

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 29.12.2023

Classe I: CHF 2'888,13

Classe II: CHF 2'890,80

Classe III: CHF 2'892,17

Fortune sous gestion

CHF 169,5 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

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

01.04.2022

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.

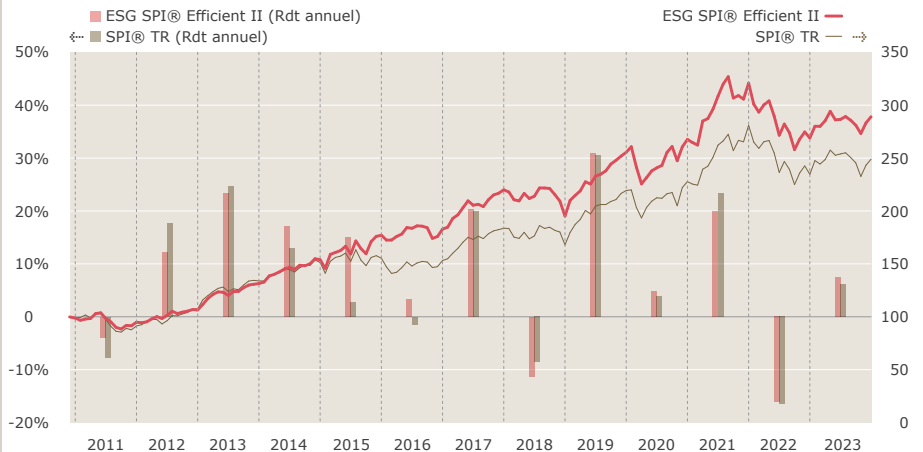
Performances mensuelles

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
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

Performance cumulée

2010-2023, 20.12.2010=100



Analyse comparative

	(20.12.2010 – 31.12.2023)					
	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG SPI® Efficient II	189,08%	0,73%	8,45%	9,12%	64,33%	-7,39%
SPI® TR	148,95%	0,64%	7,22%	8,41%	61,78%	-7,56%

	4e trim. 2023					
	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	
ESG SPI® Efficient II	-21,09%	1,80	3,15%	10,90%	0,71	
SPI® TR	-19,93%	1,62	3,39%	11,75%	0,56	

	SPI® TR				
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.
SPI® TR	0,93	0,86	0,0208	0,86	4,45%

*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 29.12.2023

Classe I: CHF 2'888,13

Classe II: CHF 2'890,80

Classe III: CHF 2'892,17

Fortune sous gestion

CHF 169,5 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.

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	
	9,45	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
	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

Chiffres clés

1 an

(31.12.2022 – 31.12.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	7,45%	8,32%	0,82	3,67%	4,48%
SPI® TR	6,09%	10,92%	0,51		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	0,35	0,73	0,0276	-7,12%	N/A
SPI® TR				-9,66%	N/A

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

Chiffres clés

5 ans

(31.12.2018 – 31.12.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	8,18%	12,28%	0,61	4,05%	-
SPI® TR	8,19%	12,97%	0,58		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	-0,00	0,90	0,0072	-21,09%	N/A
SPI® TR				-19,93%	N/A

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

Chiffres clés

10 ans

(31.12.2013 – 31.12.2023, fréquence: mensuelle)

	Performance annualisée	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	Tracking Err. ann.	Tracking Err. ann. ex ante
ESG SPI® Efficient II	8,20%	11,43%	0,66	4,23%	-
SPI® TR	6,40%	12,05%	0,48		

	Ratio d'info. ann.	Bêta*	Alpha de Jensen ann.*	Drawdown maximum	Recovery Period
ESG SPI® Efficient II	0,40	0,89	0,0234	-21,09%	N/A
SPI® TR				-19,93%	N/A

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