

# OLZ Equity Switzerland Small & Mid Cap Optimized ESG



Classe I | pour investisseurs qualifiés

30.04.2024

A des fins de commercialisation

MSCI ESG Rating: AA

## Portrait du fonds

Ce fonds investit dans des actions suisses de petite et moyenne capitalisation en mettant particulièrement l'accent sur la liquidité, les critères de durabilité/ESG (Environmental, Social, Governance) et sur une diversification optimale. Le fonds vise à obtenir un ratio risque/rendement optimal par rapport à un indice pondéré du capital, avec un horizon de moyen à long terme. Les décisions placements suivent un processus systématique et rigoureux fondé sur le risque. OLZ pronostique les caractéristiques de risque (volatilité, corrélations) et constitue un portefeuille diversifié de façon optimale à l'aide de l'optimisation de la variance minimale propre à OLZ. Il n'y a pas d'effet de levier, ni de vente à découvert, ni de prêts de titres dans le fonds.

## Fiche du fonds

|                             |                            |
|-----------------------------|----------------------------|
| Date de lancement           | 15.12.2022                 |
| Nom du gestionnaire         | OLZ AG                     |
| Gérant basé à               | Bern                       |
| Direction du fonds          | Credit Suisse Funds AG     |
| Banque dépositaire          | Credit Suisse (Schweiz) AG |
| Type de fonds               | Fonds institutionnel       |
| Domicile du fonds           | Suisse                     |
| Devise du fonds             | CHF                        |
| Fin de l'exercice fiscal    | 31. août                   |
| Utilisation du résultat     | capitalisation             |
| Emission / rachat           | quotidien                  |
| Fixation du prix            | Jour d'émission            |
| Benchmark (BM)              | SPI Extra Index (TR)       |
| Encours total (en mio. CHF) | 38.91                      |

## Catégorie de parts

|                                  |              |
|----------------------------------|--------------|
| Monnaie de la catégorie de parts | CHF          |
| Code ISIN                        | CH1183522353 |
| N° de valeur                     | 118352235    |
| Code Bloomberg                   | OLESWMI SW   |
| Valeur liquidative (NAV)         | 111.11       |
| Plus haut sur 1 an               | 112.47       |
| Plus bas sur 1 an                | 99.46        |

## Honoraires et frais

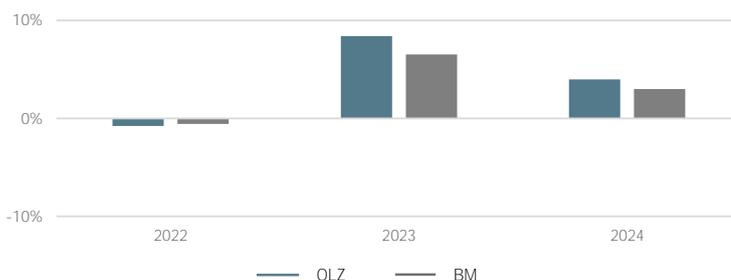
|  |      |
|--|------|
| OLZ Fee en % par an                    | 0.60 |
| Ex-ante TER en %                       | 0.68 |
| <b>Commission d'achat en %</b>         | rien |
| Commission de vente en %               | rien |
| Frais d'achat en faveur du fonds en %  | 0.10 |
| Frais de vente en faveur du fonds en % | 0.10 |

## Indicateurs de risques\*

|                       | Fonds | BM     |
|-----------------------|-------|--------|
| Corrélation avec BM   | 0.91  | -      |
| Volatilité p.a. en %  | 8.04  | 11.75  |
| Sharpe Ratio          | 1.17  | 0.61   |
| Maximum drawdown en % | -5.49 | -11.96 |

\* depuis le lancement

## Rendements annuels en CHF



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 30.04.2024 en %

|       | 1 mois | 3 mois | 6 mois | 1 an  | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | p.a. depuis le lancement |
|-------|--------|--------|--------|-------|------------|------------|--------------------------|
| Fonds | -1.21  | 3.04   | 9.90   | 4.07  | -          | -          | 8.23                     |
| BM    | -1.54  | 2.91   | 11.71  | -1.40 | -          | -          | 6.35                     |

## Performance nette par année civile en %

|       | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022* | 2023 | 2024 (YTD) |
|-------|------|------|------|------|-------|------|------------|
| Fonds | -    | -    | -    | -    | -0.78 | 8.40 | 4.00       |
| BM    | -    | -    | -    | -    | -0.56 | 6.53 | 3.00       |

\* 15.12.2022 - 31.12.2022

| Secteurs (en %)               | Fonds | BM   | Pays (en %) | Fonds | BM    |
|-------------------------------|-------|------|-------------|-------|-------|
| Industrie                     | 24.2  | 30.3 | Suisse      | 100.0 | 100.0 |
| Finance                       | 21.6  | 15.6 |             |       |       |
| Immobilier                    | 18.3  | 6.8  |             |       |       |
| Biens de Consom. de Base      | 17.8  | 10.9 |             |       |       |
| Santé                         | 12.2  | 19.0 |             |       |       |
| Matériaux                     | 3.8   | 5.0  |             |       |       |
| Services aux Collectivités    | 0.4   | 1.0  |             |       |       |
| Consom. Discrétionnaire       | 0.0   | 4.5  |             |       |       |
| Energie                       | 0.0   | 0.0  |             |       |       |
| Technologies de l'Information | 0.0   | 5.8  |             |       |       |
| Services de Communication     | 0.0   | 0.3  |             |       |       |
| Autres                        | 1.7   | 0.9  |             |       |       |

## 10 positions principales

|                              | en % |
|------------------------------|------|
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 4.6  |
| DORMAKABA HOLDING AG         | 4.5  |
| PSP SWISS PROPERTY AG-REG    | 4.4  |
| YPSOMED HOLDING AG-REG       | 4.3  |
| MOBIMO HOLDING AG-REG        | 4.3  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 4.3  |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 4.3  |
| VALIANT HOLDING AG-REG       | 4.2  |
| FLUGHAFEN ZURICH AG-REG      | 4.2  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 4.1  |

## ESG critères

| Rapports d'ESG*           | Fonds | BM   | d'exclusion*            | Fonds en % | BM en % |
|---------------------------|-------|------|-------------------------|------------|---------|
| MSCI ESG Score            | 7.5   | 7.0  | CCC - Rating            | 0.0        | 0.2     |
| MSCI ESG Rating           | AA    | A    | Controversy Red Flag    | 0.0        | 0.0     |
| CO2 Intensity Scope 1 & 2 | 19.1  | 31.3 | UN Global Compact: Fail | 0.0        | 0.0     |

\* par dernier rééquilibrage (20.3.2024)

\* par dernier rééquilibrage (20.3.2024)

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 Etats-Unis ou de le remettre à une personne US (en vertu de la Regulation S découlant de 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. Il est à noter que les rendements historiques et les scénarios de marché financier ne constituent aucune garantie de résultats futurs. Les performances historiques et les scénarios de marché financier ne constituent aucune garantie de résultats courants ou 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. Les titres décrits dans le présent document ne sont ni soutenus, ni cédés, ni vendus, ni promus par la SIX Swiss Exchange. Toute responsabilité est exclue. Le produit décrit est un fonds à compartiments multiples de droit suisse de la catégorie «Autres fonds en placements traditionnels» destinés aux investisseurs qualifiés au sens de l'art. 10, al. 3 et 4 LPCC. 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 particuliers ou 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 ou fur et à mesure à l'actif moyen du fonds (charges d'exploitation). La valeur est tirée du dernier rapport annuel disponible.