



## Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®

### Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 30.06.2010)
Scoach Switzerland Yield Enhancement Index – SCOY®	CH0113557489	11355748	1165,12

### 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.

### 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.

### Marktanalyse

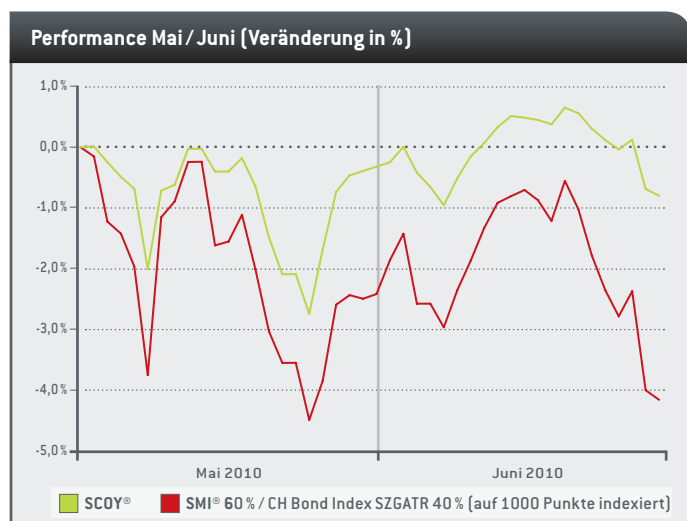
Beim Scoach Yield Enhancement Index war keine klare Tendenz ersichtlich. So schloss der Index knapp unter dem Anfangswert der Beobachtungsperiode. Klar zu erkennen ist jedoch, dass die Produkte unter dem starken Druck der Basiswerte litten. Ebenfalls drückte die steigende, implizite Volatilität auf die entsprechenden Preise.

### Performance in Zahlen

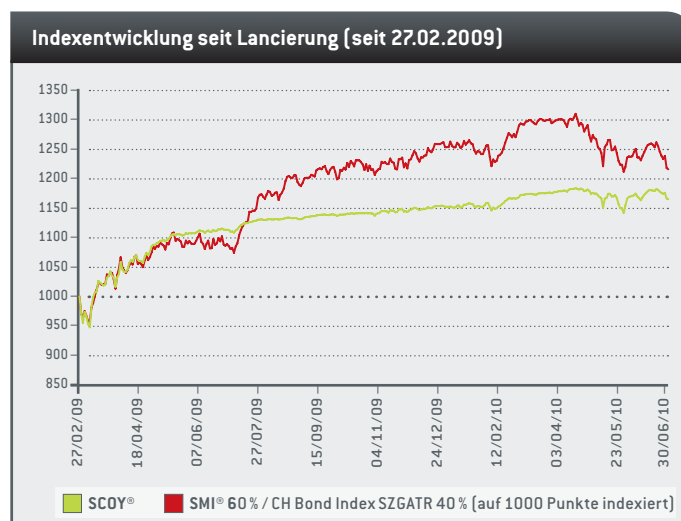
Zeitraum	SCOY®	Benchmark	Outperformance
Mai/Juni 2010	-0,80 %	-4,15 %	3,35 %
Year to date	1,11 %	-2,99 %	4,10 %
Seit Lancierung 27.02.2009	16,51 %	21,65 %	-5,13 %

### Zusammensetzung Index – NEU per 01.07.2010

ISIN	Coupon (p.a.) in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP Bezeichnung
CH0106309039	n.a.	EFG Financial Products	02.11.10	Discount-Zertifikat [1200]
CH0112161812	n.a.	Vontobel	09.06.11	Discount-Zertifikat [1200]
CH0106471375	4,00	Vontobel	10.11.10	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0106472753	6,00	Vontobel	27.12.10	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0107707355	5,75	Clariden Leu	08.12.10	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0107758911	5,00	Zürcher Kantonalbank	10.12.10	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0107831189	5,25	Banque Cantonale Vaudoise	09.12.10	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0109070570	4,75	Zürcher Kantonalbank	28.01.11	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0109262714	4,00	Rabobank	24.02.12	Barrier Reverse Convertible [1230]
CH0112161713	5,19	Vontobel	10.06.11	Barrier Reverse Convertible [1230]



Derivative Partners Research, Juni 2010



Derivative Partners Research, Juni 2010

### 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)
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.