



SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Strategie-Indizes, Januar 2024

CH0113557521

ISIN

11355745

Valorenummer

1'490.03

Kurs (per 1.1.2024)

Strategie

Der SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® repliziert das Segment der Kapitalschutzprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich dadurch auszeichnen, dass sie das Marktrisiko minimieren indem sie einen bedingten Kapitalerhalt zusichern.

Marktanalyse

Der SIX Structured Products Capital Protection Index (SSPC®) wies in den Monaten November/Dezember einen Anstieg von 2,33% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 0,16%. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPC® einen Anstieg um 49,0%, während die Benchmark um 29,39% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (3,37%) lag Ende Dezember leicht unter derjenigen der Benchmark (3,55%).

Auswahlkriterien

Der SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® basiert auf den besten typischen Kapitalschutzprodukten auf den SMI®. Die Zusammensetzung wird alle zwei Monate überprüft und gegebenenfalls gemäss Regelwerk angepasst.

Performance in Zahlen

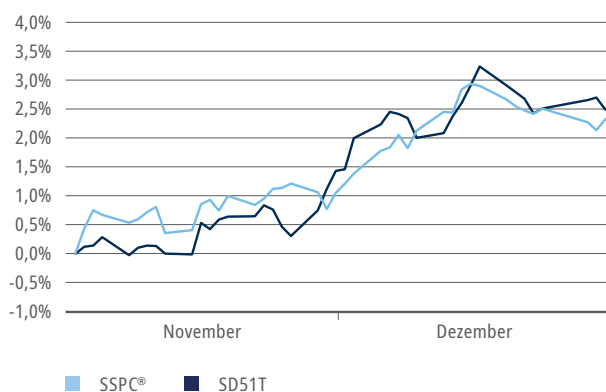
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,33%	2,49%	-0,16%
YTD	1,36%	7,09%	-5,73%
Seit Lancierung 27.02.2009	49,00%	29,39%	19,61%

Zusammensetzung Index per 1.1.2024

ISIN	Kapitalschutz	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH1225283683	100,00%	Basler Kantonalbank	26.05.26	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH1171796605	100,00%	Leonteq Securities	17.08.26	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH1254459709	102,00%	Luzerner Kantonalbank	16.10.26	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0262434126	93,00%	Raiffeisen	30.04.25	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH1280425419	95,00%	Vontobel	17.07.24	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH1252913681	100,00%	ZKB	06.07.26	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

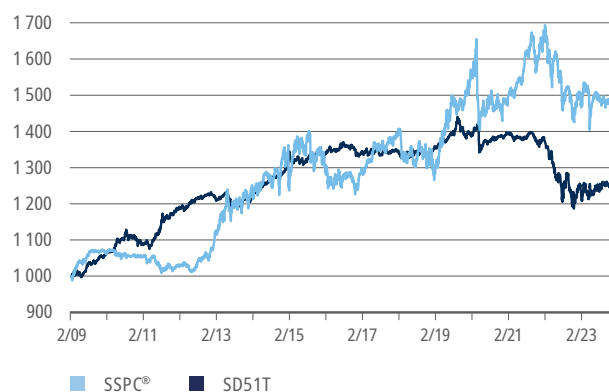
Performance November/Dezember 2023 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2024



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2024



Benchmark

Strukturierte Produkte dieser Kategorie zeichnen sich durch den Schutz des investierten Kapitals aus und erinnern in ihrem Risikoverhalten an Obligationen. Daher lässt sich der SSPC® ausgezeichnet mit dem Total Return Index aller Schweizer Obligationen mit Investment Grade und einer Laufzeit von 5 bis 10 Jahren (Symbol: SD51T) vergleichen.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (60 Tage)	Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
31. Dez 23	3,37%	3,55%	2,75
31. Okt 23	4,17%	3,37%	2,40
31. Aug 23	4,86%	4,38%	2,25
30. Jun 23	5,73%	5,10%	2,80
30. Apr 23	13,15%	7,02%	3,20
28. Feb 23	7,91%	6,86%	3,20
31. Dez 22	7,85%	6,01%	3,20
31. Okt 22	9,60%	8,30%	3,00
31. Aug 22	6,76%	8,46%	2,80
30. Jun 22	11,01%	9,24%	3,20
30. Apr 22	8,51%	6,46%	3,00
28. Feb 22	13,63%	3,85%	3,20
31. Dez 21	8,00%	3,50%	3,00
31. Okt 21	8,26%	2,97%	3,00
31. Aug 21	6,89%	1,57%	3,25
30. Jun 21	5,34%	1,72%	2,60
30. Apr 21	5,32%	2,12%	2,80
28. Feb 21	4,48%	1,87%	2,60
31. Dez 20	7,08%	1,65%	2,20
31. Okt 20	8,27%	1,42%	2,20
31. Aug 20	8,36%	2,37%	2,20
30. Jun 20	9,09%	2,06%	2,40

Dieses Factsheet enthält periodisch aktualisierte, ergänzende Informationen und Angaben zu den SIX Structured Products Strategie-Indizes. Die Indizes wurden in Zusammenarbeit mit Derivative Partners AG berechnet. Keine der hierin enthaltenen Informationen begründet ein Angebot oder eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf eines Finanzinstruments oder stellt ein Angebot zur Dienstleistungserbringung dar. SIX Swiss Exchange AG und Derivative Partners AG haften weder dafür, dass die enthaltenen Informationen vollständig, richtig, aktuell und ununterbrochen verfügbar sind, noch für Schäden infolge von Handlungen, die aufgrund von Informationen vorgenommen wurden, die in dieser oder einer anderen Publikation von SIX Swiss Exchange AG oder Derivative Partners AG enthalten sind. SMI®, SSPC®, SSP® und SSPY® sind eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist. © SIX Swiss Exchange AG, 2024. Alle Rechte vorbehalten.

SIX Swiss Exchange AG

Hardturmstrasse 201
Postfach
CH-8021 Zürich

T + 41 58 399 2100
structured-products@six-swiss-exchange.com
www.six-structured-products.com