

Vescore Switzerland Accounting Based Index

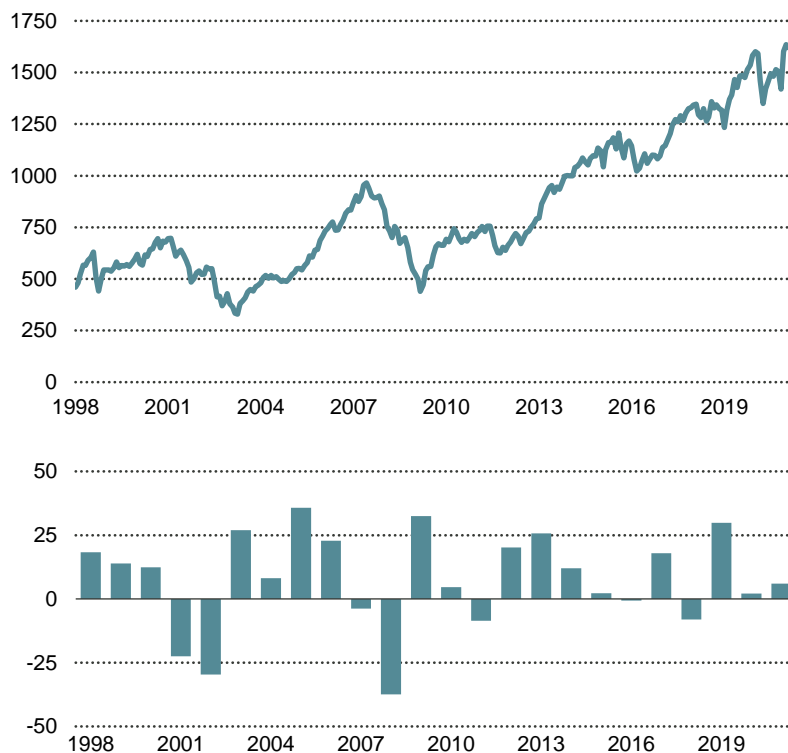
Méthodologie indicielle

Le Vescore Switzerland Accounting Based 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 fixée en fonction de la valeur absolue de quatre données fondamentales (valeur comptable, bénéfices, chiffres d'affaires et dividendes). Pour lesdites données (à l'exception de la valeur comptable), la moyenne sur les trois dernières années est utilisée.

Performance (en CHF, en %) ^{1 4}



Informations générales

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

Ticker indice de performance totale brute

Bloomberg	VESCHAB Index
Reuters	.VESCHABG
ISIN	DE000SLA0DD1

Méthodologie indicielle

Schéma de pondération	basé sur les fondamentaux
Adaptations indicielles	mar, jui, sep, dic
Méthode de calcul	Laspeyre
Période de calcul	de 9h00 à 17h35 (CET)
Calcul indiciel	en temps réel (15 sec.)
Règlement à l'indice	vescore.com

Aperçu du risque/rendement (en CHF) ^{1 4}

	1 m.	3 m.	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	depuis 1997
Rendement	5.9%	6.0%	28.4%	35.2%	67.1%	137.3%	277.0%
Rendement ann.	-	-	28.4%	10.6%	10.8%	9.0%	5.9%
Volatilité ²	-	-	16.2%	17.2%	15.3%	15.9%	19.5%
Ratio de Sharpe ³	-	-	1.8	0.7	0.8	0.6	0.3
Perte maximale ²	-	-	-10.2%	-30.1%	-30.1%	-30.1%	-59.9%

Rendements et volatilités annuels (en CHF) ^{1 4}

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Rendement	12.0%	2.2%	-0.7%	18.0%	-8.1%	29.8%	2.1%	6.0%
Volatilité ²	10.7%	19.2%	17.0%	8.9%	13.8%	10.3%	24.7%	-
Ratio de Sharpe ³	1.1	0.2	0.0	2.1	-0.5	3.0	0.1	-

2/2 **Allocation**

10 principales positions de l'indice

Nom	Secteur	Pondération
Nestle N	Biens de consommation	15.34%
Roche GS	Santé	12.52%
Novartis N	Santé	11.40%
Zurich Insurance N	Finance	7.04%
UBS Group N	Finance	6.88%
Swiss Re N	Finance	4.09%
ABB N	Industrie	4.02%
LafargeHolcim N	Industrie	3.70%
CS Group N	Finance	3.69%
Richemont N	Biens de consommation	2.55%
Total		71.23%

Allocation sectorielle

Secteur	Nombre d'actions	Pondération
Oil & Gas	0	0.00%
Basic Materials	3	2.04%
Industrials	16	16.94%
Consumer Goods	8	20.63%
Health Care	9	27.51%
Consumer Services	0	0.00%
Telecommunications	1	2.28%
Utilities	1	0.43%
Financials	12	29.33%
Technology	3	0.85%
Total		100.00%

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
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.