years	54.0%
■ 3-5 years	27.4%
■ 5-10 years	13.3%
■ 10+ years	0.4%
■ Übrige	0.0%

Aufteilung nach Ratings



■ AA	0.8%
■ AA-	1.0%
■ A+	0.5%
■ A	1.8%
■ A-	8.6%
■ BBB+	6.7%
■ BBB	19.4%
■ BBB-	9.1%
■ BB+	13.1%
■ BB	10.5%
■ BB-	7.5%
■ B+	5.8%
■ B	11.8%
■ B-	3.5%
■ Cash	0.1%

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 Anlagengestiftung

Emissionspreis

CHF 1'000

NIW am 31.03.2023

Klasse I: CHF 1'270.76

Klasse II: CHF 1'271.39

Klasse III: CHF 1'271.78

Verwaltetes Vermögen

CHF 82.4 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 31.03.2022

Klasse I: 0.66%*

Klasse II: 0.61%

Klasse III: 0.58%*

*ex ante (ungeprüft, neue Klasse

eingeführt am 01.04.2022)

Bemerkung: Obschon die Daten aus verlässlich 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

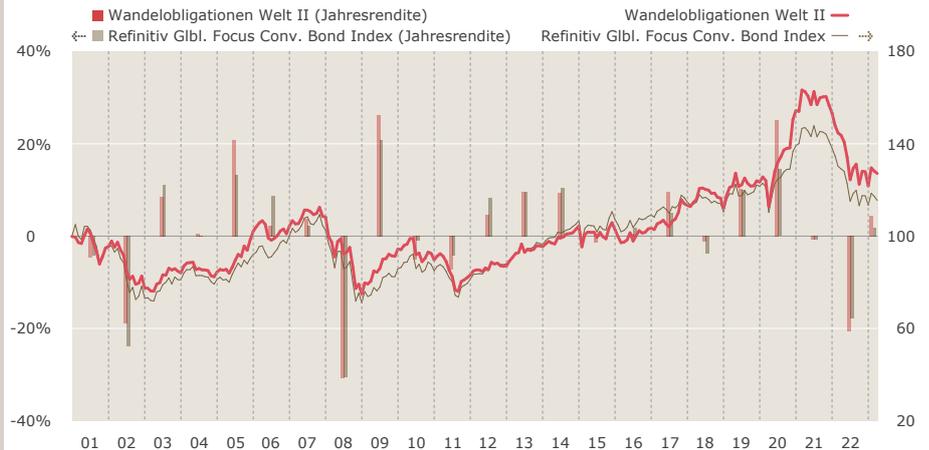
2016–2023

Jahresrendite [%]	Monatsrenditen [%]	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
1.79	4.44	6.44	-1.08	-0.80										2023

*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

Kumulierte Performance

2001–2023, 26.01.2001=100



Vergleichsanalyse

(26.01.2001 – 31.03.2023)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Wandelobligationen Welt II	27.14%	0.14%	1.08%	8.85%	54.68%	-10.99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	15.44%	0.10%	0.65%	8.21%	56.93%	-10.38%

	1. Quartal 2023	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Wandelobligationen Welt II	4.44%	-33.45%	1.21	3.06%	10.58%	0.10
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	1.79%	-34.99%	1.32	3.07%	10.63%	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 Anlagengründung

Emissionspreis

CHF 1'000

NIW am 31.03.2023

Klasse I: CHF 1'270.76

Klasse II: CHF 1'271.39

Klasse III: CHF 1'271.78

Verwaltetes Vermögen

CHF 82.4 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 31.03.2022

Klasse I: 0.66%*

Klasse II: 0.61%

Klasse III: 0.58%*

*ex ante (ungeprüft, neue Klasse

eingeführt am 01.04.2022)

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

Mehrenditen

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		
2016	-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
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	2017
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	2018
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	2019
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	2020
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	2021
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	2022
2023	5.47	1.90	0.05	0.71										2023

Kennzahlen

1 Jahr

(31.03.2022 – 31.03.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	-11.52%	15.42%		3.55%	2.35%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-10.58%	12.34%			

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	-0.30			-15.28%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-12.33%	N/A

*Risikofreie Rendite: Libor 3M

Kennzahlen

5 Jahre

(31.03.2018 – 31.03.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	1.87%	12.15%	0.47	2.94%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.13%	10.22%	0.33		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.59	1.13	0.0167	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-23.44%	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 31.03.2023

Klasse I: CHF 1'270.76

Klasse II: CHF 1'271.39

Klasse III: CHF 1'271.78

Veraltetes Vermögen

CHF 82.4 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 31.03.2022

Klasse I: 0.66%*

Klasse II: 0.61%

Klasse III: 0.58%*

*ex ante (ungeprüft, neue Klasse eingeführt am 01.04.2022)

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

(31.03.2013 - 31.03.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	3.24%	10.22%	0.51	2.45%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	2.21%	8.92%	0.44		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.41	1.09	0.0076	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-23.44%	N/A

*Risikofreie Rendite: Libor 3M