

## PRISMA ESG SPI® Efficient

### OLZ AG, BERNE

Gestion déléguée depuis le 20.12.2010

Le concept d'investissement minimum variance d'OLZ. Spécialisé dans la gestion du risque, OLZ a développé depuis 2001 des modèles d'investissement qui visent à réduire le risque tout en gardant une allocation totale à la classe d'actif. Ainsi, la pondération optimale des titres en portefeuille est définie sur la base des paramètres de risque estimés (volatilité, corrélations). OLZ est à la pointe de la recherche financière et académique dans le domaine de la gestion quantitative et travaille continuellement à l'amélioration de ses modèles de gestion. L'optimisation systématique des portefeuilles gérés par OLZ améliore leur efficacité (moins de risque, plus de rendement).

### PERFORMANCE INDEXÉE\*

PRISMA ESG SPI® Efficient (20.12.2010=100, 05.07.2024=315,15)

— PRISMA ESG SPI® Efficient  
— SPI



### PERFORMANCES MENSUELLES\*

Performances annuelles [%] | Performances mensuelles [%]

SPI	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	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
9,25	7,70	1,18	0,56	2,69	-1,71	4,95	-0,07							2024

### PERFORMANCES AU 5 JUILLET 2024\*

	2021	2022	2023	2024	Depuis le 20.12.10	Vol. ann.
PRISMA ESG SPI® Efficient	19,87%	-16,14%	7,45%	9,02%	215,15%	13,23%
Swiss Performance Index SPI®	23,38%	-16,48%	6,09%	9,90%	173,60%	14,80%

\*Les performances se réfèrent à la classe II.

Copyright © 2024 PRISMA Fondation, tous droits réservés.

### CARACTÉRISTIQUES

#### Classification OPP 2

Actions

#### 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 05.07.2024

Classe I: CHF 3'147,76

Classe II: CHF 3'151,48

Classe III: CHF 3'153,46

#### Fortune sous gestion

CHF 146,8 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

## RÉPARTITION PAR TITRES (TOP 10)

	Portfolio	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	8,4%	11,4%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,8%	4,5%
NESTLÉ SA-REG	7,2%	16,4%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	6,9%	10,2%
GIVAUDAN-REG	6,4%	2,0%
SWISSCOM AG-REG	5,7%	0,9%
SGS SA-REG	5,4%	0,9%
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,7%	0,9%
GEBERIT AG-REG	4,5%	1,1%
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,4%	0,6%
Nombre total de titres	38	
Part de titres non inclus dans le benchmark	0,00%	

## RÉPARTITION SECTORIELLE

	Portfolio	Benchmark
Industries	22,9%	12,4%
Santé	21,1%	32,9%
Sociétés financières	16,3%	17,6%
Consommation non cyclique	15,0%	18,8%
Matériaux de base	8,6%	8,0%
Immobilier	8,1%	1,3%
Télécommunications	5,7%	0,9%
Services aux collectivités	0,9%	0,2%
Cash	0,7%	0,0%
Technologie	0,7%	2,1%
Autres	0,0%	5,8%

## POLITIQUE ESG

## Sélection négative

A chaque rebalancement, les titres ayant une ou plusieurs caractéristiques sont exclus de l'univers d'investissement:

- [+] Exclus par l'Association suisse pour des investissements responsables (ASIR);
- [+] Exclus par le fonds souverain norvégien;
- [+] Niveau de controverse «rouge» (le plus élevé) selon MSCI ESG Ratings; notation «CCC» (la plus basse) par MSCI ESG Ratings;
- [+] Notation MSCI ESG dégradée de deux crans en moins de trois mois;
- [+] Exposition aux activités controversées (armement, charbon et pétrole bitumineux).

## LA FONDATION D'INVESTISSEMENT PRISMA ENTRE PROFESSIONNELS DE LA PRÉVOYANCE

PRISMA est une fondation d'investissement à but non lucratif créée en 2000 sous l'impulsion d'institutions de prévoyance du 2<sup>e</sup> pilier. Aujourd'hui, PRISMA figure comme l'une des rares institutions en Suisse pilotée par des professionnels de la prévoyance pour des professionnels de la prévoyance. La Fondation compte un grand nombre de membres-investisseurs, auxquels elle offre avec la plus grande transparence la gestion d'une gamme de placements diversifiée et innovante. Architecture ouverte, PRISMA gère des approches et des techniques de gestion spécialisées avec un ratio rendement/risque attrayant et répondant aux attentes spécifiques des caisses de pension.

*Avec une volonté affirmée de ne pas reproduire ce qui existe déjà, PRISMA propose des solutions d'investissement spécifiques et novatrices.*

## Intégration dans l'optimisation à chaque rebalancement

- [+] Réduction au minimum de 30% du «Footprint CO<sub>2</sub>» du portefeuille par rapport à celui du benchmark;
- [+] Score minimum absolu: le portefeuille optimisé correspond, au niveau agrégé, à une notation MSCI ESG supérieure à celle du benchmark.

## Proxy voting «ESG» via ISS

## GROUPES DE PLACEMENTS

## Actions

PRISMA ESG SPI® Efficient  
PRISMA Global Residential Real Estate  
PRISMA ESG Sustainable SOCIETY  
PRISMA ESG China Equities  
PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities

## Obligations

PRISMA ESG World Convertible Bonds  
PRISMA ESG Global Credit Allocation  
PRISMA ESG CHF Bonds

## Infrastructure

PRISMA ESG Global Infrastructure

## Produits Alternatifs

PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1  
PRISMA Alternative Multi-Manager  
PRISMA SHARP

## Immobilier

PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate  
PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Fondation - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tél. 0848 106 106 - info@prisma-fondation.ch - www.prisma-fondation.ch

Ce document commercial est exclusivement conçu à des fins d'information et ne constitue pas un conseil en investissement de produits financiers. Du fait de leur simplification, les informations contenues dans ce document peuvent n'être que partielles. Elles peuvent être subjectives et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Toutes ces données ont été établies de bonne foi sur la base d'informations de marché. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. La responsabilité de PRISMA Fondation ne saurait être engagée par une prise de décision sur la base de ces informations. Il est recommandé aux investisseurs qui envisagent d'investir dans ce produit, de ne pas fonder leur décision sur les seuls éléments contenus dans ce document. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus sans frais auprès de PRISMA Fondation.