

**MERKMALE**

**BVV 2-Klassifizierung**  
Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**  
Lazard Asset Management LLC, New York

**Depotbank**  
UBS Switzerland AG, Zürich

**Administrator**  
UBS Switzerland AG, 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 31.12.2024**  
Klasse I: CHF 1'342.42  
Klasse II: CHF 1'344.26  
Klasse III: CHF 1'345.38

**Veraltetes Vermögen**  
CHF 90.1 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 31.03.2024**  
Klasse I: 0.65%  
Klasse II: 0.60%  
Klasse III: 0.57%

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.

**Monatsrenditen**

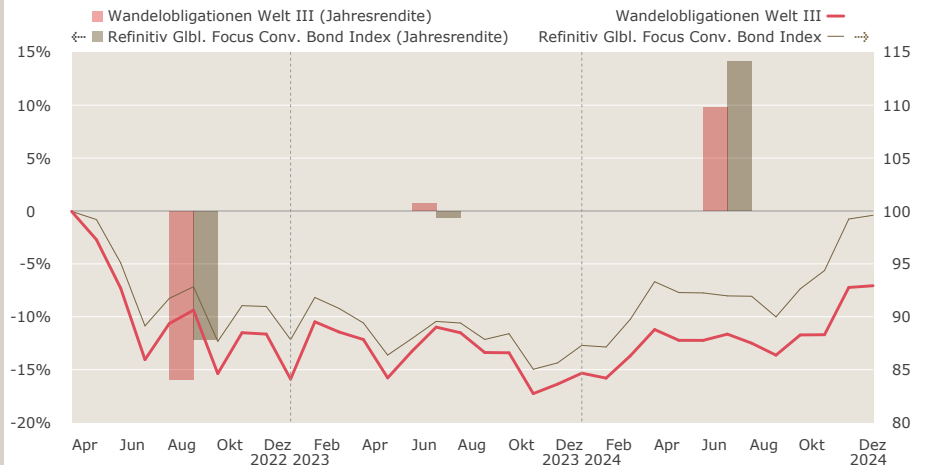
2022-2024

| Jahresrendite [%] | Monatsrenditen [%] | Jan   | Feb   | Mär   | Apr   | Mai   | Jun   | Jul   | Aug   | Sep   | Okt   | Nov   | Dez   |
|-------------------|--------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| -12.16            | -15.89             |       |       |       | -2.71 | -4.72 | -7.28 | 3.96  | 1.42  | -6.62 | 4.57  | -0.15 | -4.81 |
| -0.62             | 0.67               | 6.44  | -1.08 | -0.80 | -4.13 | 2.98  | 2.63  | -0.60 | -2.11 | -0.03 | -4.46 | 1.08  | 1.24  |
| 14.09             | 9.76               | -0.55 | 2.51  | 2.87  | -1.15 | -0.00 | 0.67  | -0.97 | -1.29 | 2.21  | 0.03  | 5.06  | 0.18  |

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Kumulierte Performance**

2022-2024, 01.04.2022=100



**Vergleichsanalyse**

(01.04.2022 – 31.12.2024)

|                               | Kumulierte Performance | Arithm. Durchschnitt | Annualisierte Performance | Bester Monat | Positive Monate | Schlechtester Monat |
|-------------------------------|------------------------|----------------------|---------------------------|--------------|-----------------|---------------------|
| Wandelobligationen Welt III   | -7.07%                 | -0.17%               | -2.63%                    | 6.44%        | 45.45%          | -7.28%              |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | -0.41%                 | 0.03%                | -0.15%                    | 5.16%        | 45.45%          | -6.26%              |

|                               | 4. Quartal 2024 | Max. Drawdown | Gewinn/Verlust Ratio | Standard-Abweichung | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* |
|-------------------------------|-----------------|---------------|----------------------|---------------------|---------------------------|--------------------|
| Wandelobligationen Welt III   | 5.27%           | -17.26%       | 0.83                 | 3.26%               | 11.30%                    | -0.27              |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 7.50%           | -14.96%       | 0.83                 | 2.84%               | 9.85%                     | -0.05              |

|                               | Korrel.* | R2*  | Ann. Jensen's Alpha* | Beta* | Ann. Tracking Error |
|-------------------------------|----------|------|----------------------|-------|---------------------|
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 0.97     | 0.94 | -0.0246              | 1.11  | 3.04%               |

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

**MERKMALE**

**BVV 2-Klassifizierung**  
Obligationen

**Delegierte Verwaltung / Manager**  
Lazard Asset Management LLC, New York

**Depotbank**  
UBS Switzerland AG, Zürich

**Administrator**  
UBS Switzerland AG, 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 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 31.12.2024**  
Klasse I: CHF 1'342.42  
Klasse II: CHF 1'344.26  
Klasse III: CHF 1'345.38

**Verwaltetes Vermögen**  
CHF 90.1 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 31.03.2024**  
Klasse I: 0.65%  
Klasse II: 0.60%  
Klasse III: 0.57%

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 Monatl. 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 | -9.68 | -0.38 | -0.50 | -1.08 | -0.05 | 0.03  | 0.98 | -0.93 | 0.83  | -0.73 | -1.84 | -0.11 | -0.18 | 2024 |

**Kennzahlen**

1 Jahr

(31.12.2023 – 31.12.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

|                               | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-------------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Wandelobligationen Welt III   | 9.76%                     | 6.78%                     | 1.34               | 2.69%               | 2.31%                       |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | 14.09%                    | 7.69%                     | 1.69               |                     |                             |

|                               | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-------------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Wandelobligationen Welt III   | -1.43            | 0.83  | -0.0162              | -2.73%        | 3               |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo |                  |       |                      | -3.56%        | 2               |

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

**Kennzahlen**

Seit der Lancierung

(01.04.2022 – 31.12.2024, Berechnungsbasis: monatlich)

|                               | Annualisierte Performance | Annualisierte Volatilität | Ann. Sharpe-Ratio* | Ann. Tracking Error | Ann. Tracking Error ex ante |
|-------------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------------|
| Wandelobligationen Welt III   | -2.63%                    | 11.30%                    | -0.27              | 3.04%               | -                           |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo | -0.15%                    | 9.85%                     | -0.05              |                     |                             |

|                               | Ann. Info.-ratio | Beta* | Ann. Jensen's Alpha* | Max. Drawdown | Recovery Period |
|-------------------------------|------------------|-------|----------------------|---------------|-----------------|
| Wandelobligationen Welt III   | -0.83            | 1.11  | -0.0246              | -17.26%       | N/A             |
| Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo |                  |       |                      | -14.96%       | N/A             |

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