PRISMA Systematic European Small Caps

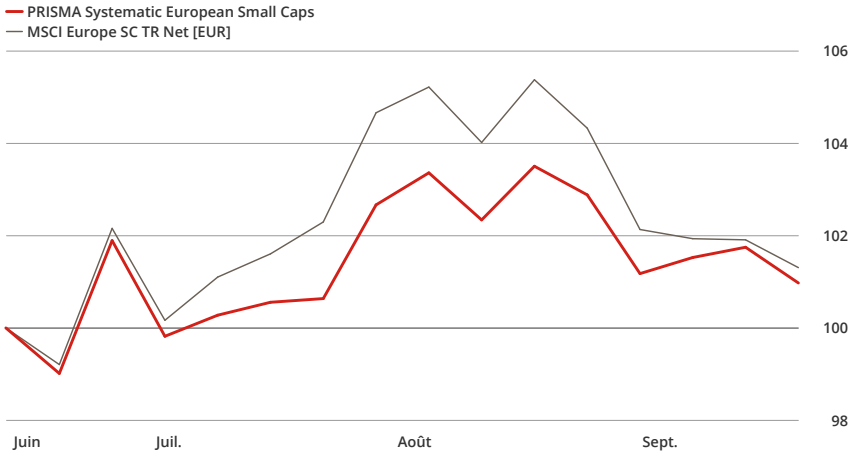
LAZARD ASSET MANAGEMENT LLC

Gestion déléguée depuis le 25.06.2026

Les stratégies de la gamme «Systematic» sont gérées sur la plateforme quantitative Lazard Advantage réservée aux investisseurs institutionnels. Elles se distinguent par un faible tracking error et des ratios d'information élevés. La stratégie PRISMA Systematic European Small Caps investit dans des entreprises cotées sur les marchés développés européens qui correspondent à la définition «Small Caps», soit env. les 14% inférieurs en termes de capitalisation boursière ajustée au flottant de l'ensemble des titres cotés sur les 15 marchés concernés (hors Europe émergente). Les titres dont la capitalisation boursière est inférieure à l'équivalent de USD 100 millions sont exclus. Les titres figurant sur la liste d'exclusion de SVVK-ASIR sont également exclus. La monnaie de référence est l'EUR (non couvert).

PERFORMANCE INDEXÉE[1]

PRISMA Systematic European Small Caps (25.06.2026=100, 02.10.2026=100,98)



PERFORMANCES MENSUELLES[1]

Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]												
MSCI Europe SC TR Net[2]	Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	
2,14	1,82					-0,76	1,41	2,45	-1,25				2026

PERFORMANCES AU 2 OCTOBRE 2026[1]

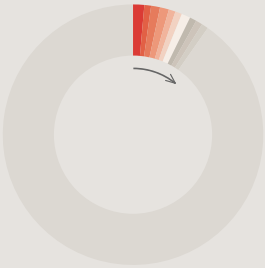
[1]Les performances se réfèrent à la classe III. [2]MSCI Europe Small Cap TR Net [EUR].

Copyright © 2026 PRISMA Fondation, tous droits réservés.

CARACTÉRISTIQUES

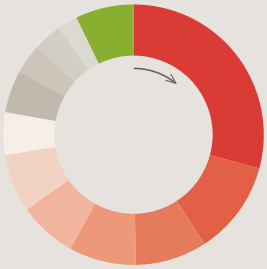
Classification OPP 2
Actions
Banque dépositaire
UBS Switzerland AG, Zurich
Administrateur
UBS Switzerland AG, Zurich
Distribution
Key Investment Services (KIS) SA, Morges
Auditeur
BDO SA
Numéro de valeur
Classe I: 154934655
Classe II: 154934656
Classe III: 154934657
Ticker Bloomberg
Classe III: PRSESCI SW
Code ISIN
Classe I: CH1549346554
Classe II: CH1549346562
Classe III: CH1549346570
Devise de référence
Euro (EUR)
Date de lancement
25 juin 2026
Date de fin d'exercice
31 mars
Benchmark officiel
MSCI Europe Small Cap TR Net [EUR]
Publication des cours
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation
Prix d'émission
EUR 1'000
VNI au 02.10.2026
Classe III: EUR 1'009,77
Fortune sous gestion
EUR 50,5 mio
Liquidité
hebdomadaire
Délai de souscription
jeudi 10h00
Délai de rachat de parts
jeudi 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 ex ante
Classe I: 0,65%
Classe II: 0,63%
Classe III: 0,53%

POSITIONS PRINCIPALES



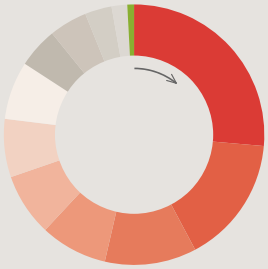
Diploma PLC	1,3%
PSP Swiss Property AG	1,0%
Games Workshop Group PLC	1,0%
Keller Group plc	1,0%
Aedifica SA	0,9%
Carmila SA	0,9%
Subsea 7 S.A.	0,9%
ISS A/S	0,9%
Loomis AB	0,9%
voestalpine AG	0,8%
Autres	90,2%

RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE



Royaume-Uni	29,1%
Suède	11,7%
France	9,0%
Allemagne	8,3%
Italie	7,3%
Suisse	7,2%
Norvège	5,4%
Danemark	5,1%
Autriche	3,7%
Espagne	3,5%
Belgique	2,6%
Autres	7,2%

RÉPARTITION SECTORIELLE



Industries	26,4%
Sociétés financières	15,8%
Consommation discrétionnaire	11,4%
Immobilier	8,3%
Matériaux de base	7,9%
Technologie	7,4%
Santé	7,1%
Energie	5,1%
Télécommunications	4,6%
Consommation non cyclique	3,3%
Services aux collectivités	2,0%
Cash	0,9%

PHILOSOPHIE D'INVESTISSEMENT

[+] La stratégie est mise en œuvre selon une approche systématique et quantitative de sélection de titres («bottom-up»), fondée sur une base de données centralisée combinant prix, fondamentaux et autres données nécessaires au processus d'investissement.

[+] La philosophie d'investissement repose sur l'idée que des inefficiences de marché, liées notamment à l'émotion et aux biais des investisseurs, peuvent conduire à une mauvaise valorisation des entreprises et créer des opportunités d'investissement.

[+] Le gérant met en œuvre une approche «core» gérée par rapport à un benchmark large et diversifié, afin de rechercher une surperformance de manière régulière au travers de nombreuses décisions de sélection de titres («bottom-up»).

[+] L'approche vise à éviter les décisions binaires de type allocation «top-down» (p. ex. sur/sous-pondération de pays, facteurs/styles «value» vs «growth», rotation sectorielle ou timing de facteurs/styles) au profit d'une sélection de titres disciplinée.

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 2e 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.

GROUPES DE PLACEMENTS

Actions
PRISMA ESG SPI® Efficient
PRISMA Global Residential Real Estate
PRISMA ESG Sustainable SOCIETY
PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities
PRISMA Systematic European Small Caps
PRISMA Systematic China All Shares

Obligations
PRISMA ESG World Convertible Bonds
PRISMA Global High Yield
PRISMA Global Bonds

Produits Alternatifs
PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1
PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 2
PRISMA Alternative Multi-Manager
PRISMA SHARP
PRISMA BEYONDER

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.

Copyright © 2026 PRISMA Fondation, tous droits réservés.