

Vescore Switzerland Risk Parity Index

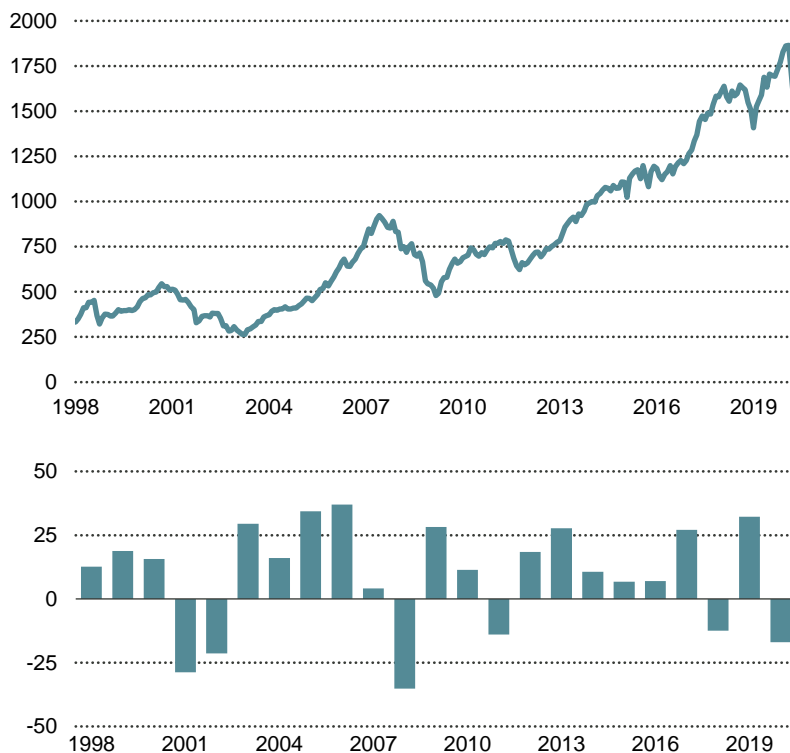
Metodologia di indicizzazione

Vescore Switzerland Risk Parity Index è parte integrante della Vescore Switzerland Index Series. Questa famiglia di indici offre all'investitore l'accesso a otto indici azionari diversi basati su un universo identico. Ogni indice adotta un metodo di ponderazione specifico.

L'universo Vescore Switzerland è definito con periodicità trimestrale in base alle 50 maggiori società quotate alla SIX Swiss Exchange. Le aziende legittimate a essere inserite nell'universo devono soddisfare determinati criteri minimi in ordine al volume di transazioni e al free float dei titoli.

I pesi delle componenti di Vescore Switzerland Risk Parity Index sono calcolati il giorno di adeguamento in modo che i contributi di rischio di ogni componente siano identici. Il rischio è dato dalla volatilità storica a sei e dodici mesi. Il peso massimo di un'azienda il giorno di adeguamento è pari al 10%.

Rendimento (in CHF, in %) ^{1 4}



Informazioni generali

Universo	Azioni svizzere
Numero di componenti	50 aziende
Emissione	31.12.2013
Valore iniziale	1'000
Dati storici dal	31.12.1997
Moneta dell'indice	CHF
Calcolatore dell'indice	Solactive AG
Versioni	Price / Net Total Return / Gross Total Return

Ticker Gross Total Return Index

Bloomberg	VESCHRP Index
Reuters	.VESCHRP
ISIN	DE000SLA0DK6

Metodologia di indicizzazione

Ponderazione	Rischio
Ribilanciamento	mar, giu, sett, dic
Metodo di calcolo	Laspeyre
Orario di calcolo	Ore 9.00 - 17.35 (CET)
Calcolo dell'indice	In tempo reale (15 sec.)
Regolamento dell'indice	vescore.com

Profilo di rischio/rendimento (in CHF) ^{1 4}

	1m	3m	1a	3a	5a	10a	dal 1997
Rendimento	-10.6%	-16.9%	-2.8%	12.9%	34.0%	107.9%	363.8%
Rendimento ann.	-	-	-2.8%	4.1%	6.0%	7.6%	7.1%
Volatilità ²	-	-	20.2%	15.2%	15.0%	14.8%	15.0%
Indice di Sharpe ³	-	-	-0.1	0.3	0.5	0.5	0.4
Drawdown max. ²	-	-	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-54.8%

Rendimenti e volatilità annui (in CHF) ^{1 4}

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
Rendimento	27.7%	10.7%	6.8%	7.0%	27.1%	-12.5%	32.2%	-16.9%
Volatilità ²	11.3%	10.6%	17.8%	15.7%	8.8%	13.8%	10.3%	-
Indice di Sharpe ³	2.4	1.0	0.4	0.5	3.2	-0.8	3.2	-

2/2 **Allocazione**

Principali 10 posizioni dell'indice

Nome	Settore	Ponderazione
Sunrise N	Telecomunicazioni	3.74%
PSP Swiss Property N	Finanza	3.64%
Banque Cantonale Vaudoise N	Finanza	3.61%
Swiss Prime Site N	Finanza	3.11%
Swisscom N	Telecomunicazioni	3.05%
BKW N	Servizi di pubblica utilità	2.89%
Emmi N	Beni di consumo	2.75%
Nestle N	Beni di consumo	2.69%
Barry Callebaut N	Beni di consumo	2.66%
Roche GS	Sanità	2.39%
Totale		30.52%

Allocazione settoriale

Settore	Numero di azioni	Ponderazione
Petrolio e gas	0	0.00%
Materie prime	3	6.02%
Industria	16	26.52%
Beni di consumo	8	14.31%
Sanità	8	14.64%
Servizi ai consumatori	1	0.73%
Telecomunicazioni	2	6.78%
Servizi di pubblica utilità	1	2.89%
Finanza	12	24.74%
Tecnologia	2	3.37%
Totale		100.00%

Il numero complessivo di azioni può essere superiore a 50, poiché alcune aziende possiedono più di una categoria di azioni.

Importante avvertenza legale: Il presente documento ha scopo unicamente informativo e non rappresenta una sollecitazione all'acquisto o alla vendita di un titolo né alla presentazione di un'offerta di acquisto o sottoscrizione. La performance storica non è un indicatore della performance corrente o futura. Il valore del denaro investito può aumentare o diminuire e non esiste alcuna garanzia che sia possibile riscattare l'intero capitale investito o parte dello stesso. Pur ritenendo che le informazioni contenute provengano da fonti attendibili, Vontobel Asset Management AG ("Vontobel") non può assumersi alcuna responsabilità in merito alla loro qualità, correttezza, attualità o completezza. Fatta eccezione per i casi consentiti dalla legge in vigore sui diritti d'autore, è fatto divieto di riprodurre, adattare, caricare su parti terze, collegare, inquadrare, pubblicare, distribuire o trasmettere queste informazioni in qualsiasi forma con qualsiasi processo senza lo specifico consenso scritto di Vontobel Asset Management SA («Vontobel»). Nella misura massima consentita dalla legge, Vontobel non sarà resa responsabile in alcun modo per eventuali perdite o danni subiti in seguito all'utilizzo o all'accesso a queste informazioni o a causa di un errore di Vontobel nel fornire queste informazioni. La nostra responsabilità per omissioni, violazioni contrattuali o infrazioni di qualsiasi legge come conseguenza di un nostro errore nel fornire queste informazioni o parte di esse, ovvero per qualsiasi problema connesso con queste informazioni, che non sia possibile escludere legittimamente, è limitata a nostra discrezione e nella misura massima consentita dalla legge, alla sostituzione delle presenti informazioni o parte di esse o al pagamento a voi per la sostituzione di queste informazioni o parti di esse. È vietata la distribuzione del presente documento o di copie dello stesso in giurisdizioni che non ne consentano legalmente la distribuzione. Le persone che ricevono il presente documento dovrebbero essere consapevoli di rispettare tali limitazioni. In particolare il presente documento non deve essere distribuito o consegnato a US Persons e non deve essere distribuito negli Stati Uniti.

Vescore Switzerland Indizes

Famiglia di indici

- Vescore Switzerland Cap Weighted Index
- Vescore Switzerland Equal Weighted Index
- Vescore Switzerland Accounting Based Index
- Vescore Switzerland Minimum Volatility Index
- Vescore Switzerland Risk Parity Index
- Vescore Switzerland Value Index
- Vescore Switzerland Momentum Index
- Vescore Switzerland Quality Index

Contatto

Visitate il nostro sito o contattateci direttamente per altre informazioni.

www.vescore.com
indexing@vescore.com

- 1 In base al Gross Total Return Index
- 2 In base ai valori giornalieri dell'indice
- 3 Calcolo in base al Libor in CHF a 1 mese
- 4 Fonte: Vontobel Asset Management. La performance storica non è un indicatore della performance corrente o futura.