



SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Strategie-Indizes, September 2020

CH0113557521

ISIN

11355745

Valorennummer

1'462.56

Kurs (per 1.9.2020)

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 Juli/August ein Minus von 0,64 % auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 0,86 %. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPC® einen Anstieg um 46,26 %, während die Benchmark um 37,62 % zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (8,36 %) lag Ende August deutlich über derjenigen der Benchmark (2,32 %).

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

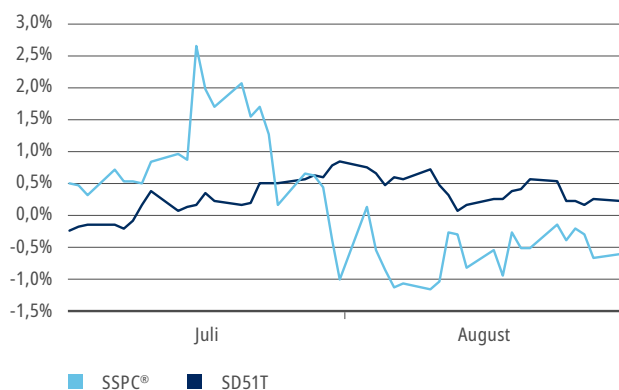
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,64%	0,22%	-0,86%
YTD	-5,85%	-0,61%	-5,23%
Seit Lancierung 27.02.2009	46,26%	37,62%	8,63%

Zusammensetzung Index per 1.9.2020

ISIN	Kapitalschutz	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0515564638	90,00%	Bank Vontobel	28.01.21	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242047170	101,00%	Leonteq	31.10.22	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0433742274	90,00%	Leonteq	18.10.21	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0506111209	92,00%	Bank Vontobel	23.05.22	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0515548599	90,00%	Bank Vontobel	25.01.22	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

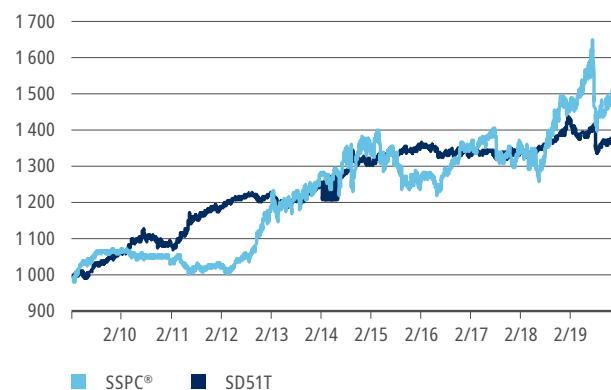
Performance Juli/August 2020 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, September 2020



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, September 2020



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. Aug 20	8,36%	2,32%	2,20
30. Jun 20	9,09%	2,06%	2,40
30. Apr 20	11,73%	6,52%	2,33
28. Feb 20	18,13%	2,46%	2,67
31. Dez 19	8,54%	2,52%	3,00
31. Okt 19	6,52%	3,49%	2,40
30. Aug 19	7,41%	3,47%	2,50
28. Jun 19	10,64%	1,88%	4,89
30. Apr 19	9,40%	2,36%	1,63
28. Feb 19	8,18%	1,88%	1,75
31. Dez 18	11,66%	1,31%	1,78
31. Okt 18	11,50%	1,86%	2,50
31. Aug 18	5,98%	1,63%	2,60
29. Jun 18	6,52%	2,68%	2,14
30. Apr 18	6,61%	1,92%	2,43
28. Feb 18	6,22%	1,97%	2,33
29. Dez 17	5,06%	1,35%	1,50
31. Okt 17	4,04%	1,70%	2,33
31. Aug 17	5,95%	1,86%	2,17
30. Jun 17	4,67%	1,46%	2,83
28. Apr 17	4,14%	2,39%	3,17
28. Feb 17	4,34%	1,95%	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. 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, 2020. 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