



SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Strategie-Indizes, September 2018

CH0113557455

ISIN

11355745

Valorennummer

2'287.39

Kurs (per 31.08.2018)

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 Juli/ August ein Plus von 3,32% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine überdurchschnittliche Performance von 3,32%. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der SSPP® einen Anstieg um 128,74%, während die Benchmark um 91,31% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (7,09%) lag Ende August unter derjenigen der Benchmark (7,67%).

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	3,32%	-0,00%	3,32%
YTD	-0,03%	-4,35%	4,32%
Seit Lancierung 27.02.2009	128,74%	91,31%	37,43%

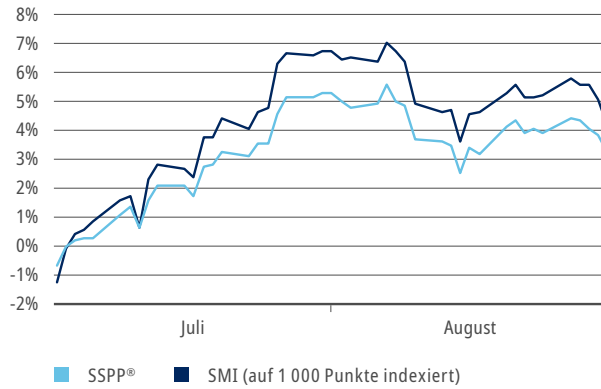
Zusammensetzung Index per 31.08.2018

ISIN	Barriere	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0316759700	69.01%	UBS	22.02.19	Bonus Certificate (1320)
CH0314520971		Raiffeisen	06.05.19	Outperformance Certificate (1310)
CH0321509272	71.25%	Bank Vontobel	24.05.19	Bonus Certificate (1320)
CH0385003238	71%	Leonteq Securities	09.11.20	Bonus Outperformance Certificate (1310)
CH0332710513	60%	Bank Julius Bär	06.03.20	Bonus Certificate (1320)
CH0291850607	71%	UBS	23.08.19	Bonus Certificate (1320)
CH0362956937	65%	Bank Julius Bär	09.06.20	Bonus Certificate (1320)
CH0418856784	79%	Bank Vontobel	17.06.19	Bonus Certificate (1310)
CH0369679292	63%	Bank Julius Bär	01.09.20	Bonus Certificate (1320)
CH0413819720		Credit Suisse	12.07.19	Outperformance Certificate (1310)

STRUCTURED
PRODUCTS

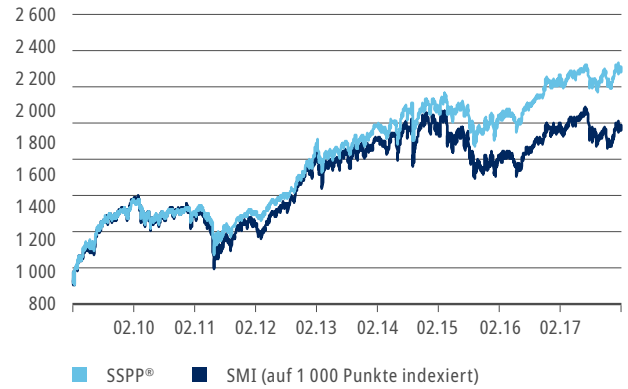
Performance Juli/ August 2018 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, August 2018



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, August 2018



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. Aug 18	7,09%	7,67%	3,70
31. Jul 18	6,95%	10,46%	3,70
29. Jun 18	12,23%	16,83%	3,90
31. Mai 18	7,92%	10,01%	3,90
30. Apr 18	10,27%	12,60%	3,30
30. Mär 18	9,75%	16,18%	2,90
28. Feb 18	8,93%	19,45%	3,60
31. Jan 18	5,27%	8,45%	3,70
29. Dez 17	5,09%	7,83%	1,50
30. Nov 17	7,06%	8,46%	1,60
31. Okt 17	6,35%	8,63%	2,00
30. Sep 17	5,06%	6,27%	1,90
31. Aug 17	10,74%	11,28%	2,20
31. Jul 17	8,27%	10,26%	2,20
30. Jun 17	7,95%	10,99%	2,60
31. Mai 17	7,16%	8,77%	2,28
28. Apr 17	6,68%	9,06%	3,22
31. Mär 17	4,69%	7,26%	3,00
28. Feb 17	4,34%	6,86%	2,13
30. Jan 17	6,49%	10,36%	2,07
30. Dez 16	7,64%	10,45%	2,40
30. Nov 16	9,93%	13,62%	2,84

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, 2017. Alle Rechte vorbehalten.