

1

PRISMA ESG SPI® Efficient
CH0113397662

VNI: CHF 3'040,50

| | |
|------------------------------|--|
| Gestion déléguée | OLZ AG, Berne |
| Banque dépositaire | Credit Suisse, Zurich |
| Administrateur | Credit Suisse, Zurich |
| Distribution | Key Investment Services (KIS) SA, Morges |
| Auditeur | Ernst & Young, Lausanne |
| Numéro de valeur / Bloomberg | 113 39 766 / PRSPIEF SW |
| Monnaie de référence | Francs suisses (CHF) |
| Date de lancement | 20 décembre 2010 |
| Benchmark | SPI® TR |
| Date de fin d'exercice | 31 mars |

Publication des cours
Telekurs, Reuters, Bloomberg, Morningstar et
www.prisma-fondation.ch

Liquidité hebdomadaire
Prix d'émission CHF 1000.-

Frais
Aucun frais de souscription.
Les frais de remboursement sont dégressifs en
fonction de la durée de détention des parts.

TER KGAST 0,60%

Prisma Fondation d'investissement
Rue du Sablon 2
CH-1110 Morges
Tél.: 0848 106 106
www.prisma-fondation.ch
info@prisma-fondation.ch

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.

01

Performances mensuelles

2015-2022

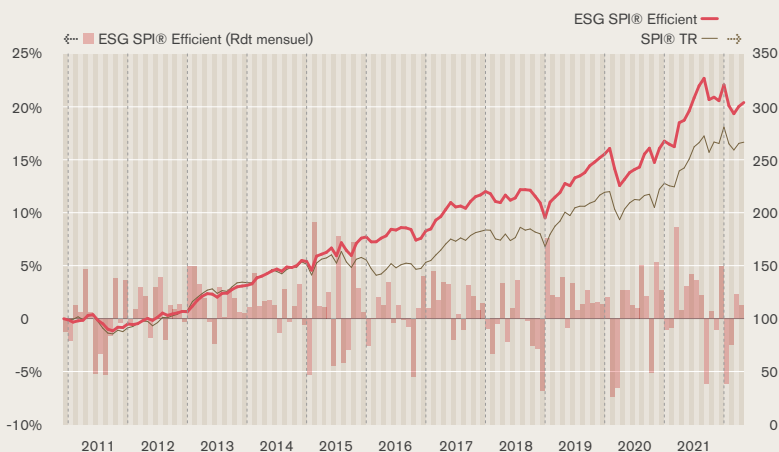
| SPI® TR | Performances annuelles [%] | Performances mensuelles [%] | | | | | | | | | | | | |
|---------|----------------------------|-----------------------------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|
| | | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc | |
| 2,68 | 15,03 | -5,36 | 9,12 | 1,13 | 1,12 | 2,52 | -4,42 | 7,76 | -4,21 | -2,97 | 7,20 | 2,88 | 0,64 | 2015 |
| -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 |
| -5,12 | -5,22 | -6,18 | -2,50 | 2,35 | 1,23 | | | | | | | | | 2022 |



02

Performance cumulée

2010-2022, 20.12.2010=100



03

Analyse comparative

(20.12.2010 – 30.04.2022)

| | Performance cumulée | Moyenne arithmétique | Performance annualisée | Meilleur mois | Mois positifs | Moins bon mois |
|--------------------|---------------------|----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------|
| ESG SPI® Efficient | 204,05% | 0,86% | 10,23% | 9,12% | 66,42% | -7,39% |
| SPI® TR | 166,58% | 0,77% | 8,97% | 8,41% | 63,50% | -7,56% |
| | Drawdown maximum | Ratio gains:perdes | Ecart-type | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | |
| ESG SPI® Efficient | -14,72% | 1,98 | 3,11% | 10,76% | 0,87 | |
| SPI® TR | -16,88% | 1,74 | 3,30% | 11,45% | 0,72 | |
| | Corrél.* | R2* | Alpha de Jensen ann.* | Bêta* | Tracking Err. ann. | |
| SPI® TR | 0,92 | 0,84 | 0,0231 | 0,86 | 4,61% | |

*Taux sans risque: Libor 3M

