

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.

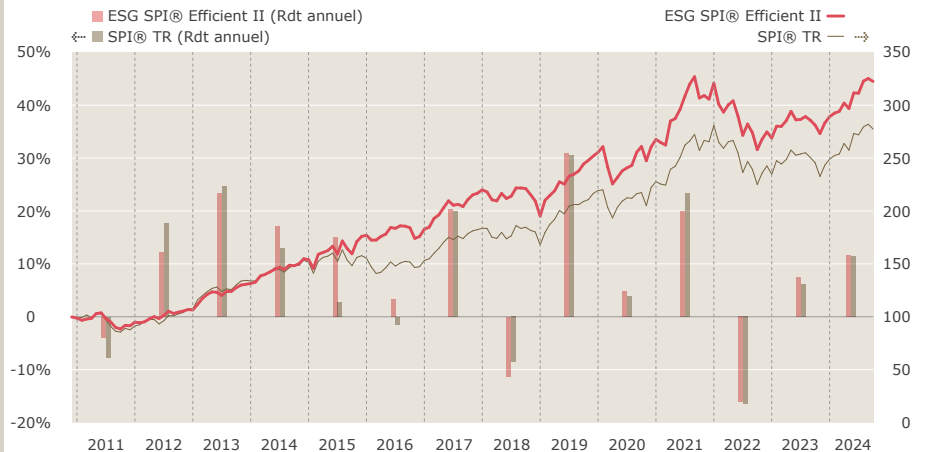
Performances mensuelles

2017-2024

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
SPI® TR		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jun	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
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
6,09	7,45	4,11	-0,03	1,88	3,13	-2,73	0,15	0,94	-1,21	-1,64	-2,80	3,65	2,07	2023
11,47	11,55	1,18	0,56	2,69	-1,71	4,95	-0,07	3,66	0,76	-0,84				2024

Performance cumulée

2010-2024, 20.12.2010=100



Analyse comparative

(20.12.2010 – 30.09.2024)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG SPI® Efficient II	222,46%	0,76%	8,83%	9,12%	64,46%	-7,39%
SPI® TR	177,50%	0,67%	7,66%	8,41%	62,05%	-7,56%

	3e trim. 2024	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*
ESG SPI® Efficient II	3,57%	-21,09%	1,81	3,10%	10,73%	0,75
SPI® TR	2,03%	-19,93%	1,63	3,35%	11,62%	0,60

	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
SPI® TR	0,93	0,86	0,0210	0,85	4,36%

*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

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

		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
	0,91	-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
	-4,91	-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
	0,79	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
	1,97	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
	-8,54	-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
	0,57	-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
	2,91	-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
	0,18	-0,22	-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 II	14,72%	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 II	0,41	0,71	0,0492	-2,80%	1
SPI® TR				-5,24%	2

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

Chiffres clés

5 ans

(30.09.2019 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	5,70%	11,96%	0,43	3,95%	-
SPI® TR	5,83%	12,77%	0,41		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	-0,03	0,89	0,0044	-21,09%	N/A
SPI® TR				-19,93%	23

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

Chiffres clés

10 ans

(30.09.2014 – 30.09.2024, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	8,08%	11,50%	0,64	4,15%	-
SPI® TR	6,45%	12,18%	0,48		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	0,37	0,89	0,0219	-21,09%	N/A
SPI® TR				-19,93%	23

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