

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, 06.09.2024=319.07)

— PRISMA ESG SPI® Efficient
— SPI



MONATSRENDITE*

Jahresrendite [%]	Monatsrendite [%]													
SPI		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
13.27	12.49	1.18	0.56	2.69	-1.71	4.95	-0.07	3.66	0.76					2024

PERFORMANCE ZUM 6. SEPTEMBER 2024*

	2021	2022	2023	2024	Seit dem 20.12.10	Ann. Vol.
PRISMA ESG SPI® Efficient	19.87%	-16.14%	7.45%	10.38%	219.07%	13.17%
Swiss Performance Index SPI®	23.38%	-16.48%	6.09%	8.61%	170.39%	14.82%

*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 06.09.2024

Klasse I: CHF 3'186.69

Klasse II: CHF 3'190.73

Klasse III: CHF 3'192.90

Verwaltetes Vermögen

CHF 148.6 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 31.03.2024

Klasse I: 0.64%

Klasse II: 0.59%

Klasse III: 0.56%

TITELAUFTeilUNG (TOP 10)

	Portfolio	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	8.9%	12.5%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7.2%	11.1%
NESTLE SA-REG	7.0%	15.2%
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.8%	0.9%
BARRY CALLEBAUT AG-REG	4.4%	0.3%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.3%	4.4%
GIVAUDAN-REG	4.1%	2.1%
PSP SWISS PROPERTY AG-REG	3.9%	0.3%
SWISSCOM AG-REG	3.9%	0.8%
SWISS PRIME SITE-REG	3.9%	0.4%
Gesamtanzahl Titel	42	
Im Benchmark nicht inbegriffene Titel	0.00%	

AUFTEILUNG NACH SEKTOREN

	Portfolio	Benchmark
Gesundheitswesen	24.8%	32.0%
Finanz-Dienstleistungen	18.6%	18.2%
Basiskonsumgüter	17.1%	17.7%
Industrieunternehmen	12.2%	13.2%
Immobilien	11.7%	1.3%
Grundstoffe	7.4%	8.8%
Telekommunikation	3.9%	0.8%
Technologie	1.5%	2.1%
Versorger	0.9%	0.0%
Nicht-Basiskonsumgüter	0.7%	5.7%
Übrige	1.3%	0.1%

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 „CO₂-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. Anleger, 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.