

Vescore Switzerland Risk Parity Index

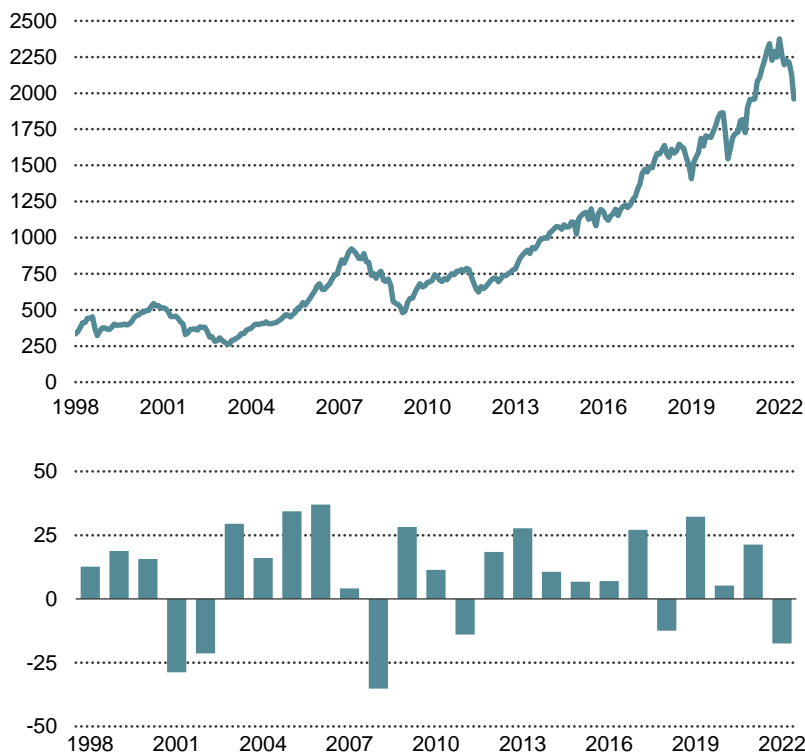
Méthodologie indicielle

Le Vescore Switzerland Risk Parity 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 chacune d'entre elles contribue équitablement au risque. Le risque est ici défini comme étant la volatilité historique de six et douze mois. La pondération d'une entreprise à la date de rebalancement ne peut dépasser les 10%.

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	VESCHRP Index
Reuters	.VESCHRP
ISIN	DE000SLA0DK6

Méthodologie indicielle

Schéma de pondération	pondéré selon le risque
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	-8.1%	-12.0%	-12.1%	14.9%	34.7%	175.2%	488.1%
Rendement ann.	-	-	-12.1%	4.7%	6.1%	10.6%	7.5%
Volatilité ²	-	-	15.8%	17.2%	15.3%	14.4%	15.0%
Ratio de Sharpe ³	-	-	-0.7	0.3	0.5	0.8	0.5
Perte maximale ²	-	-	-19.4%	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-54.8%

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

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Rendement	6.8%	7.0%	27.1%	-12.5%	32.2%	5.2%	21.3%	-17.5%
Volatilité ²	17.8%	15.7%	8.8%	13.8%	10.3%	23.1%	10.4%	-
Ratio de Sharpe ³	0.4	0.5	3.2	-0.8	3.2	0.3	2.1	-

2/2 **Allocation**

10 principales positions de l'indice

Nom	Secteur	Pondération
Swisscom N	Télécommunications	8.00%
Banque Cantonale Vaudoise N	Finance	3.35%
Novartis N	Santé	3.06%
PSP Swiss Property N	Finance	2.98%
Barry Callebaut N	Biens de consommation	2.76%
Swiss Prime Site N	Finance	2.73%
DKSH N	Industrie	2.64%
Nestle N	Biens de consommation	2.57%
Roche GS	Santé	2.53%
Emmi N	Biens de consommation	2.45%
Total		33.04%

Allocation sectorielle

Secteur	Nombre d'actions	Pondération
Oil & Gas	0	0.00%
Basic Materials	3	5.21%
Industrials	18	28.84%
Consumer Goods	8	12.67%
Health Care	9	14.99%
Consumer Services	0	0.00%
Telecommunications	1	8.00%
Utilities	1	2.31%
Financials	12	25.21%
Technology	2	2.78%
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.