

Vescore Switzerland Risk Parity Index

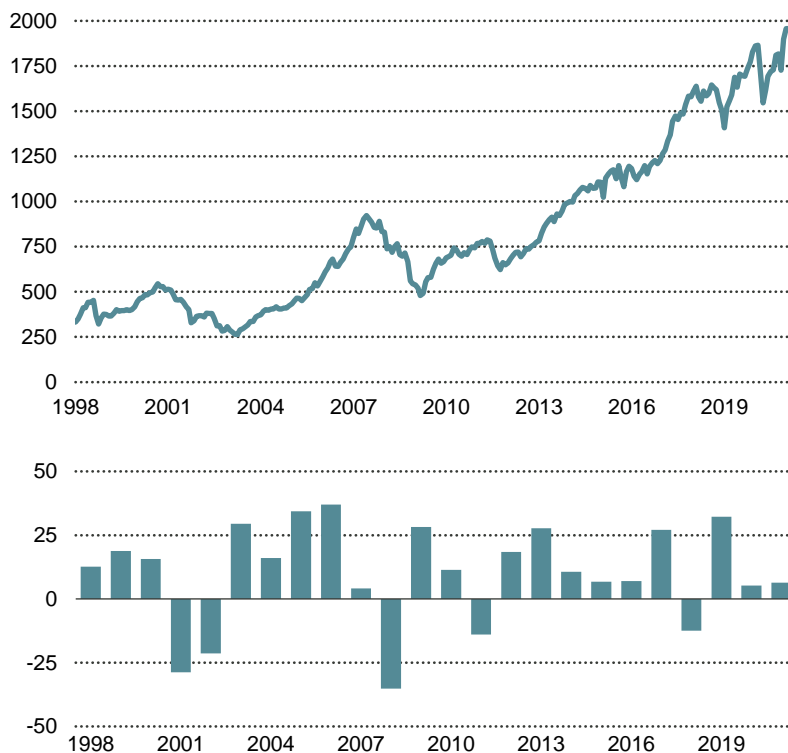
Indexmethodik

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 %) ^{1 4}



Allgemeine Informationen

Universum	Aktien Schweiz
Anzahl Mitglieder	50 Unternehmen
Lancierung	31.12.2013
Startwert	1'000
Historie ab	31.12.1997
Indexwährung	CHF
Indexberechner	Solactive AG
Versionen	Price / Net Total Return / Gross Total Return

Ticker Gross Total Return Index

Bloomberg	VESCHRP Index
Reuters	.VESCHRP
ISIN	DE000SLA0DK6

Indexmethodik

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

Risiko-/Rendite-Übersicht (in CHF) ^{1 4}

	1M	3M	1J	3J	5J	10J	seit 1997
Rendite	6.3%	6.4%	34.8%	33.9%	80.9%	171.5%	525.4%
Rendite ann.	-	-	34.8%	10.2%	12.6%	10.5%	8.2%
Volatilität ²	-	-	15.2%	16.4%	14.6%	15.0%	15.1%
Sharpe Ratio ³	-	-	2.4	0.7	0.9	0.7	0.5
Max. Drawdown ²	-	-	-7.6%	-30.6%	-30.6%	-30.6%	-54.8%

Jährliche Renditen und Volatilitäten (in CHF) ^{1 4}

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Rendite	10.7%	6.8%	7.0%	27.1%	-12.5%	32.2%	5.2%	6.4%
Volatilität ²	10.6%	17.8%	15.7%	8.8%	13.8%	10.3%	23.1%	-
Sharpe Ratio ³	1.0	0.4	0.5	3.2	-0.8	3.2	0.3	-

2/2 **Aktuelle Positionierung**

Grösste 10 Indexpositionen

Name	Sektor	Gewicht
Emmi N	Consumer Goods	3.47%
Swisscom N	Telecommunications	3.42%
Nestle N	Consumer Goods	2.95%
Kuehne & Nagel Int N	Industrials	2.84%
Barry Callebaut N	Consumer Goods	2.80%
Tecan Group AG N	Health Care	2.79%
Givaudan N	Basic Materials	2.69%
PSP Swiss Property N	Financials	2.57%
Swiss Prime Site N	Financials	2.44%
STADLER RAIL	Industrials	2.39%
Gesamt		28.37%

Sektor Allokation

Sektor	Anzahl Aktien	Gewicht
Oil & Gas	0	0.00%
Basic Materials	3	6.36%
Industrials	16	30.18%
Consumer Goods	8	14.87%
Health Care	9	17.20%
Consumer Services	0	0.00%
Telecommunications	1	3.42%
Utilities	1	2.06%
Financials	12	20.83%
Technology	3	5.09%
Gesamt		100.00%

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
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