



1

PRISMA ESG SPI® Efficient II
CH0113397662

NIW: CHF 2'739.10

Delegierte	OLZ AG, Bern
Verwaltung	
Depotbank	Credit Suisse, Zürich
Administrator	Credit Suisse, Zürich
Vertrieb	Key Investment Services (KIS) AG, Morges
Kontrollstelle	Ernst & Young, Lausanne
Valoren-Nummer / Bloomberg	113 39 766 / PRSPIEF SW
Rechnungswährung	Schweizer Franken (CHF)
Lancierungsdatum	20. Dezember 2010
Benchmark	SPI® TR
Abschluss Rechnungsjahr	31 März
Publikation der Kurse Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und www.prismaanlagestiftung.ch	
NIW-Berechnung	Wöchentlich
Ausgabepreis	CHF 1'000.-
Gebühren Keine Ausgabegebühren. Degressive, nach Anlagedauer berechnete Rücknahmegebühr.	
TER KGAST	0.60%
Prisma Anlagestiftung Rue du Sablon 2 CH-1110 Morges Tel.: 0848 106 106 www.prismaanlagestiftung.ch info@prismaanlagestiftung.ch	

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.

01

Monatsrenditen

2015-2022

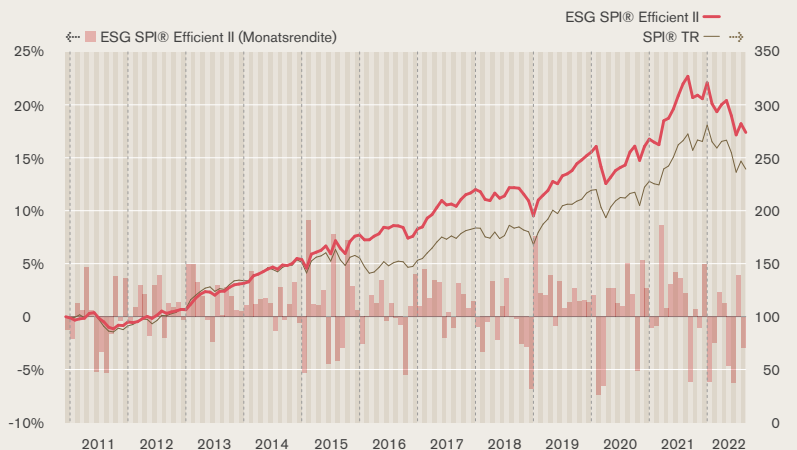
Jahresrendite [%]	SPI® TR	Monatsrenditen [%]												
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2.68	15.03	-5.36	9.12	1.13	1.12	2.52	-4.42	7.76	-4.21	-2.97	7.20	2.88	0.64	2015
-1.41	3.27	-2.60	0.02	1.98	1.26	3.48	-0.40	1.27	-0.15	-0.80	-5.47	0.99	4.02	2016
19.92	20.30	0.97	4.51	1.73	3.43	3.22	-1.99	0.42	-1.03	3.19	2.12	0.76	1.49	2017
-8.57	-11.30	-0.94	-3.36	-0.50	3.38	-2.22	1.02	3.64	-0.01	-0.22	-2.58	-2.87	-6.79	2018
30.59	30.90	7.62	2.23	2.03	3.90	-0.92	3.32	0.78	1.33	2.72	1.45	1.60	1.42	2019
3.82	4.77	2.07	-7.39	-6.56	2.65	2.71	1.23	0.95	5.06	2.17	-5.16	5.31	2.69	2020
23.38	19.87	-1.10	-0.90	8.65	0.83	3.04	4.20	3.68	2.21	-6.17	0.76	-1.09	4.93	2021
-14.84	-14.61	-6.18	-2.50	2.35	1.23	-4.69	-6.28	3.90	-2.93					2022



02

Kumulierte Performance

2010-2022, 20.12.2010=100



03

Vergleichsanalyse

(20.12.2010 – 31.08.2022)

	Kumulierte Performance	Arithm. Durchschnitt	Annualisierte Performance	Bester Monat	Positive Monate	Schlechtester Monat
ESG SPI® Efficient II	173.91%	0.77%	8.95%	9.12%	65.25%	-7.39%
SPI® TR	139.26%	0.68%	7.71%	8.41%	62.41%	-7.56%

	Max. Drawdown	Gewinn/Verlust Ratio	Standard-Abweichung	Annualisierte Volatilität	Ann. Sharpe-Ratio*
ESG SPI® Efficient II	-16.93%	1.88	3.18%	11.02%	0.75
SPI® TR	-16.88%	1.66	3.38%	11.72%	0.60

	Korrel.*	R2*	Ann. Jensen's Alpha*	Beta*	Ann. Tracking Error
SPI® TR	0.92	0.85	0.0210	0.86	4.55%

*Risikofreie Rendite: Libor 3M

