

# Vescore Switzerland Risk Parity Index

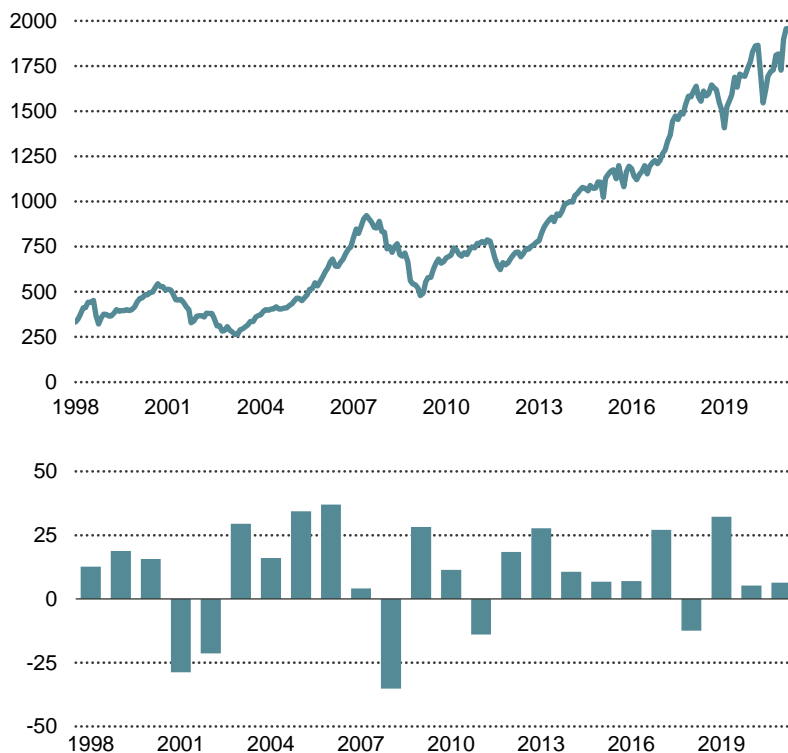
## Metodologia di indicizzazione

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 %) <sup>1 4</sup>



## Informazioni generali

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

## Ticker Gross Total Return Index

<b>Bloomberg</b>	VESCHRP Index
<b>Reuters</b>	.VESCHRP
<b>ISIN</b>	DE000SLA0DK6

## Metodologia di indicizzazione

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

## Profilo di rischio/rendimento (in CHF) <sup>1 4</sup>

	1m	3m	1a	3a	5a	10a	dal 1997
<b>Rendimento</b>	6.3%	6.4%	34.8%	33.9%	80.9%	171.5%	525.4%
<b>Rendimento ann.</b>	-	-	34.8%	10.2%	12.6%	10.5%	8.2%
<b>Volatilità <sup>2</sup></b>	-	-	15.2%	16.4%	14.6%	15.0%	15.1%
<b>Indice di Sharpe <sup>3</sup></b>	-	-	2.4	0.7	0.9	0.7	0.5
<b>Drawdown max. <sup>2</sup></b>	-	-	-7.6%	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-54.8%

## Rendimenti e volatilità annui (in CHF) <sup>1 4</sup>

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
<b>Rendimento</b>	10.7%	6.8%	7.0%	27.1%	-12.5%	32.2%	5.2%	6.4%
<b>Volatilità <sup>2</sup></b>	10.6%	17.8%	15.7%	8.8%	13.8%	10.3%	23.1%	-
<b>Indice di Sharpe <sup>3</sup></b>	1.0	0.4	0.5	3.2	-0.8	3.2	0.3	-

2/2 **Allocazione**

**Principali 10 posizioni dell'indice**

Nome	Settore	Ponderazione
Emmi N	Beni di consumo	3.47%
Swisscom N	Telecomunicazioni	3.42%
Nestle N	Beni di consumo	2.95%
Kuehne & Nagel Int N	Industria	2.84%
Barry Callebaut N	Beni di consumo	2.80%
Tecan Group AG N	Sanità	2.79%
Givaudan N	Materie prime	2.69%
PSP Swiss Property N	Finanza	2.57%
Swiss Prime Site N	Finanza	2.44%
STADLER RAIL	Industria	2.39%
<b>Totale</b>		<b>28.37%</b>

**Allocazione settoriale**

Settore	Numero di azioni	Ponderazione
Petrolio e gas	0	0.00%
Materie prime	3	6.36%
Industria	16	30.18%
Beni di consumo	8	14.87%
Sanità	9	17.20%
Servizi ai consumatori	0	0.00%
Telecomunicazioni	1	3.42%
Servizi di pubblica utilità	1	2.06%
Finanza	12	20.83%
Tecnologia	3	5.09%
<b>Totale</b>		<b>100.00%</b>

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](http://www.vescore.com)  
[indexing@vescore.com](mailto: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.