

OLZ - Equity USA Optimized ESG

Klasse PH (CHF hedged)



31.03.2021

Für Marketingzwecke

MSCI ESG Rating: A

Fondsporträt

Der Fonds investiert in US-Aktien mit besonderem Fokus auf Diversifikation und Liquidität. Er verfolgt einen disziplinierten und strukturierten Anlageprozess. OLZ prognostiziert die Risikoeigenschaften (Volatilität, Korrelation) für jede einzelne Aktien im MSCI USA Index und leitet auf Grundlage eines unternehmenseigenen Optimierungsmodells ein optimal diversifiziertes Portfolio ab. Zielportfolio ist das Minimum-Varianz-Portfolio, das eine Verbesserung des Risiko-Rendite-Verhältnisses im Vergleich zum nach Marktkapitalisierung gewichteten Index (MSCI USA Index) über einen mittel- bis langfristigen Zeithorizont anstrebt. Die Referenzwährung ist CHF, bei einem maximalen Fremdwährungsrisiko von 10% (Zielexposure 5%).

Fondsdaten

Emissionsdatum	20.10.2016
Fondsmanager	OLZ AG
Standort Fondsmanager	Bern
Fondsleitung	Credit Suisse Funds AG
Depotbank	Credit Suisse (Schweiz) AG
Fondstyp	Retail Fonds
Fondsdomizil	Schweiz
Fondswährung	USD
Ende des Geschäftsjahres	31. August
Verwendung des Erfolges	thesaurierend
Ausgabe / Rücknahme	täglich
Preisfixierung	Zeichnungstag
Benchmark (BM)	MSCI USA (NR) (95% CHF hdg.)
Fondsvermögen (in Mio.)	11.42

Anteilsklasse

Währung der Anteilsklasse	CHF
ISIN	CH0336063729
Valoren-Nr.	33606372
Bloomberg Ticker	OLUEOPH SW
Nettoinventarwert (NAV)	126.18
52-Wochen-Hoch	127.48
52-Wochen-Tief	96.81

Gebühren und Kosten

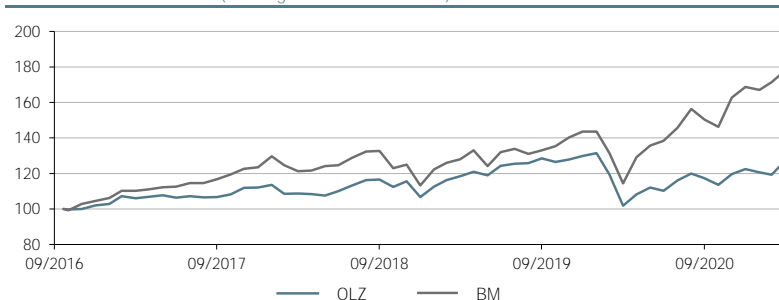
OLZ Fee in % p.a.	0.60
TER (per 31.08.2020) in %	0.82
Ausgabekommission in %	keine
Rücknahmekommission in %	keine
Titelankaufsspesen z.G. Fonds in %	0.10
Titelverkaufsspesen z.G. Fonds in %	0.10

Risikokennzahlen*

	Fonds	BM
Korrelation mit BM	0.88	-
Volatilität p.a. in %	12.97	15.92
Sharpe Ratio	0.44	0.89
Maximum Drawdown in %	-22.57	-20.33

* seit Lancierung

Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100)



Quelle: OLZ AG | Vergangene Performance ist keine Garantie für künftige Entwicklungen. Die dargestellte Performance berücksichtigt keine bei Zeichnung und Rücknahme von Anteilen erhobene Kommissionen und Kosten.

Netto-Performance bis 31.03.2021 in %

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit Lancierung
Fonds	6.89	4.13	8.62	25.23	17.22	-	27.45
BM	3.95	5.56	18.51	55.74	47.00	-	78.20

Netto-Performance Kalenderjahr in %

	2015	2016*	2017	2018	2019	2020	2021 (YTD)
Fonds	-	2.04	9.86	-4.75	21.61	-5.74	4.13
BM	-	4.49	18.23	-8.34	26.83	17.54	5.56

* 20.10.2016 - 31.12.2016

Sektoren (in %)	Fonds	BM	Länder (in %)	Fonds	BM
Basiskonsumgüter	16.6	5.9	USA	100.0	100.0
Industrie	15.2	8.7			
Gesundheitswesen	14.7	13.2			
IT	10.1	27.5			
Versorgungsbetriebe	9.2	2.6			
Finanzwesen	9.1	11.0			
Nicht-Basiskonsumgüter	8.6	12.1			
Kommunikationsdienste	7.8	11.1			
Immobilien	5.0	2.6			
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2.4	2.7			
Energie	1.2	2.6			
Anderere	0.2	0.0			

Top-10-Positionen

Top-10-Positionen	in %
Amerco	1.9
Dollar Tree	1.8
Broadridge Financial Solutions	1.8
McDonald's	1.8
Expeditors Intl. Wash	1.7
C. H. Robinson Worldwide	1.7
Waste Management	1.7
Republic ServiceS	1.7
Oracle	1.7
Bunge	1.6

Währungen (in %)

Währungen (in %)	Fonds	BM
CHF	93.7	95.0
USD	6.3	5.0

ESG Kennzahlen*

ESG Kennzahlen*	Fonds	BM
MSCI ESG Score	5.8	5.7
MSCI ESG Rating	A	BBB

* per letztem Rebalancing (20.1.2021)

ESG Ausschluss-

kriterien*	Fonds in %	BM in %
CCC - Rating	0.0	0.3
Controversy Red Flag	0.0	1.5
UN Global Compact: Fail	0.0	0.8

* per letztem Rebalancing (20.1.2021)

Das Dokument dient ausschliesslich Marketing- und Informationszwecken sowie der Nutzung durch den Empfänger. Es wurde von der OLZ AG mit grösster Sorgfalt und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt. Die OLZ AG gibt jedoch keine Gewähr hinsichtlich dessen Inhalt und Vollständigkeit und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung dieser Informationen ergeben. Die in diesem Dokument geäußerten Meinungen sind diejenigen der OLZ AG zum Zeitpunkt der Redaktion und können jederzeit und ohne Mitteilung ändern. Ist nichts Anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Das Dokument stellt weder ein Angebot, noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Bankdienstleistungen dar und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung. Insbesondere ist dem Empfänger empfohlen, allenfalls unter Beizug eines Beraters, die Informationen in Bezug auf die Vereinbarkeit mit seinen eigenen Verhältnissen, auf juristische, regulatorische, steuerliche, u.a. Konsequenzen zu prüfen. Dieses Dokument darf ohne schriftliche Genehmigung der OLZ AG weder auszugsweise noch vollständig vervielfältigt werden. Es richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbieten. Weder das vorliegende Dokument noch Kopien davon dürfen in die Vereinigten Staaten versandt oder dahin mitgenommen werden oder in den Vereinigten Staaten oder an eine US-Person abgegeben werden (im Sinne von Regulation S des US Securities Act von 1933 in dessen jeweils gültigen Fassung). Mit jeder Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen verbunden. Bei Fremdwährungen besteht zusätzlich das Risiko, dass die Fremdwährung gegenüber der Referenzwährung des Anlegers an Wert verliert. Historische Renditeangaben und Finanzmarktsszenarien sind keine Garantie für laufende und zukünftige Ergebnisse. Die Performance-Angaben berücksichtigen die bei der Ausgabe und der Rücknahme erhobenen Kommissionen und Kosten nicht. Es kann ausserdem nicht garantiert werden, dass die Performance des Vergleichsindex erreicht oder übertroffen wird. Für weitere Informationen wenden Sie sich bitte an Ihren Kundenberater. Zudem können im Hinblick auf das Investment Interessenkonflikte bestehen. Das Dokument darf nicht als unabhängige Wertpapieranalyse gelesen werden. Für die Richtigkeit der MSCI-Daten wird keine Gewähr übernommen. Die hier beschriebenen Produkte werden von MSCI weder gesponsert noch kommentiert und sind auch nicht von MSCI überprüft oder weitergegeben worden. Keinesfalls übernimmt MSCI oder ein mit MSCI verbundenes Unternehmen Haftung in Zusammenhang mit den hierin beschriebenen Daten und Produkten. Jegliche Vervielfältigung und Weitergabe der MSCI-Daten ist strengstens untersagt. Zeichnungen sind nur auf Basis des aktuellen Verkaufsprospekts mit integriertem Fondsvertrag, des vereinfachten Prospekts und des letzten Jahresberichtes (bzw. Halbjahresberichtes, falls dieser aktueller ist) gültig. Dieses Dokument richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, denen der Zugang zu dergleichen Informationen untersagt ist. Für einzelne Teilvermögen oder Anteilsklassen kann der Anlegerkreis im Fondsvertrag zusätzlich eingeschränkt werden. Der Fondsvertrag und der Jahresbericht sind kostenlos bei OLZ AG, Bern, der Fondsleitung, der Credit Suisse Funds AG, Zürich oder bei der Depotbank, der CREDIT SUISSE (Schweiz) AG, Zürich, erhältlich. Die Total Expense Ratio (TER) bezeichnet die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem durchschnittlichen Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand). Der Wert stammt aus dem jeweils letzten verfügbaren Jahresbericht.