PRISMA ESG SPI® Efficient

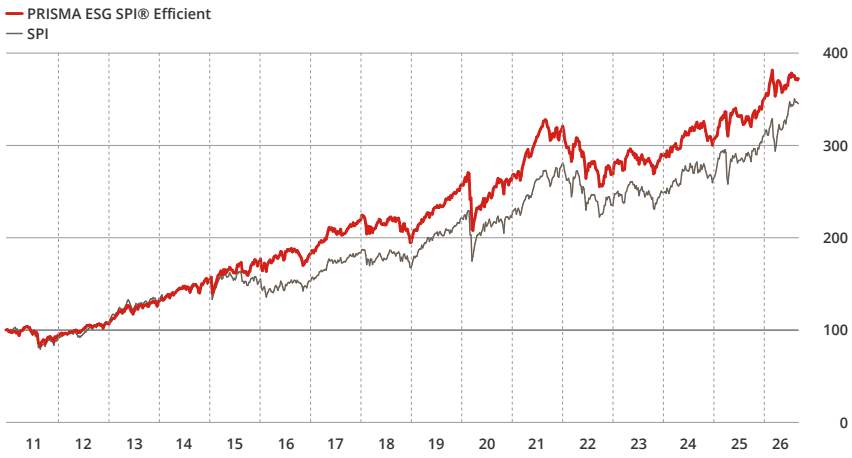
OLZ AG, BERNE

Gestion déléguée depuis le 20.12.2010

Le concept d'investissement minimum variance d'OLZ. Spécialisé dans la gestion du risque, OLZ a développé depuis 2001 des modèles d'investissement qui visent à réduire le risque tout en gardant une allocation totale à la classe d'actif. Ainsi, la pondération optimale des titres en portefeuille est définie sur la base des paramètres de risque estimés (volatilité, corrélations). OLZ est à la pointe de la recherche financière et académique dans le domaine de la gestion quantitative et travaille continuellement à l'amélioration de ses modèles de gestion. L'optimisation systématique des portefeuilles gérés par OLZ améliore leur efficience (moins de risque, plus de rendement).

PERFORMANCE INDEXÉE*

PRISMA ESG SPI® Efficient (20.12.2010=100, 04.09.2026=372,45)



PERFORMANCES MENSUELLES*

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
SPI		Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	
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
6,18	5,46	1,18	0,56	2,69	-1,71	4,95	-0,07	3,66	0,76	-0,84	-3,12	-0,93	-1,49	2024
17,76	15,09	4,72	2,79	1,38	-0,17	1,93	-2,30	-2,50	1,55	-0,97	1,66	3,68	2,65	2025
10,38	5,26	1,29	7,34	-4,77	0,24	0,22	1,97	1,05	-1,79					2026

PERFORMANCES AU 4 SEPTEMBRE 2026*

	2023	2024	2025	2026	Depuis le 20.12.10	Vol. ann.
PRISMA ESG SPI® Efficient	7,45%	5,46%	15,09%	6,15%	272,45%	12,86%
Swiss Performance Index SPI®	6,09%	6,18%	17,76%	10,90%	245,23%	14,66%

*Les performances se réfèrent à la classe II.

Copyright © 2026 PRISMA Fondation, tous droits réservés.

CARACTÉRISTIQUES

Classification OPP 2
Actions
Banque dépositaire
UBS Switzerland AG, Zurich
Administrateur
UBS Switzerland AG, Zurich
Distribution
Key Investment Services (KIS) SA, Morges
Auditeur
BDO SA
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
SIX Financial Information, LSEG, Bloomberg, Morningstar et PRISMA Fondation
Prix d'émission
CHF 1'000
VNI au 04.09.2026
Classe I: CHF 3'716,08
Classe II: CHF 3'724,51
Classe III: CHF 3'729,26
Fortune sous gestion
CHF 111,4 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 31.03.2026
Classe I: 0,62%
Classe II: 0,58%
Classe III: 0,54%

RÉPARTITION PAR TITRES (TOP 10)

	Portfolio	Benchmark
ROCHE HOLDING AG	8,5%	12,5%
NESTLE SA-REG	8,4%	11,4%
NOVARTIS AG-REG	7,8%	12,9%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,0%	4,8%
FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	4,3%	0,3%
PSP SWISS PROPERTY AG-REG	4,2%	0,4%
SGS SA-REG	4,1%	0,9%
SWISS PRIME SITE-REG	4,0%	0,6%
GALENICA AG	4,0%	0,2%
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,7%	0,2%

Nombre total de titres	50
Part de titres non inclus dans le benchmark	0,00%

RÉPARTITION SECTORIELLE

	Portfolio	Benchmark
Sociétés financières	24,7%	19,1%
Santé	21,7%	35,6%
Industries	19,0%	14,6%
Immobilier	16,3%	1,6%
Consommation non cyclique	10,8%	13,0%
Télécommunications	3,9%	1,1%
Technologie	1,0%	1,5%
Services aux collectivités	0,8%	0,2%
Consommation discrétionnaire	0,6%	6,1%
Matériaux de base	0,0%	7,4%
Autres	1,2%	0,0%

POLITIQUE ESG

Sélection négative

A chaque rebalancement, les titres ayant une ou plusieurs caractéristiques sont exclus de l'univers d'investissement:
[+] Exclus par l'Association suisse pour des investissements responsables (ASIR);
[+] Exclus par le fonds souverain norvégien;
[+] Niveau de controverse «rouge» (le plus élevé) selon MSCI ESG Ratings; notation «CCC» (la plus basse) par MSCI ESG Ratings;
[+] Notation MSCI ESG dégradée de deux crans en moins de trois mois;
[+] Exposition aux activités controversées (armement, charbon et pétrole bitumineux).

Intégration dans l'optimisation à chaque rebalancement

[+] Réduction au minimum de 30% du «Footprint CO_2» du portefeuille par rapport à celui du benchmark;
[+] Score minimum absolu: le portefeuille optimisé correspond, au niveau agrégé, à une notation MSCI ESG supérieure à celle du benchmark.

Proxy voting «ESG» via ISS

LA FONDATION D'INVESTISSEMENT PRISMA ENTRE PROFESSIONNELS DE LA PRÉVOYANCE

PRISMA est une fondation d'investissement à but non lucratif créée en 2000 sous l'impulsion d'institutions de prévoyance du 2e pilier. Aujourd'hui, PRISMA figure comme l'une des rares institutions en Suisse pilotée par des professionnels de la prévoyance pour des professionnels de la prévoyance. La Fondation compte un grand nombre de membres-investisseurs, auxquels elle offre avec la plus grande transparence la gestion d'une gamme de placements diversifiée et innovante. Architecture ouverte, PRISMA gère des approches et des techniques de gestion spécialisées avec un ratio rendement/risque attrayant et répondant aux attentes spécifiques des caisses de pension.

Avec une volonté affirmée de ne pas reproduire ce qui existe déjà, PRISMA propose des solutions d'investissement spécifiques et novatrices.

GROUPES DE PLACEMENTS

Actions
PRISMA ESG SPI® Efficient
PRISMA Global Residential Real Estate
PRISMA ESG Sustainable SOCIETY
PRISMA ESG Global Emerging Markets Equities
PRISMA Systematic European Small Caps
PRISMA Systematic China All Shares

Obligations
PRISMA ESG World Convertible Bonds
PRISMA Global High Yield
PRISMA Global Bonds

Produits Alternatifs
PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 1
PRISMA ESG Private Equity Co-Invest 2
PRISMA Alternative Multi-Manager
PRISMA SHARP
PRISMA BEYONDER

Immobilier
PRISMA Previous Responsible Residential Real Estate
PRISMA Redbrix Real Estate

PRISMA Fondation - Rue du Sablon 2 - 1110 Morges - Tél. 0848 106 106 - info@prisma-fondation.ch - www.prisma-fondation.ch

Ce document commercial est exclusivement conçu à des fins d'information et ne constitue pas un conseil en investissement de produits financiers. Du fait de leur simplification, les informations contenues dans ce document peuvent n'être que partielles. Elles peuvent être subjectives et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Toutes ces données ont été établies de bonne foi sur la base d'informations de marché. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. La responsabilité de PRISMA Fondation ne saurait être engagée par une prise de décision sur la base de ces informations. Il est recommandé aux investisseurs qui envisagent d'investir dans ce produit, de ne pas fonder leur décision sur les seuls éléments contenus dans ce document. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus sans frais auprès de PRISMA Fondation.

Copyright © 2026 PRISMA Fondation, tous droits réservés.