

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Actions

Gestion déléguée / gérant

OLZ AG, Berne

Banque dépositaire

Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich

Administrateur

Credit Suisse Funds SA, Zurich

Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur

Ernst & Young SA, Lausanne

Numéro de valeur

Classe I: 117069258

Classe II: 11339766

Classe III: 117093777

Ticker Bloomberg

Classe I: PRESEIC SW

Classe II: PRSPIEF SW

Classe III: PRESEII SW

Code ISIN

Classe I: CH1170692581

Classe II: CH0113397662

Classe III: CH1170937770

Devise de référence

Franc suisse (CHF)

Date de lancement

20 décembre 2010

Date de fin d'exercice

31 mars

Benchmark officiel

Swiss Performance Index SPI®

Publication des cours

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission

CHF 1'000

VNI au 30.09.2024

Classe I: CHF 3'220,41

Classe II: CHF 3'224,60

Classe III: CHF 3'226,86

Fortune sous gestion

CHF 150,2 mio

Liquidité

hebdomadaire

Délai de souscription

vendredi 10h00

Délai de rachat de parts

vendredi 10h00

Date de règlement / souscription

T+2 (mardi)

Date de règlement / rachat de parts

T+2 (mardi)

Frais de souscription

aucun frais de souscription

Frais de rachat

les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts:
- 0,50% de 0 à 6 mois
- 0,25% de 6 à 12 mois
- 0% dès 12 mois

TER KGAST au 31.03.2024

Classe I: 0,64%

Classe II: 0,59%

Classe III: 0,56%

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

Performances mensuelles

2022-2024

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]													
	SPI® TR	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov		Déc
-11,61	-10,70				0,91	-4,70	-6,28	3,90	-2,92	-5,81	3,83	2,56	-2,06	2022
6,09	7,49	4,11	-0,03	1,88	3,13	-2,73	0,16	0,94	-1,20	-1,64	-2,80	3,66	2,08	2023
11,47	11,57	1,18	0,56	2,69	-1,70	4,95	-0,07	3,66	0,76	-0,84				2024

Performance cumulée

2022-2024, 01.04.2022=100



Analyse comparative

(01.04.2022 – 30.09.2024)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG SPI® Efficient III	7,09%	0,27%	2,78%	4,95%	56,67%	-6,28%
SPI® TR	4,53%	0,21%	1,79%	6,14%	56,67%	-7,27%

	3e trim. 2024	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG SPI® Efficient III	3,58%	-15,15%	1,31	3,01%	10,42%	0,23
SPI® TR	2,03%	-15,62%	1,31	3,54%	12,26%	0,11

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
SPI® TR	0,98	0,96	0,0120	0,83	2,98%

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2

Actions

Gestion déléguée / gérant

OLZ AG, Berne

Banque dépositaire

Credit Suisse (Suisse) SA, Zurich

Administrateur

Credit Suisse Funds SA, Zurich

Distribution

Key Investment Services (KIS) SA, Morges

Auditeur

Ernst & Young SA, Lausanne

Numéro de valeur

Classe I: 117069258

Classe II: 11339766

Classe III: 117093777

Ticker Bloomberg

Classe I: PRESEIC SW

Classe II: PRSPIEF SW

Classe III: PRESEII SW

Code ISIN

Classe I: CH1170692581

Classe II: CH0113397662

Classe III: CH1170937770

Devise de référence

Franc suisse (CHF)

Date de lancement

20 décembre 2010

Date de fin d'exercice

31 mars

Benchmark officiel

Swiss Performance Index SPI®

Publication des cours

Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation

Prix d'émission

CHF 1'000

VNI au 30.09.2024

Classe I: CHF 3'220,41

Classe II: CHF 3'224,60

Classe III: CHF 3'226,86

Fortune sous gestion

CHF 150,2 mio

Liquidité

hebdomadaire

Délai de souscription

vendredi 10h00

Délai de rachat de parts

vendredi 10h00

Date de règlement / souscription

T+2 (mardi)

Date de règlement / rachat de parts

T+2 (mardi)

Frais de souscription

aucun frais de souscription

Frais de rachat

les frais de remboursement sont dégressifs en fonction de la durée de détention des parts:

- 0,50% de 0 à 6 mois

- 0,25% de 6 à 12 mois

- 0% dès 12 mois

TER KGAST au 31.03.2024

Classe I: 0,64%

Classe II: 0,59%

Classe III: 0,56%

Avertissement: bien que les données aient été obtenues auprès de sources considérées comme fiables, Prisma Fondation ne donne aucune garantie quant à leur fiabilité, exactitude ou exhaustivité. Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.

Excess Returns

ESG SPI® Efficient III vs. SPI® TR
Excess returns annuels [%] Excess returns mensuels [%]

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc		
2022	1,61			0,50	-0,31	0,99	-0,52	0,14	0,16	-1,01	-0,31	1,21	2022	
2023	2,98	-1,39	1,26	0,18	-0,49	-0,84	-0,34	0,50	0,55	0,38	2,44	-0,90	-0,28	2023
2024	0,24	-0,21	-0,00	-1,25	0,73	-1,19	0,39	0,92	-0,14	0,75				2024

Chiffres clés

1 an

(30.09.2023 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient III	14,75%	8,09%	1,67	3,61%	0,04%
SPI® TR	13,04%	11,07%	1,08		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient III	0,42	0,71	0,0495	-2,80%	1
SPI® TR				-5,24%	2

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months

Chiffres clés

Depuis le lancement

(01.04.2022 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient III	2,78%	10,42%	0,23	2,98%	-
SPI® TR	1,79%	12,26%	0,11		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient III	0,33	0,83	0,0120	-15,15%	20
SPI® TR				-15,62%	20

*Taux sans risque: SNB Interest Rate Target Range 3 Months