

RFP Swiss Equity Equal-Weighted - le portefeuille équi-pondéré en actions suisses

Rapport mensuel du 30. Novembre 2021

Objectif et stratégie

Le fonds vise à obtenir une performance à long terme sous forme de gains en capital en investissant dans un portefeuille d'actions suisses. Le fonds investit de manière équi-pondérée en actions tirées de l'univers du SPI. En plus de critères fondamentaux, la sélection de titres s'opère sur base de considérations statistiques et quantitatives. Le portefeuille de titres comporte typiquement approx. 100 positions. Le rebalancement est opéré régulièrement.

Commentaire de marché

Jusqu'au milieu du mois, le sentiment sur le marché suisse des actions était encore positif. L'indice SPI a atteint de nouveaux sommets. La décision de la banque centrale américaine de réduire ses achats d'obligations a eu un effet libérateur, car les perspectives sur sa politique monétaire pour les prochains mois est ainsi devenue nettement plus claire. A cela s'est ajouté l'impact positif de résultats trimestriels d'entreprises meilleurs que prévu. Cependant, la hausse du nombre de cas de Corona et, surtout, les inquiétudes concernant le nouveau variant du virus ont affecté la fin du mois. Les craintes de nouvelles restrictions économiques et d'un potentiel lockdown a nettement fait baisser les cours des actions dans la deuxième moitié du mois.

Les secteurs et les entreprises plus sensibles que la moyenne au probable renforcement des mesures de restriction liés au Covid, tels que le secteur bancaire et surtout les secteurs des loisirs et du voyage ont été particulièrement mis sous pression. Parmi les grandes capitalisations, les banques et les assurances ont le plus souffert, à l'exception de Swiss Life. Le titre du groupe de produits de luxe Richemont a connu quant à lui une hausse nettement contraire à la tendance.

Information générales

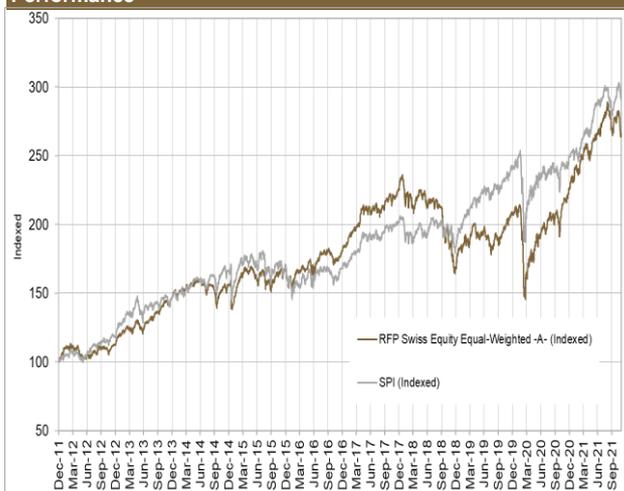
Structure juridique	Fonds de droit suisse		
Catégorie	"Fonds en valeurs mobilières"		
Transparence fiscale	En Allemagne et en Autriche		
Univers	Equity Switzerland - SPI		
Date de Lancement	27. Decembre 2005 (Change de strategie 15.11.2011)		
Benchmark	SPI - Swiss Performance Index		
Direction du fonds	Caceis (Switzerland) SA, Nyon		
Dépositaire	Caceis Bank Paris, Branch Nyon / Switzerland		
Gérants du fonds	Rieter Fischer Partners AG, Zürich		
Révision	KPMG SA, Genève		
Souscription/ Remboursement	Quotidien, 15h00 (forward pricing)		
	Classe A	Classe B	Classe C
No. Valor	2344989	29355025	2344994
No. ISIN	CH0023449892	CH0293550254	CH0023449942
Bloomberg	RFPSEPA SW	RFPSEEB SW	RFPSEPI SW
Reuters	LP65018020	LP68341811	LP65018021
Lipper ID	65018020	68341811	65018021

Données	Classe A	Classe B	Classe C
VNI de la part	CHF 203.11	CHF 206.83	CHF 214.37
Actifs sous-gestion mio.	CHF 130.69 (toutes les classes)		
TER (31.12.2020)	1.82%	1.27%	0.82%

Ratios (1YR)	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
Volatilité	12.43%	12.43%	12.43%	10.20%
Sharpe Ratio	1.76	1.81	1.86	2.15
Information Ratio	0.14	0.21	0.26	
Tracking Error	7.95%	7.95%	7.95%	
Alpha	0.02	0.03	0.04	
Beta	1.01	1.01	1.01	
Corrélation	0.78	0.78	0.78	

Performance	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
1 mois	-3.61%	-3.57%	-3.53%	-0.51%
3 mois	-7.08%	-6.95%	-6.85%	-2.60%
6 mois	1.55%	1.83%	2.06%	5.89%
1 an	21.10%	21.78%	22.33%	19.45%
3 ans	42.86%	45.26%	47.24%	47.36%
5 ans	50.63%	50.63%	58.37%	80.12%
2021	17.09%	17.69%	18.18%	16.55%
2020	8.76%	9.36%	9.86%	3.82%
2019	22.73%	23.41%	23.96%	30.59%
2018	-24.94%	-24.53%	-24.18%	-8.57%
2017	24.58%	25.26%	25.82%	19.92%
2016	7.30%		8.35%	-1.41%

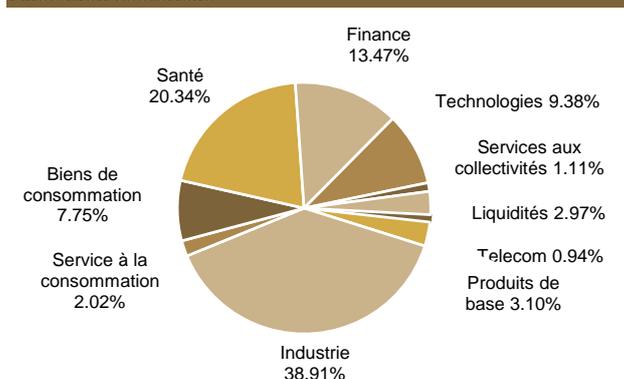
Performance



Allocation de portefeuille

Small Caps	27.71%	Actions	97.03%
Mid Caps	69.32%	Liquidités	2.97%
Large Caps	0.00%	Nb de positions	94

Allocation sectorielle



Contact

Rieter Fischer Partners AG
Stockerstrasse 23
8027 Zürich

www.rf-partners.ch
info@rf-partners.ch
Tel. +41 (0)43 305 07 20