

# Vescore Switzerland Minimum Volatility Index

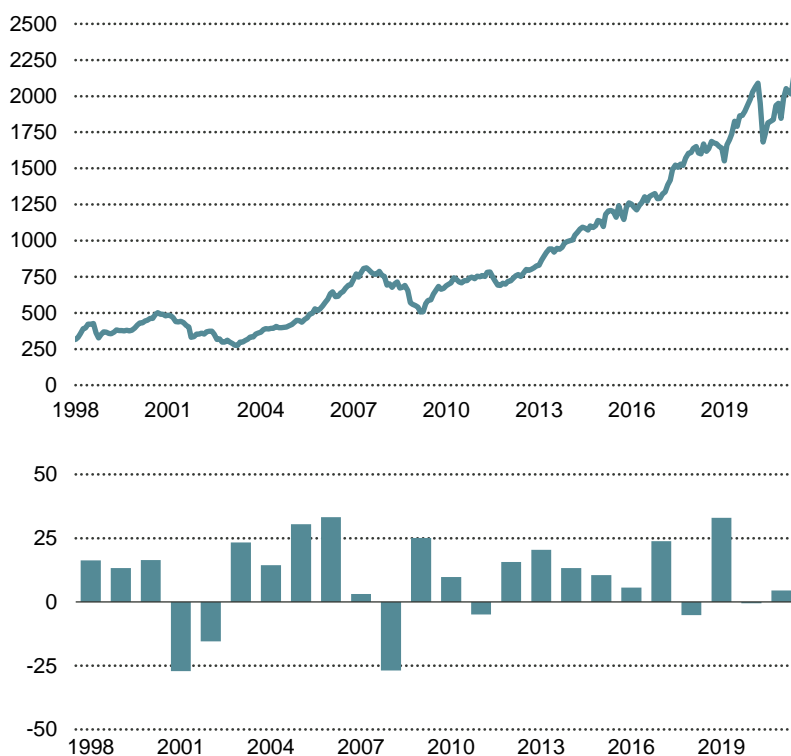
## Méthodologie indicielle

Le Vescore Switzerland Minimum Volatility Index fait partie de la Vescore Switzerland Index Series. Cette famille d'indices permet à l'investisseur d'avoir accès à huit indices actions différents, tous basés sur un même univers de placement. Chaque indice applique une méthode de pondération spécifique.

L'univers de placement pour la Suisse est adapté chaque trimestre et se compose des 50 plus grandes entreprises cotées à la SIX Swiss Exchange. Pour être incluses dans l'univers de placement, les entreprises doivent remplir des critères minimaux en lien avec les volumes de négoce et le flottant des titres.

Chaque trimestre, les pondérations des composantes de cet indice sont établies à la date de rebalancement donnée de sorte que le risque indiciel global i.e. la volatilité historique de six et douze mois soit minimisé. La pondération d'une entreprise à la date de rebalancement ne peut dépasser les 10%.

## Performance (en CHF, en %) <sup>1 4</sup>



## Informations générales

<b>Univers</b>	Actions suisses
<b>Nombre d'entreprises</b>	50 entreprises
<b>Lancement</b>	31.12.2013
<b>Valeur initiale</b>	1'000
<b>Historiques depuis le</b>	31.12.1997
<b>Devise indicielle</b>	CHF
<b>Calcul indiciel</b>	Solactive AG
<b>Versions</b>	prix / perform. totale nette / performance totale brute

## Ticker indice de performance totale brute

<b>Bloomberg</b>	VESCHMV Index
<b>Reuters</b>	.VESCHMVG
<b>ISIN</b>	DE000SLA0DG4

## Méthodologie indicielle

<b>Schéma de pondération</b>	minimisation du risque
<b>Adaptations indicielles</b>	mar, jui, sep, dic
<b>Méthode de calcul</b>	Laspeyre
<b>Période de calcul</b>	de 9h00 à 17h35 (CET)
<b>Calcul indiciel</b>	en temps réel (15 sec.)
<b>Règlement à l'indice</b>	vescore.com

## Aperçu du risque/rendement (en CHF) <sup>1 4</sup>

	1 m.	3 m.	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	depuis 1997
<b>Rendement</b>	6.4%	4.5%	27.5%	34.1%	72.2%	184.8%	579.8%
<b>Rendement ann.</b>	-	-	27.5%	10.2%	11.5%	11.0%	8.6%
<b>Volatilité <sup>2</sup></b>	-	-	14.0%	15.3%	13.5%	13.1%	12.9%
<b>Ratio de Sharpe <sup>3</sup></b>	-	-	2.0	0.7	0.9	0.9	0.6
<b>Perte maximale <sup>2</sup></b>	-	-	-7.7%	-33.1%	-33.1%	-33.1%	-48.9%

## Rendements et volatilités annuels (en CHF) <sup>1 4</sup>

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
<b>Rendement</b>	13.3%	10.6%	5.6%	23.8%	-5.2%	33.0%	-0.5%	4.5%
<b>Volatilité <sup>2</sup></b>	9.0%	15.7%	13.9%	8.1%	11.6%	8.8%	22.7%	-
<b>Ratio de Sharpe <sup>3</sup></b>	1.5	0.7	0.5	3.0	-0.4	3.8	0.0	-

2/2 **Allocation**

**10 principales positions de l'indice**

Nom	Secteur	Pondération
Nestle N	Biens de consommation	8.33%
Emmi N	Biens de consommation	7.84%
Swisscom N	Télécommunications	7.82%
Barry Callebaut N	Biens de consommation	6.50%
Swiss Prime Site N	Finance	4.70%
PSP Swiss Property N	Finance	4.51%
Banque Cantonale Vaudoise N	Finance	4.48%
Kuehne & Nagel Int N	Industrie	4.21%
Givaudan N	Matériaux de base	3.03%
STADLER RAIL	Industrie	2.89%
<b>Total</b>		<b>54.31%</b>

**Allocation sectorielle**

Secteur	Nombre d'actions	Pondération
Oil & Gas	0	0.00%
Basic Materials	3	5.72%
Industrials	16	26.23%
Consumer Goods	8	28.58%
Health Care	9	6.53%
Consumer Services	0	0.00%
Telecommunications	1	7.82%
Utilities	1	1.69%
Financials	12	21.75%
Technology	3	1.68%
<b>Total</b>		<b>100.00%</b>

Le nombre total d'actions peut être supérieur à 50 car certaines entreprises possèdent plusieurs types d'actions.

**Remarques juridiques importantes:** Le présent document a été conçu uniquement à des fins d'information et ne constitue ni une incitation à l'achat ou à la vente de titres, ni une incitation à la remise d'une offre d'achat ou de souscription. La performance historique ne saurait préjuger des résultats actuels ou futurs. La valeur des devises d'investissement peut augmenter ou diminuer et il n'y a aucune garantie de remboursement de l'intégralité ou d'une partie du capital investi. Bien que Vontobel Asset Management AG («Vontobel ») soit d'avis que les informations figurant dans le présent document s'appuient sur des sources fiables, Vontobel décline toute responsabilité quant à la qualité, l'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité desdites informations. Sauf autorisation émanant des lois de droits d'auteur, aucune de ces informations ne pourra être reproduite, adaptée, téléchargée pour une tierce partie, reliée, mise en exergue, publiée, distribuée ou transmise sous quelque forme que ce soit par quelque processus que ce soit sans le consentement écrit spécifique de Vontobel. Dans toute la mesure permise par la législation applicable, Vontobel décline toute responsabilité résultant de toute perte ou de tout dommage que vous encourez occasionné(e) par l'utilisation ou l'accès aux présentes informations, ou de son incapacité à fournir les présentes informations. Notre responsabilité pour négligence, violation contractuelle ou contravention à la loi résultant de notre incapacité à fournir les présentes informations dans leur intégralité ou en partie, ou pour tout problème posé par ces informations, qui ne peut être licitement exclu, se limite à la retransmission des présentes informations en intégralité ou en partie ou au paiement pour assurer cette retransmission, à notre gré et dans la mesure autorisée par la loi en vigueur. Aucun exemplaire du présent document ni aucune copie de celui-ci ne peuvent être distribués dans toute juridiction où sa distribution est limitée par la loi. Les personnes recevant le présent document doivent être conscientes de ces restrictions et les accepter. Ce document en particulier ne doit être ni distribué ni remis à des personnes américaines ni être distribué aux Etats-Unis.

**Vescore Switzerland Indices**

**Famille d'indices**

- 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

**Contact**

Pour de plus amples informations, veuillez consulter notre site Internet ou prendre directement contact avec nous.

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

- 1 Basé sur l'indice de performance totale brute
- 2 Basé sur des valeurs indicielles quotidiennes
- 3 Basé sur le taux Libor CHF à 1 mois
- 4 Source: Vontobel Asset Management. La performance historique ne saurait préjuger des résultats actuels ou futurs.