



SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Strategie-Indizes, Januar 2024

CH0113557455

ISIN

11355745

Valorenummer

2'870.54

Kurs (per 1.1.2024)

Strategie

Der SIX Structured Products Participation Index – SSPP® repliziert das Segment der Partizipationsprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich durch eine direkte Teilnahme an der Wertentwicklung eines Basiswerts auszeichnen.

Marktanalyse

Der SIX Structured Products Participation Index (SSPP®) wies in den Monaten November/Dezember einen Anstieg von 6,45% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 0,73%. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPP® einen Anstieg um 187,05%, während die Benchmark um 137,45% zulegte. Die historische 30-Tage-Volatilität des Strategieindex (5,76%) lag Ende Dezember leicht unter derjenigen der Benchmark (6,19%).

Auswahlkriterien

Der SIX Structured Products Participation Index – SSPP® basiert auf den besten typischen Partizipationsprodukten auf den SMI®. Die Zusammensetzung wird jeden Monat überprüft und gegebenenfalls gemäss Regelwerk angepasst.

Performance in Zahlen

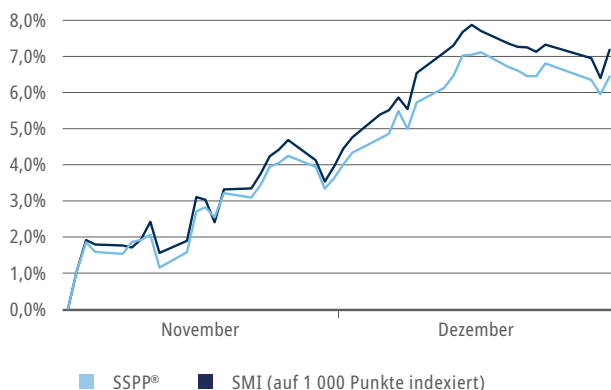
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	6,45%	7,19%	-0,73%
YTD	7,94%	3,81%	4,14%
Seit Lancierung 27.02.2009	187,05%	137,45%	49,61%

Zusammensetzung Index per 1.1.2024

ISIN	Barriere	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH1184491301	65,50%	Julius Bär	02.06.25	Bonus Certificate (1320)
CH1170681055	56,07%	Julius Bär	14.07.25	Bonus Certificate (1320)
CH1254567980	80,20%	Vontobel	06.05.25	Bonus Certificate (1320)
CH1286945923	100,00%	Vontobel	07.09.26	Outperformance Certificate (1310)
CH1214866423	100,00%	ZKB	28.06.24	Outperformance Certificate (1310)

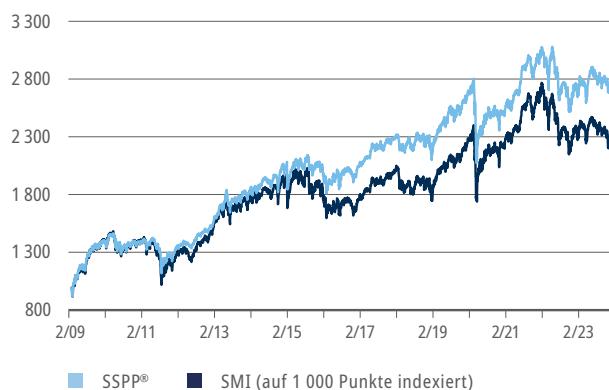
Performance November/Dezember 2023 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2024



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2024



Benchmark

Auch der SSPP® Index braucht einen Vergleichsindex, anhand dessen er sich messen lässt. Da Partizipationsprodukte direkt die Wertentwicklung eines Basiswerts widerspiegeln, lässt sich der SSPP® hervorragend mit dem SMI® vergleichen.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (30 Tage)	Volatilität (30 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (30 Tage)
31. Dez 23	5,76%	6,19%	3,40
31. Okt 23	8,84%	12,37%	3,00
31. Aug 23	9,92%	9,33%	3,25
30. Jun 23	10,42%	9,70%	3,25
30. Apr 23	5,85%	8,14%	3,25
28. Feb 23	10,20%	9,88%	3,50
31. Dez 22	10,94%	14,23%	3,50
31. Okt 22	17,58%	16,98%	3,50
31. Aug 22	7,53%	8,37%	3,50
30. Jun 22	16,38%	20,94%	3,00
30. Apr 22	12,71%	13,40%	3,75
28. Feb 22	16,34%	19,61%	3,20
31. Dez 21	10,26%	13,38%	2,40
31. Okt 21	6,63%	7,97%	2,25
31. Aug 21	6,76%	7,32%	2,25
30. Jun 21	5,98%	7,11%	3,75
30. Apr 21	7,34%	9,27%	4,60
28. Feb 21	9,95%	11,56%	4,50
31. Dez 20	10,32%	12,66%	2,80
31. Okt 20	14,21%	15,13%	3,80
31. Aug 20	11,59%	13,70%	4,57
30. Jun 20	15,61%	20,79%	4,00

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®, SSPP® 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