

# OLZ - Equity World Optimized ESG

Classe IH | pour investisseurs qualifiés



31.07.2024

A des fins de commercialisation

MSCI ESG Rating: AA

## Portrait du fonds

Le fonds de prévoyance investit dans les marchés actions organisés et développés dans le monde. L'accent est mis sur la liquidité, la durabilité (critères ESG: Environmental, Social et Governance) et une diversification optimale. La monnaie de référence est le CHF. Le risque de change est au maximum 20%. L'endettement, vendre à découvert et le prêt de titres sont interdits. Les placements suivent un processus structuré et rigoureux et se basent sur un modèle de variation minimale (minimum variance) qui vise à obtenir un ratio risque/rendement optimal par rapport à un modèle pondéré par la capitalisation sur un horizon à moyen ou à long terme, combiné avec une note ESG au-dessus de la moyenne.

## Fiche du fonds

|                             |                                      |
|-----------------------------|--------------------------------------|
| Date de lancement           | 24.10.2019                           |
| Nom du gestionnaire         | OLZ AG                               |
| Gérant basé à               | Berne                                |
| Direction du fonds          | UBS Fund Management (Switzerland) AG |
| Banque dépositaire          | UBS Switzerland 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            | Forward pricing (jour d'émission +1) |
| Benchmark (BM)              | MSCI World 85% hdq. to CHF (net)     |
| Encours total (en mio. CHF) | 75.05                                |

## Catégorie de parts

|                                  |              |
|----------------------------------|--------------|
| Monnaie de la catégorie de parts | CHF          |
| Code ISIN                        | CH0488209336 |
| N° de valeur                     | 48820933     |
| Code Bloomberg                   | OLZEW01 SW   |
| Valeur liquidative (NAV)         | 107.23       |
| Plus haut sur 1 an               | 107.23       |
| Plus bas sur 1 an                | 91.20        |

## Honoraires et frais

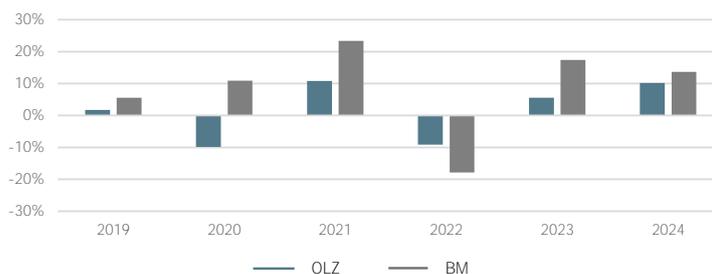
|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| OLZ Fee en % par an                   | 0.50 |
| TER ex ante en %                      | 0.59 |
| TER (au 31.08.2023) en %              | 0.65 |
| <b>Commission d'achat en %</b>        | rien |
| Commission de vente en %              | rien |
| Swing Pricing                         | Oui  |
| Swing Pricing facteur jusqu' à (en %) | 0.10 |

## Indicateurs de risques\*

|                       | Fonds  | BM     |
|-----------------------|--------|--------|
| Corrélation avec BM   | 0.84   | -      |
| Volatilité p.a. en %  | 10.73  | 16.65  |
| Sharpe Ratio          | 0.14   | 0.60   |
| Maximum drawdown en % | -18.11 | -22.54 |

\* 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 31.07.2024 en %

|       | 1 mois | 3 mois | 6 mois | 1 an  | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | p.a. depuis le lancement |
|-------|--------|--------|--------|-------|------------|------------|--------------------------|
| Fonds | 4.26   | 5.87   | 8.42   | 11.70 | 2.49       | -          | 1.45                     |
| BM    | 0.73   | 6.40   | 11.65  | 15.68 | 5.22       | -          | 9.93                     |

## Performance nette par année civile en %

|       | 2018 | 2019* | 2020  | 2021  | 2022   | 2023  | 2024 (YTD) |
|-------|------|-------|-------|-------|--------|-------|------------|
| Fonds | -    | 1.70  | -9.89 | 10.79 | -9.15  | 5.52  | 10.17      |
| BM    | -    | 5.52  | 10.89 | 23.31 | -17.87 | 17.36 | 13.63      |

\* 24.10.2019 - 31.12.2019

| Secteurs (en %)               | Fonds | BM   | Pays (en %) | Fonds | BM   |
|-------------------------------|-------|------|-------------|-------|------|
| Santé                         | 19.8  | 11.9 | États-Unis  | 21.6  | 71.7 |
| Finance                       | 17.7  | 15.4 | Japon       | 16.2  | 5.9  |
| Biens de Consom. de Base      | 16.0  | 6.4  | Canada      | 11.0  | 3.0  |
| Services de Communication     | 12.1  | 7.4  | Royaume-Uni | 11.0  | 3.8  |
| Industrie                     | 10.1  | 11.0 | Australie   | 8.2   | 1.9  |
| Matériaux                     | 5.8   | 3.7  | Suisse      | 7.6   | 2.5  |
| Consom. Discrétionnaire       | 4.6   | 10.1 | Singapour   | 6.4   | 0.3  |
| Immobilier                    | 3.8   | 2.2  | Hong Kong   | 3.8   | 0.4  |
| Technologies de l'Information | 3.4   | 25.0 | France      | 3.0   | 2.8  |
| Services aux Collectivités    | 3.0   | 2.6  | Pays-Bas    | 2.5   | 1.3  |
| Energie                       | 1.3   | 4.3  | Danemark    | 1.4   | 0.9  |
| Autres                        | 2.4   | 0.0  | Autres      | 7.3   | 5.4  |

## 10 positions principales

|                              | en % | Monnaies (en %) | Fonds | BM   |
|------------------------------|------|-----------------|-------|------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.4  | CHF             | 86.4  | 85.0 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 2.2  | USD             | 3.1   | 11.1 |
| GILEAD SCIENCES INC          | 2.1  | JPY             | 2.5   | 0.9  |
| SANOFI                       | 2.0  | CAD             | 1.7   | 0.5  |
| CSL LTD                      | 2.0  | GBP             | 1.6   | 0.6  |
| WALMART INC                  | 2.0  | AUD             | 1.3   | 0.3  |
| NINTENDO CO LTD              | 2.0  | EUR             | 1.2   | 1.3  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 1.9  | SGD             | 1.1   | 0.0  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 1.8  | HKD             | 0.5   | 0.1  |
| GSK PLC                      | 1.8  | Autres          | 0.6   | 0.3  |

## Rapports d'ESG\*

|                           | Fonds | BM   | ESG critères d'exclusion* | Fonds en % | BM en % |
|---------------------------|-------|------|---------------------------|------------|---------|
| MSCI ESG Score            | 7.6   | 6.9  | CCC - Rating              | 0.0        | 0.0     |
| MSCI ESG Rating           | AA    | A    | Controversy Red Flag      | 0.0        | 0.1     |
| CO2 Intensity Scope 1 & 2 | 45.1  | 98.5 | UN Global Compact: Fail   | 0.0        | 0.1     |

\* par dernier rééquilibrage (15.5.2024)

## ESG critères

|                         | Fonds en % | BM en % |
|-------------------------|------------|---------|
| CCC - Rating            | 0.0        | 0.0     |
| Controversy Red Flag    | 0.0        | 0.1     |
| UN Global Compact: Fail | 0.0        | 0.1     |

\* par dernier rééquilibrage (15.5.2024)

Réservé à des fins d'information et de marketing pour OLZ AG. Réservé aux investisseurs qualifiés. Fonds institutionnels OLZ de droit suisse. Avant d'investir dans un produit, veuillez lire le dernier prospectus en date avec la plus grande attention. Les contrats de fonds ainsi que les rapports annuels et semestriels peuvent être obtenus gratuitement auprès d'UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zurich ou d'UBS Fund Management (Switzerland) SA, case postale, CH-4002 Bâle, et de OLZ AG, Marktgasse 24, CH-3011 Bern, Tel. +41 (31) 326 80 00, www.olz.ch. Des informations supplémentaires peuvent être obtenues auprès de OLZ AG. La diffusion de ce document n'est autorisée qu'aux conditions stipulées dans le droit applicable. Ce document est fourni à titre d'information uniquement et ne constitue pas une invitation à soumettre une offre, à conclure un contrat, ni à acheter ou à vendre des titres ou des instruments financiers apparentés. Il se peut que les produits ou titres décrits dans le présent document soient inadaptés ou interdits à la vente dans diverses juridictions ou pour certains groupes d'investisseurs. Les informations et opinions exprimées dans ce document sont fournies sans aucune garantie; elles sont destinées à un usage personnel et à des fins informatives uniquement. La performance passée (simulée ou réelle) n'offre aucune garantie quant à l'évolution future. La performance représentée ne tient pas compte des commissions et frais éventuels prélevés lors de la souscription et du rachat de parts. Dans le cas où un produit financier ou une prestation financière sont libellés dans une monnaie autre que la monnaie de référence, il se peut que la performance augmente ou diminue en raison des fluctuations de change. Les informations ou les opinions peuvent changer à tout moment, sans notification préalable.