

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

Rapport mensuel du 30. Juin 2023

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, la bourse suisse a évolué de manière erratique, puis le marché s'est affaibli. Ce n'est que vers la fin du mois que le marché a repris de la vigueur, si bien que l'indice SPI a fini par retrouver son niveau du début du mois. Les investisseurs avaient jusqu'alors accueilli positivement les décisions prises par les différentes banques centrales en matière de taux d'intérêt, mais les perspectives d'une nouvelle hausse des taux directeurs ont affecté, de manière compréhensible, l'appétit du marché pour les actions. Les risques de récession qui inquiètent les investisseurs ne sont cependant pas totalement infondés. Même en Chine, la reprise économique par exemple, est plus lente et plus laborieuse que prévu.

Parmi les poids lourds défensifs, les actions de Roche et de Nestlé ont connu des difficultés, tandis que Novartis a progressé. Dans le secteur industriel, Holcim et ABB ont été recherchées. Au milieu du mois, les actions du groupe de logistique Kühne+Nagel ont remplacé les celles du Crédit Suisse dans l'indice SMI.

Information générales

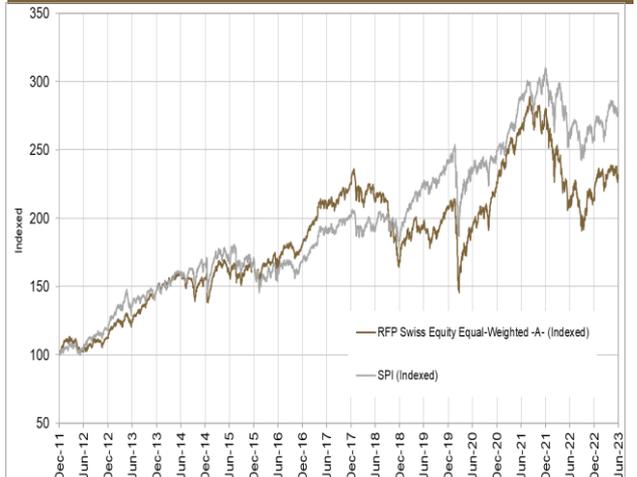
Structure juridique	Fonds de droit suisse		
Catégorie	"Fonds en valeurs mobilières"		
Transparence fiscale	En Allemagne et en Autriche		
Univers	Equity Switzerland - SPI		
Date de Lancement	27. Decembre 2005 (Change de strategie 15.11.2011)		
Benchmark	SPI - Swiss Performance Index		
Direction du fonds	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 177.54	CHF 182.14	CHF 188.94
Actifs sous-gestion mio.	CHF 91.13 (toutes les classes)		
TER (31.12.2021)	1.82%	1.27%	0.82%

Ratios (1YR)	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
Volatilité	15.96%	15.96%	15.96%	13.36%
Sharpe Ratio	0.60	0.63	0.66	0.61
Information Ratio	0.32	0.40	0.46	
Tracking Error	7.65%	7.65%	7.66%	
Alpha	0.02	0.03	0.03	
Beta	1.26	1.26	1.26	
Corrélation	0.91	0.91	0.91	

Performance	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
1 mois	0.21%	0.26%	0.29%	0.50%
3 mois	-0.06%	0.07%	0.18%	2.16%
6 mois	8.71%	9.00%	9.24%	8.20%
1 an	11.00%	11.61%	12.11%	7.43%
3 ans	20.77%	22.79%	24.45%	19.51%
5 ans	7.81%	10.83%	13.35%	43.91%
2023	8.71%	9.00%	9.24%	8.20%
2022	-23.56%	-23.14%	-22.79%	-16.48%
2021	23.73%	24.42%	24.99%	23.38%
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%

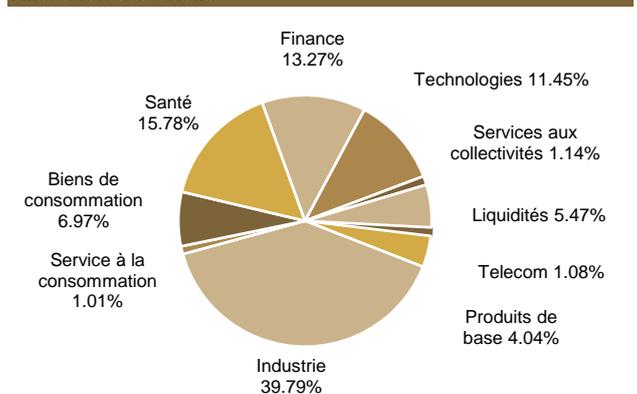
Performance



Allocation de portefeuille

Small Caps	24.96%	Actions	94.53%
Mid Caps	68.64%	Liquidités	5.47%
Large Caps	0.93%	Nb de positions	89

Allocation sectorielle



Contact

Rieter Fischer Partners AG	www.rf-partners.ch
Stockerstrasse 23	info@rf-partners.ch
8027 Zürich	Tel. +41 (0)43 305 07 20

Disclaimer: Ce document ne constitue pas une offre d'achat et n'est pas une recommandation d'acheter ou de vendre des parts du fonds. Ce document est uniquement destiné à des fins d'information. Il est sujet à changement et aucune assurance ni explicite ni implicite ou garantie d'aucune sorte n'est fournie concernant l'exactitude, la fiabilité ou l'exhaustivité de son contenu. Les données relatives aux performances ne tiennent pas compte des commissions ni des frais engagés lors de l'émission et du remboursement de parts. Selon la loi suisse sur les fonds de placements, le RFP Swiss Equity Equal-Weighted, appartient à la catégorie « fonds en valeurs mobilières ». L'attention de l'investisseur est explicitement attirée sur les risques décrits dans le Prospectus. Les investisseurs doivent être préparés et dans une situation financière leur permettant d'accepter – même de manière substantielle – des pertes liées au mouvement de prix. Les performances passées ne représentent ni un indicateur ni une garantie des performances futures. Ce document ne constitue pas un prospectus au sens de la loi suisse sur les sociétés et/ou sur le marché des capitaux. Les prospectus ainsi que les rapports sont disponibles auprès de Caceis (Suisse) SA, Nyon ainsi qu'auprès de Caceis Bank Switzerland Branch. En ce qui concerne les restrictions potentielles à la vente, un conseil indépendant sur les directives légales applicables dans chaque pays doit être recherché.