

**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: PRSIEF 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 29.09.2023**

Classe I: CHF 2'808,69

Classe II: CHF 2'810,93

Classe III: CHF 2'812,05

**Fortune sous gestion**

CHF 164,8 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 31.03.2023**

Classe I: 0,66%

Classe II: 0,49%\*

Classe III: 0,58%

\*valeur impactée par les mouvements de fortune qui ont eu lieu lors de la création des classes I et III le 01.04.2022

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.

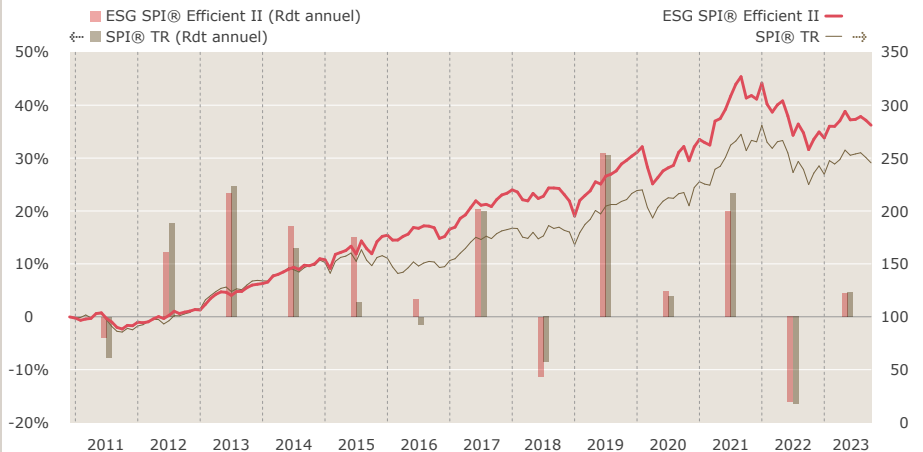
**Performances mensuelles**

2016-2023

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
SPI® TR		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
-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
-16,48	-16,14	-6,18	-2,50	2,35	1,23	-4,69	-6,28	3,90	-2,93	-5,82	3,82	2,56	-2,06	2022
4,61	4,49	4,11	-0,03	1,88	3,13	-2,73	0,15	0,94	-1,21	-1,64				2023

**Performance cumulée**

2010-2023, 20.12.2010=100



**Analyse comparative**

	(20.12.2010 – 30.09.2023)					
	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG SPI® Efficient II	181,09%	0,72%	8,39%	9,12%	64,29%	-7,39%
SPI® TR	145,49%	0,64%	7,25%	8,41%	61,69%	-7,56%
	3e trim. 2023	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG SPI® Efficient II	-1,92%	-21,09%	1,80	3,15%	10,92%	0,70
SPI® TR	-3,32%	-19,93%	1,61	3,37%	11,69%	0,57
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.	
SPI® TR	0,93	0,86	0,0196	0,86	4,43%	

\*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 29.09.2023

Classe I: CHF 2'808,69

Classe II: CHF 2'810,93

Classe III: CHF 2'812,05

### Fortune sous gestion

CHF 164,8 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 31.03.2023

Classe I: 0,66%

Classe II: 0,49%\*

Classe III: 0,58%

\*valeur impactée par les mouvements de fortune qui ont eu lieu lors de la création des classes I et III le

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

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 II vs. SPI® TR  
Excess returns annuels [%] Excess returns mensuels [%]

		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
	<b>9,45</b>	2,71	4,22	1,17	-1,75	-0,26	2,15	-0,67	-1,14	-0,44	-2,04	0,46	0,05	2016
	<b>0,91</b>	-0,12	1,16	-1,16	-0,08	0,48	-0,81	-1,38	0,27	0,53	0,62	0,09	0,77	2017
	<b>-4,91</b>	-0,81	1,10	0,17	0,09	1,20	-0,58	-1,89	1,44	-0,84	-0,98	-1,98	-0,04	2018
	<b>0,79</b>	0,66	-2,06	-0,50	-0,49	0,70	-0,43	0,05	1,36	1,29	0,60	-1,15	0,14	2019
	<b>1,97</b>	1,81	0,17	-1,70	-2,53	-0,14	-0,32	1,18	3,04	1,65	0,58	-3,10	0,19	2020
	<b>-8,54</b>	-0,09	-0,45	1,94	-0,35	-0,41	-0,42	2,18	-0,16	-0,51	-3,02	-0,57	-0,94	2021
	<b>0,57</b>	-0,51	-0,30	-0,07	0,82	-0,31	0,99	-0,52	0,14	0,16	-1,01	-0,31	1,21	2022
	<b>-0,27</b>	-1,39	1,26	0,18	-0,49	-0,84	-0,34	0,50	0,55	0,38				2023

## Chiffres clés

1 an

(30.09.2022 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	8,96%	8,19%	1,01	2,91%	4,46%
SPI® TR	<b>9,13%</b>	<b>10,14%</b>	<b>0,83</b>		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	-0,05	0,79	0,0163	-4,45%	N/A
SPI® TR				<b>-4,67%</b>	<b>N/A</b>

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

## Chiffres clés

5 ans

(30.09.2018 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	4,91%	12,72%	0,35	3,99%	-
SPI® TR	<b>5,86%</b>	<b>13,04%</b>	<b>0,41</b>		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	-0,23	0,93	-0,0054	-21,09%	N/A
SPI® TR				<b>-19,93%</b>	<b>N/A</b>

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

## Chiffres clés

10 ans

(30.09.2013 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	8,23%	11,34%	0,66	4,17%	-
SPI® TR	6,56%	11,86%	0,50		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	0,37	0,89	0,0218	-21,09%	N/A
SPI® TR				-19,93%	N/A

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