

## PRISMA ESG SPI® Efficient

### OLZ AG, BERNE

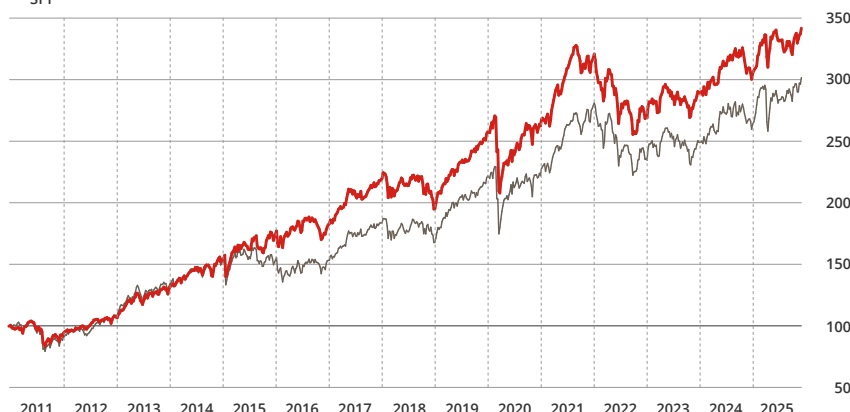
Gestion déléguée depuis le 20.12.2010

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 efficacité (moins de risque, plus de rendement).

### PERFORMANCE INDEXÉE\*

PRISMA ESG SPI® Efficient (20.12.2010=100, 28.11.2025=341,83)

— PRISMA ESG SPI® Efficient  
— SPI



### PERFORMANCES MENSUELLES\*

Performances annuelles [%]		Performances mensuelles [%]												
SPI		Janv.	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	
-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
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
14,09	12,12	4,72	2,79	1,38	-0,17	1,93	-2,30	-2,50	1,55	-0,97	1,66	3,68		2025

### PERFORMANCES AU 28 NOVEMBRE 2025\*

	2022	2023	2024	2025	Depuis le 20.12.10	Vol. ann.
PRISMA ESG SPI® Efficient	-16,14%	7,45%	5,46%	12,12%	241,83%	12,99%
Swiss Performance Index SPI®	-16,48%	6,09%	6,18%	14,09%	201,61%	14,76%

\*Les performances se réfèrent à la classe II.

Copyright © 2025 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 28.11.2025

Classe I: CHF 3'411,84

Classe II: CHF 3'418,26

Classe III: CHF 3'421,84

#### Fortune sous gestion

CHF 98,7 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 31.03.2025

Classe I: 0,64%

Classe II: 0,59%

Classe III: 0,56%

RÉPARTITION PAR TITRES (TOP 10)

	Portfolio	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	9,3%	12,3%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7,5%	11,3%
NESTLE SA-REG	6,9%	11,7%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,2%	5,2%
SWISSCOM AG-REG	4,9%	0,9%
PSP SWISS PROPERTY AG-REG	4,6%	0,4%
GALENICA AG	4,5%	0,3%
BALOISE HOLDING AG - REG	4,3%	0,5%
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4,3%	0,8%
FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	4,2%	0,3%
Nombre total de titres	48	
Part de titres non inclus dans le benchmark	0,00%	

RÉPARTITION SECTORIELLE

	Portfolio	Benchmark
Santé	22,8%	33,4%
Sociétés financières	22,1%	20,8%
Immobilier	15,3%	1,7%
Industries	15,0%	13,7%
Consommation non cyclique	13,1%	13,8%
Télécommunications	5,2%	1,2%
Matériaux de base	3,8%	7,5%
Services aux collectivités	1,1%	0,2%
Technologie	0,6%	1,8%
Consommation discrétionnaire	0,6%	5,9%
Autres	0,3%	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<sub>2</sub>» 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 2<sup>e</sup> 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
- Obligations**
  - PRISMA ESG World Convertible Bonds
  - PRISMA ESG Global Credit Allocation
  - PRISMA Global Bonds
- Infrastructure**
  - PRISMA ESG Global Infrastructure
- 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