



## Medienmitteilung

4. Juni 2012

**SIX Swiss Exchange AG**

Selnaustrasse 30

Postfach 1758

CH-8021 Zürich

T +41 58 399 5454

F +41 58 499 5455

[www.six-swiss-exchange.com](http://www.six-swiss-exchange.com)

Media Relations:

T +41 58 399 2227

F +41 58 499 2710

[pressoffice@six-group.com](mailto:pressoffice@six-group.com)

### **SIX Swiss Exchange führt SMI Risk Control-Indizes ein**

**SIX Swiss Exchange hat heute die Einführung von SMI Risk Control-Indizes angekündigt, die ein hypothetisches Portfolio abbilden, das das im SMI enthaltenen Risiko diversifiziert. Dieses Portfolio beinhaltet eine Investition in den SMI sowie eine Geldmarktanlage gemessen durch den Overnight Zins SARON. Die Asset-Allokation der neuen Indizes wird täglich überprüft, um das gewünschte Risikoniveau beizubehalten.**

Die neuen SMI Risk Control-Indizes bieten Marktteilnehmern die Möglichkeit zur Partizipation am zugrunde liegenden SMI. Durch die dynamische Allokation zwischen der risikobehafteten Anlage in den SMI und der Anlage in den Geldmarkt werden die unterschiedlich hohen Risikoneigungen verschiedener Anleger adressiert.

Die SMI Risk Control-Indizes bilden jeweils ein Portfolio ab, bei dem das Risiko durch entsprechende Verlagerung der Gewichtung zwischen dem risikofreien Geldmarktsatz (SARON) und der risikoreicheren Anlage (SMI) gesteuert wird. Dabei gibt es vier Berechnungsvarianten, die auf die Beibehaltung einer Zielvolatilität von 5, 10, 15 bzw. 20% ausgerichtet sind. Sinkt das Risikoniveau eines SMI Risk Control Index unter diese Zielparameter, wird die Allokation automatisch in Richtung des SMI angepasst. Steigt das Risikoniveau über den jeweiligen Zielwert, wird die risikofreie Komponente (SARON) stärker gewichtet.

Darüber hinaus wird das Engagement im SMI zur Vermeidung extrem gehebelter Positionen auf maximal 150% begrenzt. Die SMI Risk Control-Indizes sind als Total Return (TR)- und Excess Return (ER)-Variante verfügbar. Der Excess Return-Index misst den Ertrag des SMI Risk Control (TR)-Index abzüglich des SARON-Ertrags. Der Index wird in Schweizer Franken berechnet. Es stehen tägliche historische Daten seit dem 17. Mai 2000 zur Verfügung.

Weitere Informationen erhalten Sie auf der Website für Indizes von SIX Swiss Exchange unter [www.six-swiss-exchange.com/indices/overview\\_de.html](http://www.six-swiss-exchange.com/indices/overview_de.html).



Swiss Exchange

Für Fragen steht Ihnen Stephan Meier, Media Relations, gerne zur Verfügung.

Telefon: +41 58 399 3290  
Fax: +41 58 499 2710  
E-Mail: [pressoffice@six-group.com](mailto:pressoffice@six-group.com)

### **SIX Swiss Exchange**

SIX Swiss Exchange ist eine der wichtigsten regulierten Börsen Europas und führend im Life-Science-Bereich. SIX Swiss Exchange bildet den effizienten und transparenten Referenzmarkt für den Handel in ihren attraktiven Segmenten Aktien, Anleihen, Exchange Traded Funds (ETFs) und Exchange Traded Products (ETPs).

SIX Swiss Exchange berechnet ein umfangreiches Indexangebot, das mit dem SMI® den bedeutendsten Aktienindex der Schweiz umfasst und neben weiteren Benchmarks wie SLI® und SPI® auch Industrie-, Anleihen- und Kundenindizes beinhaltet. Mit Beteiligungen an Scoach, STOXX, Swiss Fund Data und Indexium betreibt SIX Swiss Exchange erfolgreiche Joint Ventures zugunsten sämtlicher Finanzmarktakteure.

[www.six-swiss-exchange.com](http://www.six-swiss-exchange.com)

SIX betreibt die schweizerische Finanzplatzinfrastruktur und bietet weltweit umfassende Dienstleistungen in den Bereichen Wertschriftenhandel und -abwicklung sowie Finanzinformationen und Zahlungsverkehr an. Das Unternehmen befindet sich im Besitz seiner Nutzer (rund 150 Banken verschiedenster Ausrichtung und Grösse) und erwirtschaftete 2011 mit über 3'900 Mitarbeitenden und Präsenz in 25 Ländern einen Betriebsertrag von 1,26 Milliarden Schweizer Franken und einen Konzerngewinn von 218,6 Millionen Schweizer Franken.

[www.six-group.com](http://www.six-group.com)