

# Vescore Switzerland Risk Parity Index

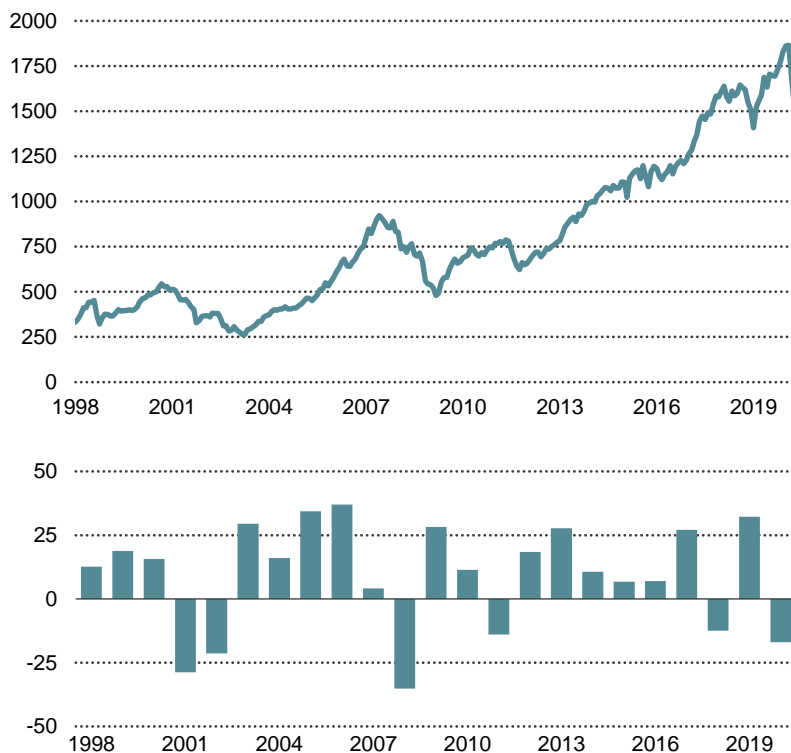
## Indexmethodik

Der Vescore Switzerland Risk Parity Index ist Bestandteil der Vescore Switzerland Index Series. Diese Indexfamilie bietet den Investoren Zugang zu acht unterschiedlichen Aktienindizes auf einem identischen Universum. Jeder Index wendet dabei eine spezifische Gewichtungsmethodik an.

Das Vescore Switzerland Universum bestimmt sich quartalsweise aus den 50 grössten an der SIX Swiss Exchange kotierten Unternehmen. Die zur Aufnahme in das Universum berechtigten Unternehmen müssen Minimumkriterien bezüglich Handelsvolumen und dem Free Float der Wertschriften erfüllen.

Die Gewichte der Indexmitglieder des Vescore Switzerland Risk Parity Index werden am quartalsweisen Anpassungstag so festgelegt, dass die Risikobeiträge jedes Indexmitgliedes identisch sind. Das Risiko wird definiert als die historische sechs und zwölf Monats-Volatilität. Das Maximalgewicht eines Unternehmens am Anpassungstag beträgt 10%.

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



## Allgemeine Informationen

<b>Universum</b>	Aktien Schweiz
<b>Anzahl Mitglieder</b>	50 Unternehmen
<b>Lancierung</b>	31.12.2013
<b>Startwert</b>	1'000
<b>Historie ab</b>	31.12.1997
<b>Indexwährung</b>	CHF
<b>Indexberechner</b>	Solactive AG
<b>Versionen</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

## Indexmethodik

<b>Gewichtungsschema</b>	Risikogewichtet
<b>Indexanpassungen</b>	Mär, Jun, Sep, Dez
<b>Berechnungsmethode</b>	Laspeyre
<b>Berechnungszeiten</b>	9:00 bis 17:35 Uhr (MEZ)
<b>Indexberechnung</b>	Real-Time (15 sec.)
<b>Indexreglement</b>	vescore.com

## Risiko-/Rendite-Übersicht (in CHF) <sup>1 4</sup>

	1M	3M	1J	3J	5J	10J	seit 1997
<b>Rendite</b>	-10.6%	-16.9%	-2.8%	12.9%	34.0%	107.9%	363.8%
<b>Rendite ann.</b>	-	-	-2.8%	4.1%	6.0%	7.6%	7.1%
<b>Volatilität <sup>2</sup></b>	-	-	20.2%	15.2%	15.0%	14.8%	15.0%
<b>Sharpe Ratio <sup>3</sup></b>	-	-	-0.1	0.3	0.5	0.5	0.4
<b>Max. Drawdown <sup>2</sup></b>	-	-	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-54.8%

## Jährliche Renditen und Volatilitäten (in CHF) <sup>1 4</sup>

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
<b>Rendite</b>	27.7%	10.7%	6.8%	7.0%	27.1%	-12.5%	32.2%	-16.9%
<b>Volatilität <sup>2</sup></b>	11.3%	10.6%	17.8%	15.7%	8.8%	13.8%	10.3%	-
<b>Sharpe Ratio <sup>3</sup></b>	2.4	1.0	0.4	0.5	3.2	-0.8	3.2	-

2/2 **Aktuelle Positionierung**

**Grösste 10 Indexpositionen**

Name	Sektor	Gewicht
Sunrise N	Telecommunications	3.74%
PSP Swiss Property N	Financials	3.64%
Banque Cantonale Vaudoise N	Financials	3.61%
Swiss Prime Site N	Financials	3.11%
Swisscom N	Telecommunications	3.05%
BKW N	Utilities	2.89%
Emmi N	Consumer Goods	2.75%
Nestle N	Consumer Goods	2.69%
Barry Callebaut N	Consumer Goods	2.66%
Roche GS	Health Care	2.39%
<b>Gesamt</b>		<b>30.52%</b>

**Sektor Allokation**

Sektor	Anzahl Aktien	Gewicht
Oil & Gas	0	0.00%
Basic Materials	3	6.02%
Industrials	16	26.52%
Consumer Goods	8	14.31%
Health Care	8	14.64%
Consumer Services	1	0.73%
Telecommunications	2	6.78%
Utilities	1	2.89%
Financials	12	24.74%
Technology	2	3.37%
<b>Gesamt</b>		<b>100.00%</b>

Die gesamte Aktienanzahl kann grösser als 50 sein, da einige Unternehmen mehr als eine Aktienart besitzen.

**Wichtige rechtliche Hinweise:** Dieses Dokument dient nur zu Informationszwecken und ist weder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren, noch zur Abgabe eines Kauf- oder Zeichnungsangebots. Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Der Wert des angelegten Kapitals kann steigen oder fallen. Für die vollständige oder teilweise Rückzahlung des angelegten Kapitals gibt es keine Garantie. Obwohl Vontobel Asset Management AG ("Vontobel") der Meinung ist, dass die hierin enthaltenen Angaben auf verlässlichen Quellen beruhen, kann Vontobel keinerlei Gewährleistung für die Qualität, Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der in diesem Dokument enthaltenen Informationen übernehmen. Ausser soweit im Rahmen der anwendbaren Urheberrechtsgesetze vorgesehen, darf die hier wiedergegebene Information ohne die ausdrückliche Zustimmung von Vontobel weder in Teilen noch in ihrer Gesamtheit wiederverwendet, angepasst, einer Drittpartei zur Verfügung gestellt, verlinkt, veröffentlicht, aufgeführt, weiterverbreitet oder in anderer Art und Weise übermittelt werden. Vontobel lehnt, soweit gemäss dem geltenden Recht möglich, jegliche Haftung für direkte oder indirekte Schäden oder Verluste ab, die sich aus den hier zur Verfügung gestellten Informationen oder deren Fehlen ergeben. Haftungsansprüche, die infolge unterlassener oder unvollständiger Übermittlung dieser Informationen oder allfälliger Probleme mit diesen Informationen wegen Fahrlässigkeit, Vertragsbruch oder Gesetzesverstössen gegen uns geltend gemacht werden könnten, beschränken sich nach unserem Ermessen und soweit gesetzlich zulässig auf die erneute Bereitstellung dieser Informationen beziehungsweise eines Teils davon beziehungsweise auf die Zahlung eines dem Aufwand für die Beschaffung dieser Informationen oder eines Teils davon entsprechenden Geldbetrages. Weder dieses Dokument noch Kopien davon dürfen in Ländern zur Verfügung gestellt oder Personen in solchen Ländern zugänglich gemacht werden, wo dies aufgrund der geltenden Gesetze verboten ist. Personen, denen dieses Dokument zur Verfügung gestellt wird, sind verpflichtet, sich über solche Einschränkungen kundig zu machen und die lokalen Gesetze zu befolgen. Insbesondere darf dieses Dokument weder US-Personen zur Verfügung gestellt oder diesen ausgehändigt noch in den USA verbreitet werden.

**Vescore Switzerland Indizes**

**Indexfamilie**

- 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

**Kontakt**

Bitte besuchen Sie unsere Homepage oder kontaktieren Sie uns direkt für weitere Informationen.

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

- 1 Basierend auf dem Gross Total Return Index
- 2 Basierend auf täglichen Indexwerten
- 3 Berechnung unter Verwendung des 1-Monats-Libor CHF
- 4 Quelle: Vontobel Asset Management. Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar