

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

Rapport mensuel du 31. Décembre 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

La tendance favorable prévalant sur le marché suisse des actions depuis fin octobre s'est maintenue jusqu'à la fin de l'année. Par la suite, l'indice SPI a enregistré une progression de 2.35%.

Les marchés sont confiants dans le fait que les banques centrales ont terminé leur cycle de hausse des taux d'intérêt et qu'un atterrissage en douceur de l'économie va continuer à stimuler les cours boursiers.

Outre le prestataire logistique Kühne+Nagel, ce sont surtout les sociétés liées à la construction, telles que Sika et Geberit, qui se sont distinguées avec des hausses à deux chiffres. Parmi les valeurs financières, les actions d'UBS ont fortement augmenté, tandis que les valeurs d'assurance ont été décevantes. Les valeurs défensives telles que Nestlé et Swisscom n'ont pas connu une hausse significative.

Information générales

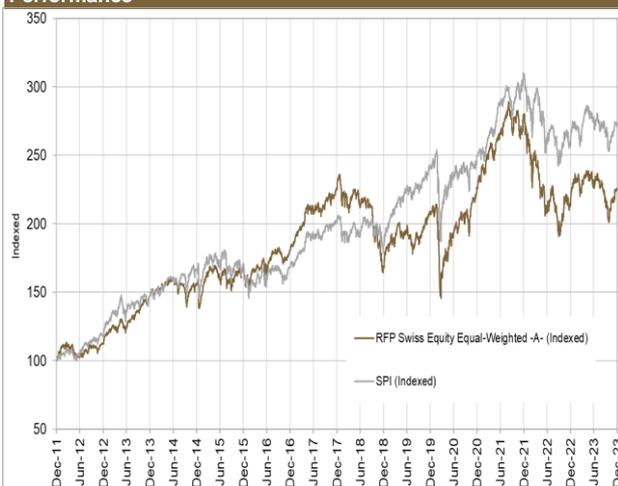
Structure juridique	Fonds de droit suisse		
Catégorie	"Fonds en valeurs mobilières"		
Transparence fiscale	En Allemagne et en Autriche		
Univers	Equity Switzerland - SPI		
Date de Lancement	27. Decembrer 2005 (Change de strategie 15.11.2011)		
Benchmark	SPI - Swiss Performance Index		
Direction du fonds	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 172.50	CHF 177.46	CHF 184.50
Actifs sous-gestion mio.	CHF 88.01 (toutes les classes)		
TER (31.12.2022)	1.85%	1.30%	0.85%

Ratios (1YR)	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
Volatilité	13.29%	13.29%	13.29%	11.01%
Sharpe Ratio	0.47	0.51	0.55	0.58
Information Ratio	n.a.	0.07	0.13	
Tracking Error	7.45%	7.45%	7.45%	
Alpha	n.a.	0.00	0.01	
Beta	1.05	1.05	1.05	
Corrélation	0.86	0.86	0.86	

Performance	Classe A	Classe B	Classe C	Indice
1 mois	2.73%	2.77%	2.81%	2.35%
3 mois	2.87%	3.01%	3.13%	1.41%
6 mois	-2.84%	-2.57%	-2.35%	-1.95%
1 an	5.62%	6.20%	6.67%	6.09%
3 ans	-0.10%	1.56%	2.94%	9.33%
5 ans	33.34%	37.07%	40.18%	48.23%
2023	5.62%	6.20%	6.67%	6.09%
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%

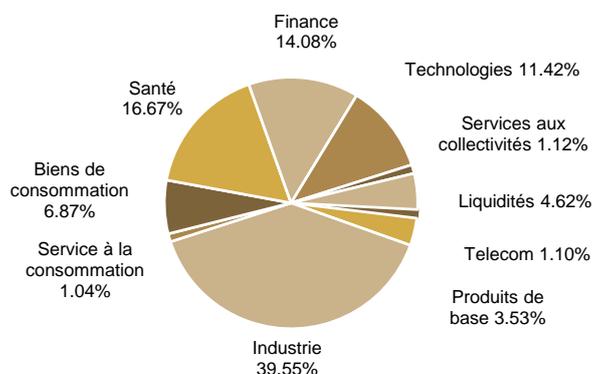
Performance



Allocation de portefeuille

Small Caps	25.06%	Actions	95.38%
Mid Caps	69.50%	Liquidités	4.62%
Large Caps	0.82%	Nb de positions	88

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