



Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®

Produktdetails			
Name	ISIN	Valorennummern	Kurs [per 31.10.2013]
Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®	CH0113557489	11355748	1'302,41

Strategie

Der Scoach Yield Enhancement Index SCOY® repliziert das Segment der Renditeoptimierungsprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich bei seitwärts tendierenden Märkten durch Couponzahlungen und Discounts auszeichnen.

Marktanalyse

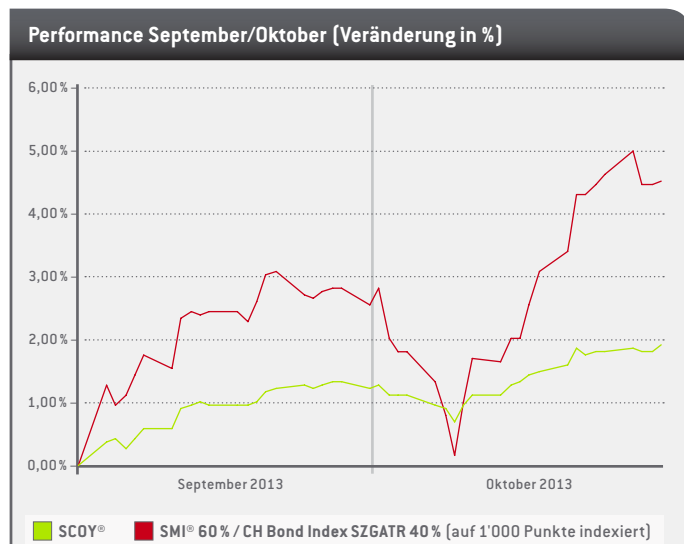
Im Gegensatz zu den zwei anderen Indexstrategien, entwickelte sich der Scoach Renditeoptimierungsindex SCOY® unterhalb der Benchmark. Die Cap-Charakteristik, die zu günstigen Kaufkonditionen führt, limitierte das Gewinnpotential des Portfolios. Nichtsdestotrotz bleibt die Risikocharakteristik des SCOY® mit einer 60 Tage historischen Volatilität von 1,87 % und einer durchschnittlichen Risikoklasse von 2,15 weiterhin attraktiv.

Auswahlkriterien

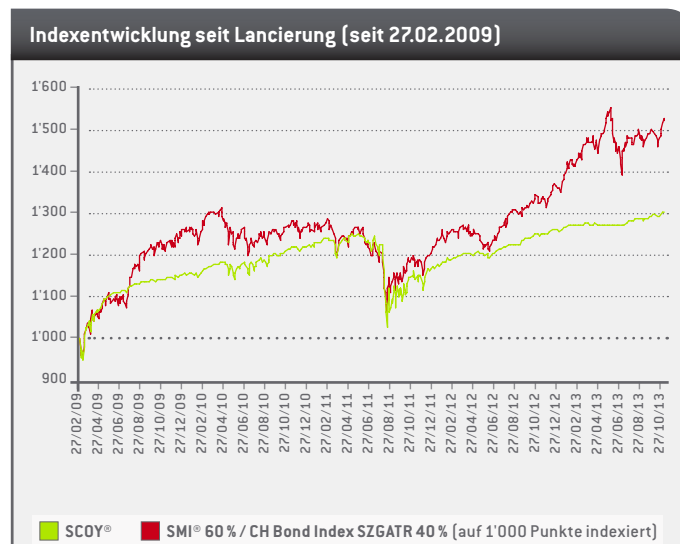
Der Scoach Yield Enhancement Index SCOY® basiert auf den besten typischen Renditeoptimierungsprodukten auf den SMI®. Die Zusammensetzung wird alle zwei Monate überprüft und gegebenenfalls gemäss Regelwerk angepasst.

Performance in Zahlen			
Zeitraum	SCOY®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	1,91 %	4,49 %	-2,58 %
Year to date	3,77 %	12,59 %	-8,81 %
Seit Lancierung 27.02.2009	30,24 %	51,70 %	-21,46 %

Zusammensetzung Index per 01.11.2013				
ISIN	Coupon (p. a.) in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP Bezeichnung
CH0115176734	2,42	Credit Suisse	06.08.14	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0115602853	2,18	Credit Suisse	13.08.14	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0206185941	4,35	Bank Vontobel	26.06.15	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0206181858	0,7	Bank Vontobel	21.05.14	Reverse Convertible (1220)
CH0222768282	-	UBS	05.09.15	Discount Certificate (1200)
CH0222768290	-	UBS	05.09.14	Discount Certificate (1200)
CH0222768308	-	UBS	05.09.14	Discount Certificate (1200)



Derivative Partners Research, November 2013



Derivative Partners Research, November 2013

Benchmark

Um den Renditeoptimierungsindex mit einem adäquaten Benchmark vergleichen zu können, wurde ein neuer, fiktiver Index zusammengestellt. Dieser Referenzindex besteht aus einem Aktienanteil von 60 % des SMI® und einem Obligationenanteil von 40 % eines Total Return Index aller Schweizer Obligationen von Bloomberg (Bloomberg Code: SZGATR). Diese Zusammensetzung entspricht in etwa der Struktur von Renditeoptimierungsprodukten.

Weitere Kennzahlen			
Datum	Hist. Volatilität (60 Tage)	Hist. Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
31. Okt 13	1,87 %	6,44 %	2,15
31. Aug 13	1,91 %	7,83 %	1,51
30. Jun 13	0,55 %	14,62 %	1,61
30. Apr 13	0,45 %	8,99 %	1,58
28. Feb 13	1,32 %	9,07 %	1,62
31. Dez 12	1,66 %	6,50 %	1,65
31. Okt 12	2,45 %	6,39 %	2,10
31. Aug 12	1,68 %	5,97 %	2,01
30. Jun 12	2,78 %	6,94 %	2,39
30. Apr 12	2,33 %	7,25 %	2,15
29. Feb 12	3,70 %	7,00 %	2,34
31. Dez 11	3,21 %	8,95 %	2,61
31. Okt 11	17,96 %	15,37 %	3,15
31. Aug 11	25,97 %	17,76 %	3,43
30. Jun 11	5,60 %	7,73 %	2,81
31. Mär 11	6,11 %	9,37 %	2,44
28. Feb 11	3,16 %	7,01 %	2,14

Dieses Factsheet enthält periodisch aktualisierte, ergänzende Informationen und Angaben zu den Scoach Schweiz Strategie-Indizes. Die Indizes wurden in Zusammenarbeit mit Derivative Partners Research AG berechnet. Aus den Scoach Schweiz Strategie-Indizes ergibt sich keine Aufforderung zum Kaufen oder Verkaufen von Wertpapieren. SIX Swiss Exchange, Scoach Schweiz AG und Derivative Partners Research AG lehnen jegliche Haftung für Schäden, die aus der Verwendung der Scoach Schweiz Strategie-Indizes entstehen, ab. SCOP®, SCOY® und SCOC® sind eingetragene Marken der Scoach Schweiz AG.