

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorenummern	Kurs (per 01.01.2017)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'282,32

Strategie

Der SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® repliziert das Segment der Kapitalschutzprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich durch den Schutz des investierten Kapitals in der Höhe des Nominals auszeichnen.

Marktanalyse

Der SSPC® wies in den Monaten November/Dezember ein Plus von 2,84% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine überdurchschnittliche Performance von 5,32%. Seit Jahresbeginn notiert der SSPC® 4,44% unter dem Stand von Ende Dezember 2015, während die Benchmark dank der stabilen Entwicklung der CHF-Obligationen in derselben Zeitperiode ein Plus von 2,28% verzeichnete. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (6,15%) lag am Jahresende über derjenigen der Benchmark (4,71%).

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

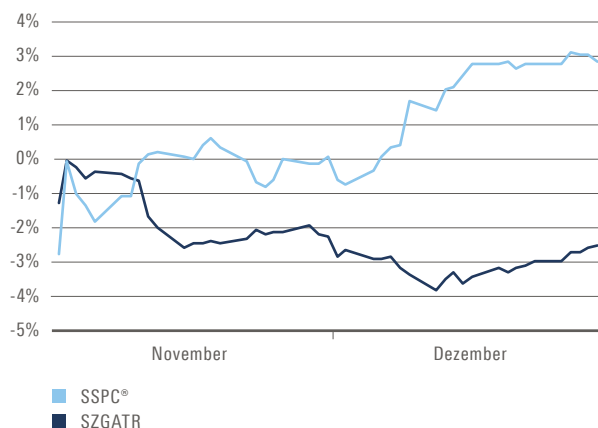
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,84%	-2,47%	5,32%
YTD	-4,44%	2,28%	-6,72%
Seit Lancierung 27.02.2009	28,23%	29,78%	-1,55%

Zusammensetzung Index per 01.01.2017

ISIN	Kapitalschutz	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0115890136	100%	EFG International	15.10.18	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0118173233	100%	EFG International	14.12.18	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0123070507	100%	EFG International	18.03.19	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0208891090	90%	Credit Suisse	06.06.17	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0228293756	90%	Notenstein La Roche Privatbank	03.08.18	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0228294952	90%	Notenstein La Roche Privatbank	11.03.19	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

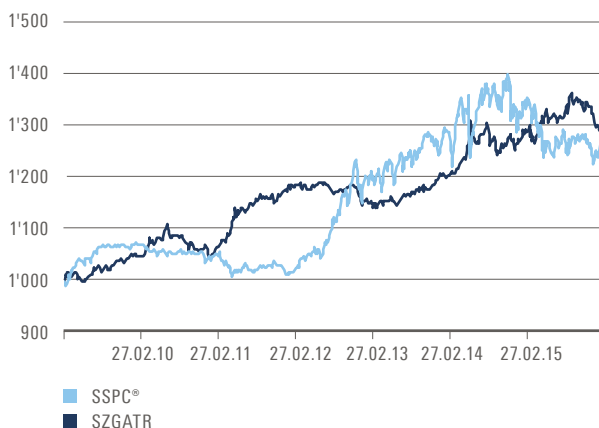
Performance November/Dezember 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2017



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2017



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 von Bloomberg (Bloomberg Code: SZGATR) vergleichen.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (60 Tage)	Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
30. Dez 16	6,15%	4,71%	2,17
31. Okt 16	4,75%	4,37%	2,37
31. Aug 16	5,23%	3,32%	2,19
30. Jun 16	7,37%	4,70%	2,30
29. Apr 16	5,54%	3,57%	2,18
29. Feb 16	12,07%	4,96%	2,33
30. Dez 15	7,55%	5,31%	2,60
30. Okt 15	11,75%	4,16%	3,08
31. Aug 15	12,07%	4,61%	3,77
30. Jun 15	8,25%	5,12%	4,00
29. Apr 15	7,87%	4,19%	3,58
27. Feb 15	17,90%	7,87%	2,61
31. Dez 14	8,47%	1,88%	2,88
30. Okt 14	8,54%	2,38%	2,60
31. Aug 14	6,33%	2,51%	2,41
30. Jun 14	3,93%	2,54%	2,55
30. Apr 14	7,51%	2,92%	2,76
28. Feb 14	6,69%	2,04%	2,30
31. Dez 13	6,41%	2,39%	2,25
31. Okt 13	7,35%	3,06%	2,61
31. Aug 13	6,89%	2,52%	2,42
30. Jun 13	10,08%	3,51%	2,17

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. Aus den SIX Structured Products Strategie-Indizes ergibt sich keine Aufforderung zum Kaufen oder Verkaufen von Wertpapieren. SIX Swiss Exchange, SIX Structured Products Exchange AG und Derivative Partners AG lehnen jegliche Haftung für Schäden, die aus der Verwendung der SIX Structured Products Strategie-Indizes entstehen, ab. SSPP®, SSPY® und SSPC® sind eingetragene respektive hinterlegte Marken der SIX Structured Products Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.

SIX Structured Products Exchange AG
Selnaustrasse 30
Postfach
CH-8021 Zürich

T + 41 58 399 2100
F + 41 58 499 2099
structured-products@six-swiss-exchange.com
www.six-structured-products.com