PRISMA
Fondation d'investissement · Anlagestiftung

PRISMA ESG SPI® Efficient

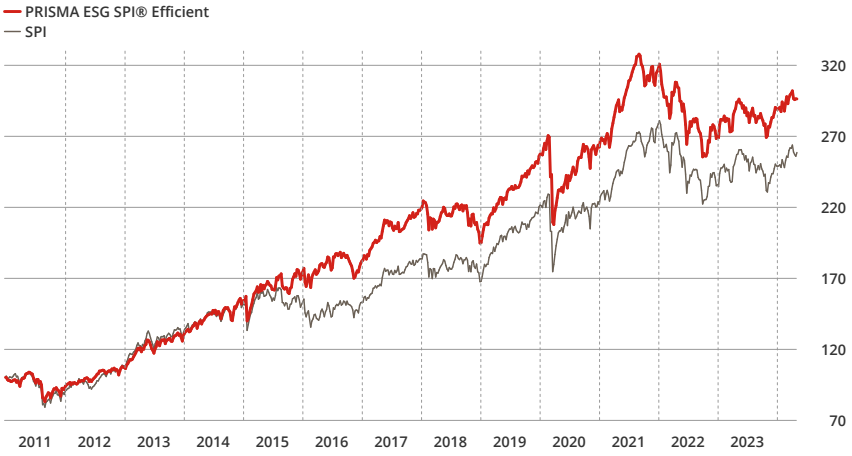
OLZ AG, BERN

Delegierte Verwaltung seit dem 20.12.2010

OLZ ist auf Risikomanagement spezialisiert und entwickelt seit 2001 Anlagemodelle, die darauf abzielen, bei vollständiger Allokation das Risiko zu reduzieren. Die optimale Gewichtung der Titel im Portfolio auf der Grundlage von geschätzten Risikoparametern (Volatilität, Korrelationen) festgelegt. OLZ ist in der Finanzmarkt- und akademischen Forschung im Bereich der quantitativen Vermögensverwaltung führend und verbessert seine Anlagestrategien fortlaufend. Die systematische Optimierung der von OLZ verwalteten Portfolios verbessert somit deren Effizienz (weniger Risiko, mehr Rendite).

INDEXIERTE PERFORMANCE*

PRISMA ESG SPI® Efficient (20.12.2010=100, 26.04.2024=296.32)



MONATSRENDITE*

Jahresrendite [%] SPI	Jahresrendite [%]	Monatsrendite [%] Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
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
5.98	4.48	1.18	0.56	2.69										2024

PERFORMANCE ZUM 26. APRIL 2024*

	2021	2022	2023	2024	Seit dem 20.12.10	Ann. Vol.
PRISMA ESG SPI® Efficient	19.87%	-16.14%	7.45%	2.51%	196.32%	13.29%
Swiss Performance Index SPI®	23.38%	-16.48%	6.09%	3.88%	158.60%	14.85%

*Die Performances beziehen sich auf die Klasse II.

Copyright © 2024 PRISMA. Alle Rechte vorbehalten.

MERKMALE

BVV 2-Klassifizierung
Aktien
Depotbank
Credit Suisse (Suisse) AG, Zürich
Administrator
Credit Suisse Funds SA, Zürich
Vertrieb
Key Investment Services (KIS) AG, Morges
Kontrollstelle
Ernst & Young AG, Lausanne
Valoren-Nummer
Klasse I: 117069258
Klasse II: 11339766
Klasse III: 117093777
Bloomberg
Klasse I: PRESEIC SW
Klasse II: PRSPIEF SW
Klasse III: PRESEII SW
ISIN
Klasse I: CH1170692581
Klasse II: CH0113397662
Klasse III: CH1170937770
Referenzwährung
Schweizer Franken (CHF)
Datum der Lancierung
20. Dezember 2010
Jahresabschluss
31. März
Offizielle Benchmark
Swiss Performance Index SPI®
Publikation der Kurse
Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar und PRISMA Anlagestiftung
Emissionspreis
CHF 1'000
NIW am 26.04.2024
Klasse I: CHF 2'960.01
Klasse II: CHF 2'963.23
Klasse III: CHF 2'964.92
Verwaltetes Vermögen
CHF 138.0 Mio.
Liquidität
Wöchentlich
Zeichnungstermin
Freitag 10.00 Uhr
Rückgabetermin
Freitag 10.00 Uhr
Abrechnungsdatum (Zeichnung)
Z+2 (Dienstag)
Abrechnungsdatum (Rückgaben)
Z+2 (Dienstag)
Zeichnungsgebühren
Keine Zeichnungsgebühren
Rückgabegebühren
Rücknahmegebühren sind degressiv und werden gemäss Anlagedauer berechnet:
- 0.50% ab 0 bis 6 Monate
- 0.25% ab 6 bis 12 Monate
TER KGAST am 31.03.2023
Klasse I: 0.66%
Klasse II: 0.49%*
Klasse III: 0.58%
*Wert beeinflusst durch Vermögensbewegungen, die bei der Gründung der Klassen I und III am 01.04.2022 stattgefunden haben

TITELAUFTEILUNG (TOP 10)

	Portfolio	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	8.3%	12.0%
NESTLE SA-REG	7.7%	17.5%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7.4%	11.5%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7.4%	4.3%
GIVAUDAN-REG	6.2%	1.9%
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5.7%	1.1%
SWISSCOM AG-REG	5.2%	0.9%
SGS SA-REG	5.0%	0.7%
GEBERIT AG-REG	5.0%	1.2%
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4.6%	0.6%

Gesamtanzahl Titel	39
Im Benchmark nicht inbegriffene Titel	0.00%

AUFTEILUNG NACH SEKTOREN

	Portfolio	Benchmark
Industrieunternehmen	24.1%	11.6%
Gesundheitswesen	21.4%	32.8%
Basiskonsumgüter	15.9%	20.8%
Finanz-Dienstleistungen	15.8%	17.3%
Immobilien	9.3%	1.4%
Grundstoffe	6.3%	7.7%
Telekommunikation	5.2%	0.9%
Versorger	1.0%	0.2%
Technologie	0.7%	2.2%
Cash	0.3%	0.0%
Übrige	0.0%	5.1%

ESG-POLITIK

Negative Auswahl

Bei jedem Rebalancing werden Titel mit einem oder mehreren Merkmalen aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen:

[+] Von der Schweizer Vereinigung für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK);
[+] Vom norwegischen Staatsfonds;
[+] MSCI ESG Ratings: Kontroverse Stufe „Rot“ (am höchsten); MSCI ESG Ratings: „CCC“ (am niedrigsten);
[+] Um zwei Stufen herabgestuftes MSCI ESG-Rating in weniger als drei Monaten;
[+] Exposure gegenüber umstrittenen Aktivitäten (Rüstung, Kohle und bituminöses Erdöl).

Integration in die Optimierung bei jedem Rebalancing

[+] Reduzierung des „CO_2-Fußabdrucks“ des Portfolios um mindestens 30% gegenüber der Benchmark;
[+] Absolute Mindestpunktzahl: Das optimierte Portfolio entspricht auf dem Gesamtniveau einem MSCI ESG-Rating, das höher ist als das der Benchmark.

Proxy voting „ESG“ via ISS

DIE ANLAGESTIFTUNG PRISMA VON VORSORGEFACHLEUTEN FÜR VORSORGEFACHLEUTE

PRISMA ist eine gemeinnützige Anlagestiftung, die im Jahr 2000 von Vorsorgeeinrichtungen der 2. Säule gegründet wurde. Heute ist PRISMA eine der wenigen nationalen Institutionen, die direkt von Fachleuten Schweizer Pensionskassen geführt wird. Die Anlagestiftung verfügt über eine grosse Anzahl von Mitglieder-Investoren, denen sie die Verwaltung einer diversifizierten und innovativen Palette von Anlageprodukten mit grösstmöglicher Transparenz anbietet. Die offene Architektur von PRISMA ermöglicht spezialisierte Managementansätze und -techniken mit einem attraktiven Risiko-Ertrags-Verhältnis, die den spezifischen Bedürfnissen von Pensionskassen entsprechen.

Mit dem festen Willen, nicht einfach nur Bestehendes zu reproduzieren, sondern eigene Wege zu gehen, schlägt PRISMA spezifische und innovative Anlagelösungen vor.

ANLAGEGRUPPEN

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

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

Infrastruktur
PRISMA ESG Global Infrastructure

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

Immobilien
PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate
PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Anlagestiftung - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tel. 0848 106 106 - info@prismaanlagestiftung.ch - www.prismaanlagestiftung.ch

Dieses Dokument dient einzig zu Informationszwecken und stellt keine Anlageberatung für Finanzprodukte dar. Aufgrund ihrer Vereinfachung sind die in diesem Dokument enthaltenen Informationen nur teilweise zutreffend. Sie können subjektiv sein und können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Alle diese Angaben wurden in gutem Glauben auf den Grundlagen von Marktinformationen erstellt. Für die aus externen Informationsquellen stammenden Elemente, kann die Richtigkeit nicht garantiert werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die Zukünftige. Die PRISMA Anlagestiftung haftet nicht für Entscheidungen, die auf der Grundlage dieser Informationen getroffen werden. Anlegern, die eine Investition in dieses Produkt erwägen, wird empfohlen, ihre Entscheidung nicht allein auf die in diesem Dokument enthaltenen Elemente zu stützen. Alle Dokumente, die rechtliche Grundlagen für eine eventuelle Anlage bilden, können kostenlos bei der PRISMA Anlagestiftung angefordert werden.

Copyright © 2024 PRISMA. Alle Rechte vorbehalten.