

Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) vom 23. Juni 2006
Einmalige Veröffentlichung

Mitteilung an die Anleger des OLZ 3 (CH) FUND

ein Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» (nachfolgend der «Fonds»)

mit den Teilvermögen

- Equity USA Optimized ESG (in Liquidation)
- OLZ Smart Invest Dynamic
- Equity Switzerland Small & Mid Cap Optimized ESG

Ergänzung zur Publikation vom 21. November 2022

In Bezug auf die Publikation vom 21. November 2022 auf der elektronischen Plattform www.swissfunddata.ch, mit welcher die Anlegerinnen und Anleger über eine von der Credit Suisse Funds AG, Zürich, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich, als Depotbank, vorbehältlich der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA («FINMA») beabsichtigte Änderung des Fondsvertrages informiert wurden, erfolgt hiermit eine Nachpublikation.

1. § 8 Anlageziel und Anlagepolitik

Das Anlageziel des Teilvermögens **Equity USA Optimized ESG (in Liquidation)** in Ziff. 3 A) wird präzisiert und lautet neu wie folgt (Ergänzungen gegenüber der in der Mitteilung vom 21. November 2022 publizierten Fassung sind unterstrichen):

«Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich darin, das Risiko-Rendite-Verhältnis eines USA Aktienportfolios mittel-langfristig zu optimieren.

Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Ziff. 6.4 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze **«Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse, Liste «Empfehlungen zum Ausschluss» des SVVK-ASIR) und «ESG-Integration» (Positive Screening / Tilting)** setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 10% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating oder keine Daten zur Bewertung des Nachhaltigkeitsprofils aller für das Teilvermögen getätigter Anlagen in Zielfonds) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss dem vorgenannten Nachhaltigkeitsansatz «Ausschlüsse» nicht entsprechen bzw. die beim vorgenannten Nachhaltigkeitsansatz «ESG-Integration» nicht berücksichtigt werden. Bei Direktanlagen wird bei der Anwendung von «ESG-Integration» die Nachhaltigkeit von Titeln im Anlageuniversum der im Prospekt genannten Vergleichsbenchmark durch eine von MSCI Inc. bzw. deren Tochtergesellschaften erstellte Bewertung mit einem ESG-Score zwischen 0 bis höchstens 10 charakterisiert. Der ESG-Score wird zugleich einem Ratingcode von CCC bis höchstens AAA zugeordnet. Bei der Zusammenstellung des Portfolios des Teilvermögens erhöht der Vermögensverwalter mittels eines Optimierungsverfahrens den anteilsgewichteten ESG-Score des Teilvermögens gegenüber jenem des Anlageuniversums der Vergleichsbenchmark. Der Umfang der Verbesserung des anteilsgewichteten ESG-Score ist dabei vom ESG-Durchschnittsrating des Anlageuniversums der Vergleichsbenchmark zum Zeitpunkt der Berechnung abhängig. Je tiefer das ESG-Durchschnittsrating des Anlageuniversums der Vergleichsbenchmark desto grösser die prozentuale Verbesserung des anteilsgewichteten ESG-Score des Teilvermögens und umgekehrt. Gleichzeitig wird das Portfolio des Teilvermögens so zusammengestellt, dass dieses gemessen an CO₂-Kennzahlen von MSCI Inc. bzw. deren Tochtergesellschaften gegenüber der Vergleichsbenchmark eine um mindestens 30% tiefere durchschnittliche CO₂-Intensität und einen um mindestens 30% tieferen durchschnittlichen CO₂-Fussabdruck aufweist. Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

Das Anlageziel des Teilvermögens **Equity Switzerland Small & Mid Cap Optimized ESG** in Ziff. 3 C) wird präzisiert und lautet neu wie folgt (Ergänzungen gegenüber der in der Mitteilung vom 21. November 2022 publizierten Fassung sind unterstrichen):

«Als Anlageziel werden im Rahmen der Auswahl der Anlagen die jeweils für Finanzanlagen von Vorsorgeeinrichtungen geltenden Anlagevorschriften des Bundesgesetzes über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG) und der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) berücksichtigt. Das Teilvermögen eignet sich damit grundsätzlich für Anlagen von Geldern der 2. und 3. Säule, namentlich für fondsgebundene Lebensversicherungen und Vorsorgekonten der Säule 3a. Dabei obliegt es jedem Anleger, welcher der BVV 2 unterliegt, die Konformität der Richtlinien der Anlagepolitik des Teilvermögens mit seinen eigenen Anlageleitlinien sicherzustellen. Die Anlagevorschriften (inkl. Risikoverteilungsvorschriften) des BVG und der BVV 2 werden auf der Ebene des Teilvermögens berücksichtigt (allfällige Abweichungen sind im Prospekt genannt). Vorbehalten bleiben, soweit diese restriktiver sind, die zwingenden Bestimmungen des Anlagefondsrechts sowie die Bestimmungen des Fondsvertrages.

Neben Risiko- und Ertragsüberlegungen bindet der Vermögensverwalter als wesentliches Element auch die Faktoren Umwelt, Soziales und Governance («Environmental, Social and Governance», «ESG») und die damit verbundenen Nachhaltigkeitsaspekte in seine Anlageentscheide ein. Durch Anwendung der in Ziff. 6.4 des Prospekts beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze **«Ausschlüsse» (normenbasierte Ausschlüsse, wertebasierte Ausschlüsse, Liste «Empfehlungen zum Ausschluss» des SVVK-ASIR) und «ESG-Integration» (Positive Screening / Tilting)** setzt das Teilvermögen eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um. Bis maximal 10% des Vermögens des Teilvermögens können auch in Anlagen investiert werden, welche wegen geringer oder fehlender ESG-Datenabdeckung (z.B. kein ESG-Rating oder keine Daten zur Bewertung des Nachhaltigkeitsprofils aller für das Teilvermögen getätigter Anlagen in Zielfonds) den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss dem vorgenannten Nachhaltigkeitsansatz «Ausschlüsse» nicht entsprechen bzw. die beim vorgenannten Nachhaltigkeitsansatz «ESG-Integration» nicht berücksichtigt werden. Bei Direktanlagen wird bei der Anwendung von «ESG-Integration» die Nachhaltigkeit von Titeln im Anlageuniversum der im Prospekt genannten Vergleichsbenchmark durch eine von MSCI Inc. bzw. deren Tochtergesellschaften erstellte Bewertung mit einem ESG-Score zwischen 0 bis höchstens 10 charakterisiert. Der ESG-Score wird zugleich einem Ratingcode von CCC bis höchstens AAA zugeordnet. Bei der Zusammenstellung des Portfolios des Teilvermögens erhöht der Vermögensverwalter mittels eines Optimierungsverfahrens den anteilsgewichteten ESG-Score des Teilvermögens gegenüber jenem des Anlageuniversums der

Vergleichsbenchmark. Der Umfang der Verbesserung des anteilsgewichteten ESG-Score ist dabei vom ESG-Durchschnittsrating des Anlageuniversums der Vergleichsbenchmark zum Zeitpunkt der Berechnung abhängig. Je tiefer das ESG-Durchschnittsrating des Anlageuniversums der Vergleichsbenchmark desto grösser die prozentuale Verbesserung des anteilsgewichteten ESG-Score des Teilvermögens und umgekehrt. Gleichzeitig wird das Portfolio des Teilvermögens so zusammengestellt, dass dieses gemessen an CO₂-Kennzahlen von MSCI Inc. bzw. deren Tochtergesellschaften gegenüber der Vergleichsbenchmark eine um mindestens 30% tiefere durchschnittliche CO₂-Intensität und einen um mindestens 30% tieferen durchschnittlichen CO₂-Fussabdruck aufweist. Weitere Informationen hierzu sind dem Prospekt zu entnehmen.»

2. § 20 Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen

In Bezug auf die Liste der Auslagen in Ziff. 4, die der Fondsleitung und der Depotbank in Ausführung des Fondsvertrags entstanden sind und auf welche sie Anspruch auf Ersatz haben, werden die Notariats- und Handelsregisterkosten für die Eintragung von Bewilligungsträgern der Kollektivanlagegesetzgebung ins Handelsregister nach Ziff. 4 lit. f) gestrichen.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität der Änderungen des Fondsvertrages durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die oben unter Ziffer 1 aufgeführten Änderungen erstreckt.

Gegen die in dieser Nachpublikation aufgeführten zusätzlichen Änderungen des Fondsvertrages können die Anlegerinnen und Anleger keine Einwendungen erheben.

Zürich, den 30. Mai 2023

Die Fondsleitung: Credit Suisse Funds AG, Zürich
Die Depotbank: Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich