



SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Strategie-Indizes, November 2019

CH0113557455

ISIN

11355745

Valorennummer

2'591.98

Kurs (per 1.11.2019)

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 September/Oktober ein Plus von 2,37% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 0,90%. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der SSPP® einen Anstieg um 159,20%, während die Benchmark um 117,88% zulegte. Die historische 30-Tage-Volatilität des Strategieindex (9,99%) lag Ende Oktober unter derjenigen der Benchmark (10,63%).

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

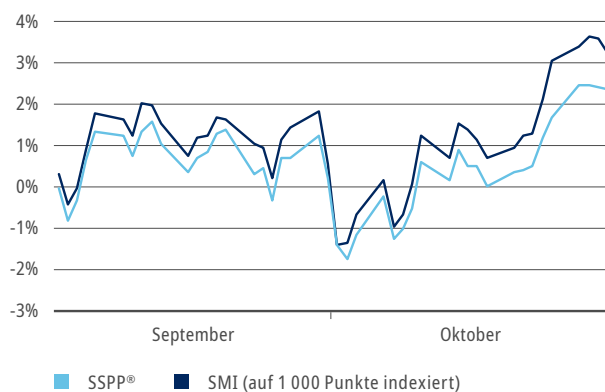
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,37%	3,28%	-0,90%
YTD	21,07%	24,70%	-3,63%
Seit Lancierung 27.02.2009	159,20%	117,88%	41,32%

Zusammensetzung Index per 1.11.2019

ISIN	Barriere	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0410185059	62%	Bank Julius Bär	21.06.21	Bonus Certificate (1320)
CH0456281846	61%	Bank Julius Bär	07.03.22	Bonus Certificate (1320)
CH0467722721	67%	Bank Vontobel	29.07.22	Bonus Certificate (1320)
CH0489813565	79%	Bank Vontobel	28.08.20	Bonus Certificate (1320)
CH0489818838	80%	Bank Vontobel	01.03.21	Bonus Certificate (1320)
CH0369679292	63%	Bank Julius Bär	01.09.20	Bonus Certificate (1320)
CH0410185125	71%	Bank Julius Bär	15.06.20	Bonus Certificate (1320)
CH0332710513	60%	Bank Julius Bär	05.03.20	Bonus Certificate (1320)
CH0362956937	65%	Bank Julius Bär	09.06.20	Bonus Certificate (1320)

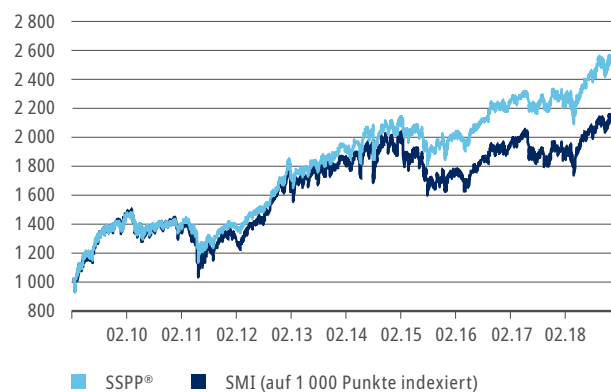
Performance September/Oktober 2019 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, November 2019



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, November 2019



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. Okt 19	9,99%	10,63%	3,38
30. Aug 19	14,32%	12,58%	3,33
28. Jun 19	9,38%	8,07%	3,25
30. Apr 19	6,60%	8,64%	4,11
28. Feb 19	9,05%	12,61%	4,20
31. Dez 18	19,09%	21,46%	4,30
30. Nov 18	9,05%	10,65%	4,00
31. Okt 18	14,63%	16,45%	3,50
28. Sep 18	6,62%	8,30%	3,50
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. Mar 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

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.

SIX

Securities & Exchanges
Postfach
CH-8021 Zürich

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