

**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

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.

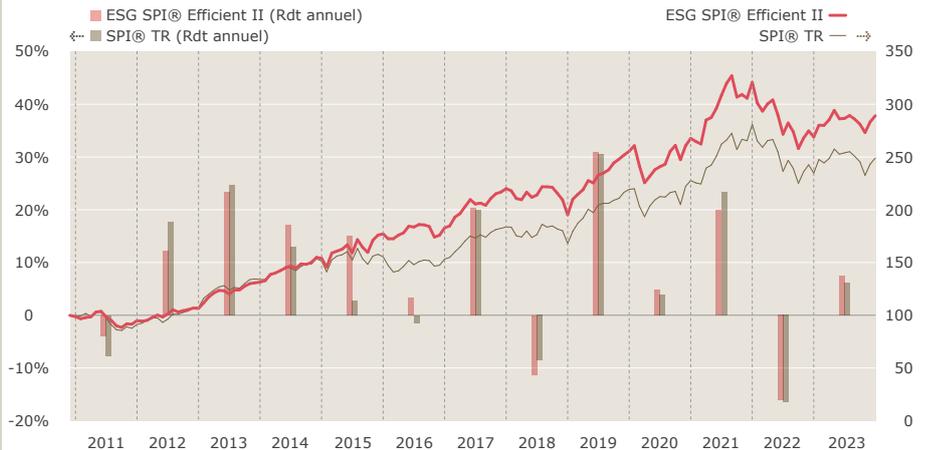
**Performances mensuelles**

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 | 2,84%                     | -21,09%              | 1,80                   | 3,15%         | 10,90%                | 0,71                  |
| SPI® TR               | 1,41%                     | -19,93%              | 1,62                   | 3,39%         | 11,75%                | 0,56                  |
|                       | 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   |      |
|--|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
|  | <b>9,45</b>  | 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 |
|  | <b>0,91</b>  | -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 |
|  | <b>-4,91</b> | -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 |
|  | <b>0,79</b>  | 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 |
|  | <b>1,97</b>  | 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 |
|  | <b>-8,54</b> | -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 |
|  | <b>0,57</b>  | -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 |
|  | <b>2,91</b>  | -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