



Communiqué de presse

4 juin 2012

SIX Swiss Exchange SA
Selnaustrasse 30
Case postale 1758
CH-8021 Zurich
www.six-swiss-exchange.com

Media Relations:
T +41 58 399 2227
F +41 58 499 2710
pressoffice@six-group.com

SIX Swiss Exchange introduit les indices SMI Risk Control

SIX Swiss Exchange a annoncé aujourd'hui l'introduction prochaine des indices SMI Risk Control, reflétant un portefeuille hypothétique qui vise à diversifier le risque inhérent au SMI. Ce portefeuille contient un placement dans le SMI et un placement sur le marché monétaire au taux overnight SARON. L'allocation d'actifs sous les nouveaux indices est contrôlée chaque jour afin de maintenir le niveau de risque voulu.

Avec les nouveaux indices SMI Risk Control, les participants au marché peuvent avoir part au SMI sous-jacent. L'allocation dynamique entre le placement à risque dans le SMI et le placement sur le marché monétaire tient ainsi compte des différents profils de risque des investisseurs.

Les indices SMI Risk Control reflètent chacun un portefeuille pour lequel le risque est maîtrisé grâce à une pondération réactive entre le taux sans risque sur le marché monétaire (SARON) et le placement à risque plus élevé (SMI). Les quatre options de calcul prévues dans ce contexte visent le maintien d'une volatilité cible de 5, 10, 15 ou 20%. Si le niveau de risque d'un indice SMI Risk Control baisse au-dessous de ces paramètres cibles, l'allocation est automatiquement adaptée en direction du SMI. Si le niveau de risque dépasse la valeur cible correspondante, la pondération de l'élément sans risque (SARON) est augmentée.

Afin d'éviter les positions à effet de levier extrême, l'engagement dans le SMI est en outre limité à 150% maximum. Les indices SMI Risk Control existent dans les variantes Total Return (TR) et Excess Return (ER). L'indice Excess Return mesure le rendement de l'indice SMI Risk Control (TR) après déduction des résultats SARON. L'indice est calculé en francs suisses. L'historique des données quotidiennes remonte jusqu'au 17 mai 2000.

Vous trouverez de plus amples renseignements sur le site web des indices de SIX Swiss Exchange, à l'adresse: www.six-swiss-exchange.com/indices/overview_fr.html.



Swiss Exchange

Pour de plus amples informations, M. Stephan Meier, Media Relations, est à votre entière disposition.

Téléphone: +41 58 399 3290
Fax: +41 58 499 2710
E-mail: pressoffice@six-group.com

SIX Swiss Exchange

SIX Swiss Exchange figure parmi les leaders des Bourses européennes réglementées et se place au premier rang dans le domaine des sciences de la vie. SIX Swiss Exchange forme avec son efficacité et sa transparence en font le marché de référence pour le négoce de segments porteurs, tels qu'actions, obligations, ETF et ETP.

SIX Swiss Exchange calcule une large palette d'indices qui inclut l'indice phare des actions suisses, le SMI®, et d'autres benchmarks, tels que le SLI® et le SPI®, mais également des indices d'actions sectoriels, des indices obligataires et des indices clients. Par le biais de ses participations dans Scoach, STOXX, Swiss Fund Data et Indexium, SIX Swiss Exchange exploite avec succès des joint-ventures au bénéfice de l'ensemble des acteurs du marché. www.six-swiss-exchange.com

SIX gère l'infrastructure de la place financière suisse et offre aux acteurs financiers du monde entier une gamme de services complète dans les secteurs du négoce et du règlement de titres, de l'information financière et du trafic des paiements. L'entreprise appartient à ses utilisateurs (environ 150 banques de tailles et d'orientations très diverses). Avec quelque 3'900 collaborateurs et une présence dans 25 pays, son résultat d'exploitation a atteint en 2011 plus de 1,26 milliard de francs suisses et un bénéfice du groupe de CHF 218,6 millions. www.six-group.com