

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 29.09.2023

Classe I: CHF 2'808,69

Classe II: CHF 2'810,93

Classe III: CHF 2'812,05

Fortune sous gestion

CHF 164,8 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.

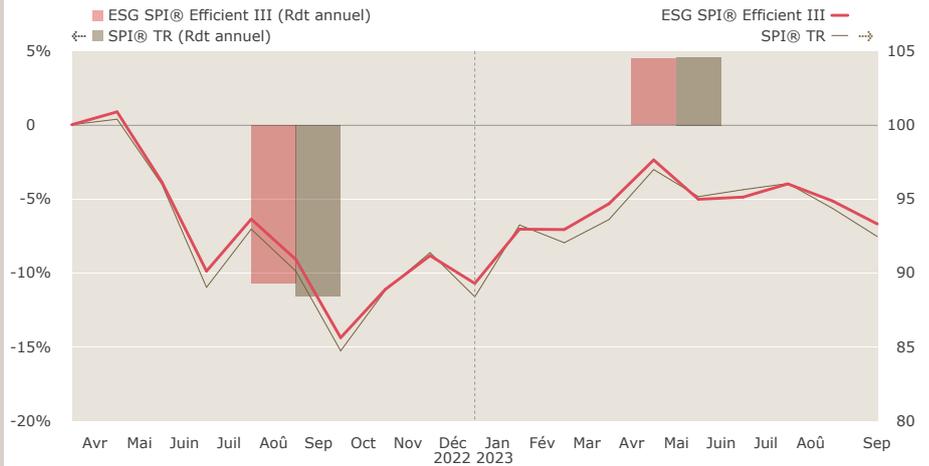
Performances mensuelles

2022-2023

| Performances annuelles [%] | Performances mensuelles [%] | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------|-----------------------------|------|-------|------|------|-------|-------|------|-------|-------|------|------|-------|
| | SPI® TR | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc |
| -11,61 | -10,70 | | | | 0,91 | -4,70 | -6,28 | 3,90 | -2,92 | -5,81 | 3,83 | 2,56 | -2,06 |
| 4,61 | 4,51 | 4,11 | -0,03 | 1,88 | 3,13 | -2,73 | 0,16 | 0,94 | -1,20 | -1,64 | | | |

Performance cumulée

2022-2023, 01.04.2022=100



Analyse comparative

| | (01.04.2022 – 30.09.2023) | | | | | |
|------------------------|---------------------------|----------------------|------------------------|---------------|---------------|----------------|
| | Performance cumulée | Moyenne arithmétique | Performance annualisée | Meilleur mois | Mois positifs | Moins bon mois |
| ESG SPI® Efficient III | -6,68% | -0,33% | -4,50% | 4,11% | 50,00% | -6,28% |
| SPI® TR | -7,53% | -0,37% | -5,08% | 5,50% | 50,00% | -7,27% |

| | 3e trim. 2023 | Drawdown maximum | Ratio gains:pertes | Ecart-type | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* |
|---------|------------------------|------------------|--------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| | ESG SPI® Efficient III | -1,91% | -15,15% | 1,00 | 3,31% | 11,46% |
| SPI® TR | -3,32% | -15,62% | 1,00 | 3,73% | 12,90% | -0,43 |

| | Corrél.* | R2* | Alpha de Jensen ann.* | Bêta* | Tracking Err. ann. |
|--|----------|------|-----------------------|---------|--------------------|
| | SPI® TR | 0,98 | 0,97 | -0,0008 | 0,88 |

*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 29.09.2023

Classe I: CHF 2'808,69

Classe II: CHF 2'810,93

Classe III: CHF 2'812,05

Fortune sous gestion

CHF 164,8 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 III vs. SPI® TR
Excess returns annuels [%] Excess returns mensuels [%]

| | Jan | Fév | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aoû | Sep | Oct | Nov | Déc | |
|------|-------|-------|------|------|-------|-------|-------|------|------|-------|-------|------|--|
| 2022 | 1,61 | | | 0,50 | -0,31 | 0,99 | -0,52 | 0,14 | 0,16 | -1,01 | -0,31 | 1,21 | |
| 2023 | -0,22 | -1,39 | 1,26 | 0,18 | -0,49 | -0,84 | -0,34 | 0,50 | 0,55 | 0,38 | | | |

Chiffres clés

1 an

(30.09.2022 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| ESG SPI® Efficient III | 8,99% | 8,19% | 1,01 | 2,91% | 4,46% |
| SPI® TR | 9,13% | 10,14% | 0,83 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| ESG SPI® Efficient III | -0,04 | 0,79 | 0,0166 | -4,43% | N/A |
| SPI® TR | | | | -4,67% | N/A |

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

Chiffres clés

Depuis le lancement

(01.04.2022 – 30.09.2023, fréquence: mensuelle)

| | Performance annualisée | Volatilité annualisée | Ratio de Sharpe ann.* | Tracking Err. ann. | Tracking Err. ann. ex ante |
|------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|----------------------------|
| ESG SPI® Efficient III | -4,50% | 11,46% | -0,43 | 2,59% | - |
| SPI® TR | -5,08% | 12,90% | -0,43 | | |

| | Ratio d'info. ann. | Bêta* | Alpha de Jensen ann.* | Drawdown maximum | Recovery Period |
|------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------|-----------------|
| ESG SPI® Efficient III | 0,24 | 0,88 | -0,0008 | -15,15% | N/A |
| SPI® TR | | | | -15,62% | N/A |

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