

**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: 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 29.09.2023**

Klasse I: CHF 1'252.11

Klasse II: CHF 1'253.04

Klasse III: CHF 1'253.61

**Veraltetes Vermögen**

CHF 81.8 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.

**Monatsrenditen**

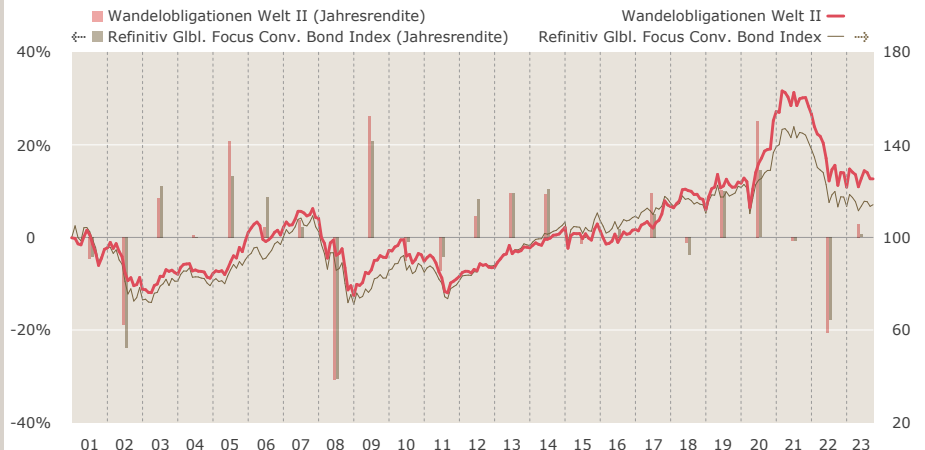
2016–2023

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
0.64	2.94	6.44	-1.08	-0.80	-4.13	2.98	2.63	-0.60	-2.11	-0.03				2023

\*Refinitiv Global Focus Convertible Bond Index.

**Kumulierte Performance**

2001–2023, 26.01.2001=100



**Vergleichsanalyse**

(26.01.2001 – 30.09.2023)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
Wandelobligationen Welt II	25.30%	0.13%	1.00%	8.85%	54.21%	-10.99%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	14.13%	0.10%	0.58%	8.21%	56.78%	-10.38%

	3. Quartal 2023	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
Wandelobligationen Welt II	-2.73%	-33.45%	1.18	3.04%	10.55%	0.02
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-1.30%	-34.99%	1.31	3.05%	10.56%	-0.02

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.95	0.90	0.0040	0.95	3.44%

\*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 29.09.2023**  
Klasse I: CHF 1'252.11  
Klasse II: CHF 1'253.04  
Klasse III: CHF 1'253.61

**Veraltetes Vermögen**  
CHF 81.8 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 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
	4.68	1.90	0.05	0.71	-0.73	1.17	0.79	-0.43	-0.37	-0.65				2023

**Kennzahlen**

1 Jahr

(30.09.2022 – 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	2.29%	11.65%	0.16	3.20%	2.74%
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	0.83%	8.89%	0.05		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.45	1.29	0.0131	-5.93%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-5.93%	N/A

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

**Kennzahlen**

5 Jahre

(30.09.2018 – 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	1.10%	12.32%	0.06	2.91%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	-0.18%	10.31%	-0.05		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.44	1.17	0.0136	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24.57%	N/A

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

## Kennzahlen

10 Jahre

(30.09.2013 - 30.09.2023, Berechnungsbasis: monatlich)

	Annualisierte Performance	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*	Ann. Tracking Error	Ann. Tracking Error ex ante
Wandelobligationen Welt II	2.89%	10.26%	0.24	2.50%	-
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo	1.82%	8.90%	0.16		

	Ann. Info.-ratio	Beta*	Ann. Jensen's Alpha*	Max. Drawdown	Recovery Period
Wandelobligationen Welt II	0.42	1.12	0.0087	-25.46%	N/A
Refinitiv Gbl. Focus Conv. Bo				-24.57%	N/A

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