

OLZ - Equity USA Optimized ESG

Classe PH (CHF hedged)



31.03.2021

A des fins de commercialisation

MSCI ESG Rating: A

Portrait du fonds

Le fonds investit dans des actions américaines avec une attention particulière à la diversification et la liquidité. Les placements suivent un processus structuré et rigoureux. OLZ prédit les propriétés de risque (volatilités, corrélations) pour chaque action de l'indice MSCI USA et, sur la base d'un modèle d'optimisation propre, en dérive un portefeuille diversifié de manière optimale. Le portefeuille cible est le portefeuille à la variation minimale, qui vise à améliorer le ratio risque / rendement par rapport à l'indice pondéré en fonction de la capitalisation (indice MSCI USA) sur un horizon de moyen à long terme. La monnaie de référence est le CHF, le risque de change s'élevant au maximum à 10% (exposition cible de 5%).

Fiche du fonds

Date de lancement	20.10.2016
Nom du gestionnaire	OLZ AG
Gérant basé à	Berne
Direction du fonds	Credit Suisse Funds AG
Banque dépositaire	Credit Suisse (Schweiz) AG
Type de fonds	Fonds retail
Domicile du fonds	Suisse
Devises du fonds	USD
Fin de l'exercice fiscal	31. août
Utilisation du résultat	capitalisation
Emission / rachat	quotidien
Fixation du prix	Jour d'émission
Benchmark (BM)	MSCI USA (NR) (95% CHF hdg.)
Encours total (en mio.)	11.42

Catégorie de parts

Monnaie de la catégorie de parts	CHF
Code ISIN	CH0336063729
N° de valeur	33606372
Code Bloomberg	OLUEOPH SW
Valeur liquidative (NAV)	126.18
Plus haut sur 1 an	127.48
Plus bas sur 1 an	96.81

Honoraires et frais

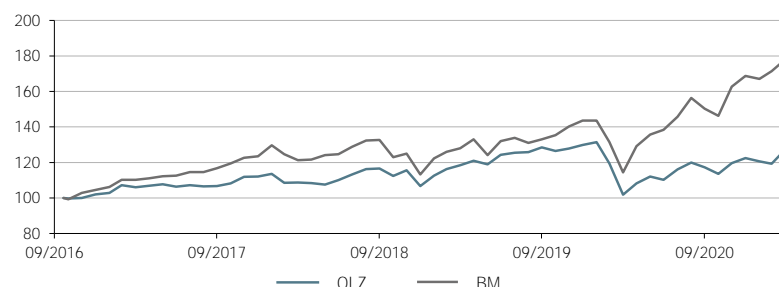
OLZ Fee en % par an	0.60
TER (au 31.08.2020) en %	0.82
Commission d'achat en %	rien
Commission de vente en %	rien
Frais d'achat en faveur du fonds en %	0.10
Frais de vente en faveur du fonds en %	0.10

Indicateurs de risques*

	Fonds	BM
Corrélation avec BM	0.88	-
Volatilité p.a. en %	12.97	15.92
Sharpe Ratio	0.44	0.89
Maximum drawdown en %	-22.57	-20.33

* depuis le lancement

Performance nette en CHF (base de 100)



Source: OLZ AG | La performance passée n'offre aucune garantie de l'évolution future. La performance représentée ne tient pas compte de commissions et de frais éventuels prélevés lors de la souscription et du rachat de parts.

Performance nette au 31.03.2021 en %

	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	3 ans	5 ans	depuis le lancement
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

Performance nette par année civile en %

	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

Secteurs (en %)	Fonds	BM	Pays (en %)	Fonds	BM
Biens de Consom. de Base	16.6	5.9	États-Unis	100.0	100.0
Industrie	15.2	8.7			
Santé	14.7	13.2			
Technologies de l'Information	10.1	27.5			
Services aux Collectivités	9.2	2.6			
Finance	9.1	11.0			
Consom. Discrétionnaire	8.6	12.1			
Services de Communication	7.8	11.1			
Immobilier	5.0	2.6			
Matériaux	2.4	2.7			
Energie	1.2	2.6			
Autres	0.2	0.0			

10 positions principales

	en %
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

Monnaies (en %)

	Fonds	BM
CHF	93.7	95.0
USD	6.3	5.0

Rapports d'ESG*

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

* par dernier rééquilibrage (20.1.2021)

ESG critères

d'exclusion*	Fonds en %	BM en %
CCC - Rating	0.0	0.3
Controversy Red Flag	0.0	1.5
UN Global Compact: Fail	0.0	0.8

* par dernier rééquilibrage (20.1.2021)

Ce document est fourni exclusivement à titre d'information et de marketing et à l'usage du destinataire. Il a été élaboré par OLZ AG avec le plus grand soin et en toute bonne foi. OLZ AG ne fournit toutefois aucune garantie quant à l'exactitude et à l'exhaustivité du présent document et décline toute responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de l'utilisation de ces informations. Le présent document reflète les opinions de OLZ AG au moment de sa rédaction; celles-ci peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Sauf mention contraire, les chiffres n'ont pas été vérifiés. Ce document ne constitue ni une offre ni une recommandation en vue de l'achat ou de la vente d'instruments financiers ou de services bancaires et ne saurait délier le destinataire de la nécessité de former son propre jugement. Il est en particulier recommandé à ce dernier d'examiner ces informations, le cas échéant avec l'aide d'un conseiller, sous l'angle de la compatibilité avec ses ressources personnelles et celui des conséquences juridiques, réglementaires, fiscales, etc. La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit préalable de OLZ AG est interdite. Il est expressément stipulé que ce document ne s'adresse pas aux personnes soumises à une législation leur interdisant l'accès à de telles informations du fait de leur nationalité ou de leur domicile. Par ailleurs, il est interdit d'envoyer, d'introduire ou de distribuer ce document ou une copie de celui-ci aux États-Unis ou de le remettre à une personne US (en vertu de la Regulation S découlant du Securities Act américain de 1933, dans sa version actuellement en vigueur). Tout placement comporte des risques, en particulier des risques de fluctuation des valeurs et des rendements. En outre, les monnaies étrangères sont exposées au risque de dépréciation par rapport à la monnaie de référence de l'investisseur. Il est à noter que les rendements historiques et les scénarios de marché financier ne constituent aucune garantie de résultats futurs. Les indications des rendements ne considèrent pas les commissions et frais appliqués lors de la souscription ou du rachat. En outre, il ne peut pas être garanti que la performance de l'indice de référence sera totalisée ou excédée. Vous pouvez obtenir de plus amples informations en prenant contact avec votre relationship manager. Les conflits potentiels d'intérêts ne peuvent être exclus. Ce document ne doit pas être interprété comme une étude indépendante. L'exactitude des données MSCI n'est pas garantie. Les produits décrits ici ne sont ni recommandés ni commentés par MSCI, qui ne les a pas contrôlés ni transmis. Ni MSCI ni une société lui étant liée n'assume de responsabilité en rapport avec les produits et les informations abordés ici. Toute reproduction ou transmission des données MSCI est formellement interdite. Les souscriptions ne sont valables que sur la base du prospectus en vigueur avec contrat intégré, du prospectus simplifié, et du dernier rapport annuel (ou, le cas échéant, semestriel si celui-ci est plus récent). Il est expressément stipulé que le présent document ne s'adresse pas aux personnes auxquelles il est interdit d'accéder à de telles informations. Le contrat de fonds de placement peut prévoir en outre des restrictions supplémentaires relatives aux investisseurs pour certains sous-fonds ou pour certaines classes de parts. Le contrat de fonds et le rapport annuel sont disponibles gratuitement auprès de OLZ AG, Bern, Credit Suisse Funds AG, Zurich, et de toutes les banques de CREDIT SUISSE (Schweiz) AG en Suisse. Le Total Expense Ratio (TER) correspond à la somme des commissions et des frais qui sont imputés au fur et à mesure à l'actif moyen du fonds (charges d'exploitation). La valeur est tirée du dernier rapport annuel disponible.