

1

PRISMA ESG SPI® Efficient II
CH0113397662

VNI: CHF 2'739,10

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

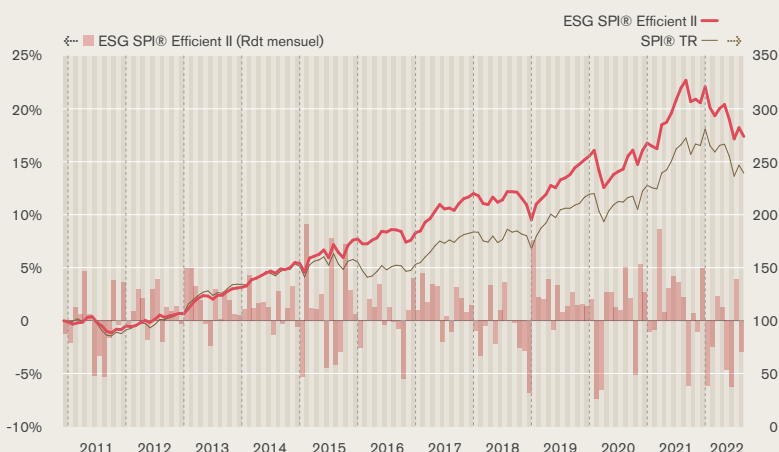
SPI® TR	Performances annuelles [%]	Performances mensuelles [%]												
		Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	
2,68	15,03	-5,36	9,12	1,13	1,12	2,52	-4,42	7,76	-4,21	-2,97	7,20	2,88	0,64	2015
-1,41	3,27	-2,60	0,02	1,98	1,26	3,48	-0,40	1,27	-0,15	-0,80	-5,47	0,99	4,02	2016
19,92	20,30	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
-14,84	-14,61	-6,18	-2,50	2,35	1,23	-4,69	-6,28	3,90	-2,93					2022



02

Performance cumulée

2010-2022, 20.12.2010=100



03

Analyse comparative

(20.12.2010 – 31.08.2022)

	Performance cumulée	Moyenne arithmétique	Performance annualisée	Meilleur mois	Mois positifs	Moins bon mois
ESG SPI® Efficient II	173,91%	0,77%	8,95%	9,12%	65,25%	-7,39%
SPI® TR	139,26%	0,68%	7,71%	8,41%	62,41%	-7,56%
	Drawdown maximum	Ratio gains:pertes	Ecart-type	Volatilité annualisée	Ratio de Sharpe ann.*	
ESG SPI® Efficient II	-16,93%	1,88	3,18%	11,02%	0,75	
SPI® TR	-16,88%	1,66	3,38%	11,72%	0,60	
	Corrél.*	R2*	Alpha de Jensen ann.*	Bêta*	Tracking Err. ann.*	
SPI® TR	0,92	0,85	0,0210	0,86	4,55%	

*Taux sans risque: Libor 3M

