



SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Strategie-Indizes, März 2024

CH0113557455

ISIN

11355745

Valorenummer

2'943.76

Kurs (per 1.3.2024)

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 Januar/Februar einen Anstieg von 2,55% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 0,15%. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPP® einen Anstieg um 194,38%, während die Benchmark um 143,86% zulegte. Die historische 30-Tage-Volatilität des Strategieindex (7,44%) lag Ende Februar leicht unter derjenigen der Benchmark (8,53%).

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

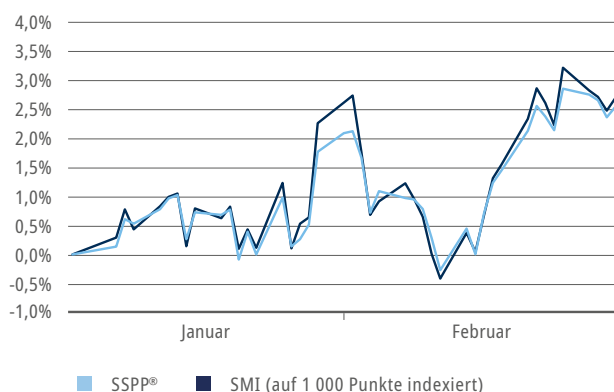
| Zeitraum | SSPP® | Benchmark | Outperformance |
|-------------------------------|---------|-----------|----------------|
| Letzte 2 Monate | 2,55% | 2,70% | -0,15% |
| YTD | 2,55% | 2,70% | -0,15% |
| Seit Lancierung 27.02.2009 | 194,38% | 143,86% | 50,51% |

Zusammensetzung Index per 1.3.2024

| ISIN | Barriere | Emittent | Rückzahlung | SVSP-Bezeichnung |
|--------------|----------|------------|-------------|-----------------------------------|
| CH1121572098 | 70,75% | Julius Bär | 07.10.24 | 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) |

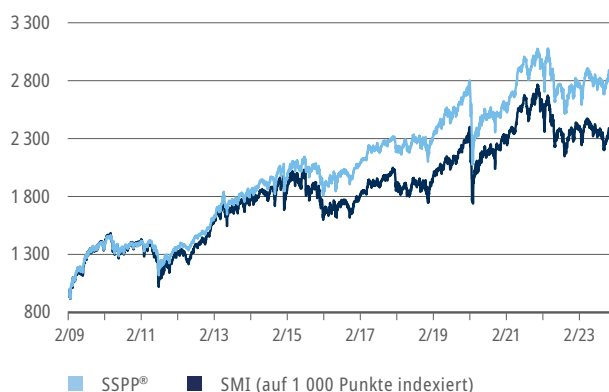
Performance Januar/Februar 2024 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, März 2024



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, März 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) |
|-------------|-----------------------------|---------------------------------|---------------------------------------|
| 29. Feb 24 | 7,44% | 8,53% | 3,20 |
| 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 |

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.