



Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs [per 31.10.2011]
Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®	CH0113557489	11355748	1'158,49

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

Der Scoach Yield Enhancement Index konnte in den letzten zwei Monaten gegenüber seinem Benchmark ein wenig zulegen und schloss mit einem Plus von 2,86 %. Ein Blick auf die Entwicklung seit Emission des SCOY® zeigt deutlich, dass der Index besonders in seitwärts tendierenden Märkten besser abschneidet als der Benchmark. Zudem können leichte Kursverluste abgefedert werden. Gleichzeitig aber hinkt der Index bei einem starken Anstieg des Basiswertes hinterher. Nebst einem leichten Anstieg des Basiswerts konnte der SCOY® auch von einer sinkenden Volatilität profitieren.

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.

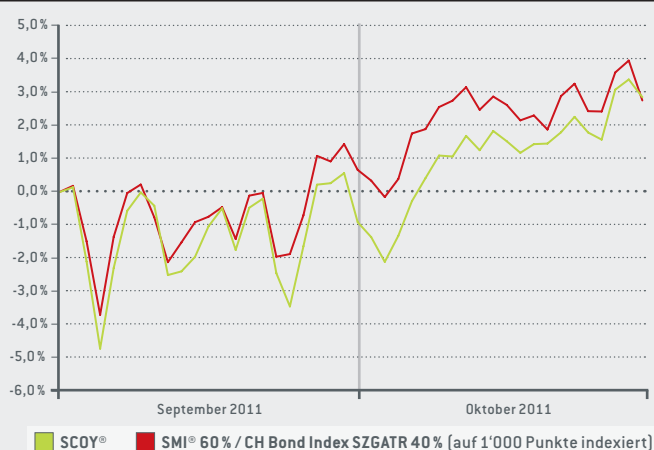
Performance in Zahlen

Zeitraum	SCOY®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,86 %	2,76 %	0,10 %
Year to date	-4,85 %	-5,11 %	0,26 %
Seit Lancierung 27.02.2009	15,85 %	18,84 %	-2,99 %

Zusammensetzung Index – 01.11.2011

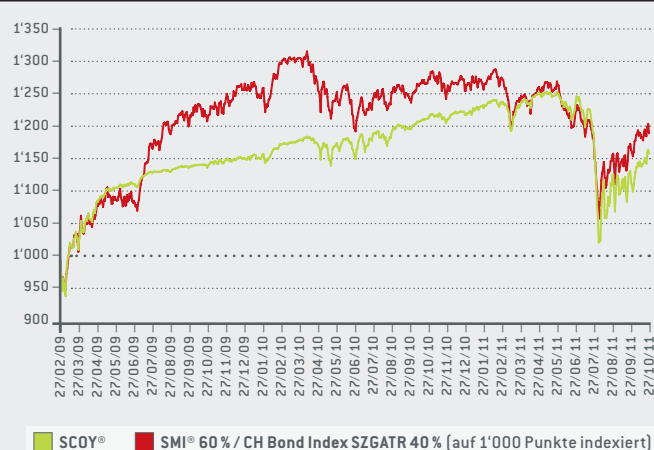
ISIN	Coupon [p. a.] in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP Bezeichnung
CH0124909448	n.a.	Basler Kantonalbank	17.08.12	Discount-Zertifikat [1200]
CH0132038545	n.a.	Bank Vontobel	22.08.12	Discount-Zertifikat [1200]
CH0132497550	n.a.	EFG Financial Products	30.03.12	Discount-Zertifikat [1200]
CH0115602853	2,18	Clariden Leu	13.08.14	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0119531801	2,92	Clariden Leu	16.11.12	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0132286250	5	Clariden Leu	21.09.12	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0137714371	8,21	Bank Vontobel	26.10.12	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0137714538	7,43	Bank Vontobel	26.10.12	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0138027237	3,5	UBS	23.09.11	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0139212341	5,5	EFG Financial Products	25.10.12	Barrier Reverse Convertible [1230]

Performance September / Oktober (Veränderung in %)



Derivative Partners Research, November 2011

Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)



Derivative Partners Research, November 2011

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 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. Mrz 11	6,11%	9,37%	2,44
28. Feb 11	3,16%	7,01%	2,14
31. Dez 10	2,71%	8,23%	2,38
31. Okt 10	2,68%	6,37%	2,73
31. Aug 10	6,66%	9,35%	2,88
30. Jun 10	7,68%	12,84%	2,59
30. Apr 10	2,05%	7,26%	1,78
28. Feb 10	3,35%	8,99%	1,55
31. Dez 09	2,59%	8,92%	1,21
31. Okt 09	1,02%	8,86%	1,27

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.