

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorenummern	Kurs (per 29.02.2016)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'264,69

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 Januar/Februar ein Minus von 5,76% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine unterdurchschnittliche Performance von 10,85%. Der Fehlstart an der Börse seit Jahresanfang hinterliess deutliche Spuren. Die Minderperformance der Kapitalschutzprodukte des Index, deren Partizipation an den SMI gekoppelt ist, rührt von der höheren Performance des Swiss Bond Index im Vergleich zum SMI. Die Volatilität des Strategieindex (12,07%) lag weiter über derjenigen der Benchmark (4,96%).

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

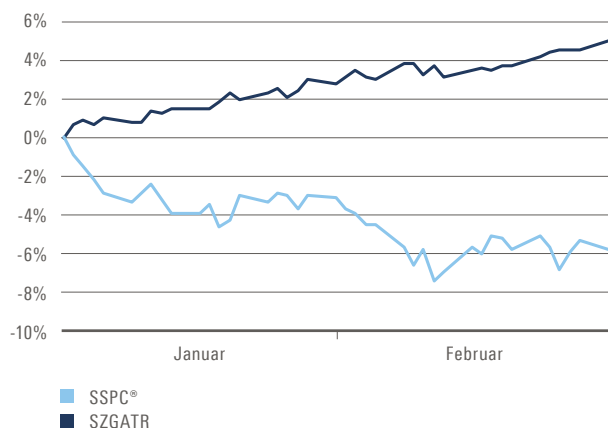
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-5,76%	5,09 %	-10,85%
YTD	-5,76%	5,09 %	-10,85%
Seit Lancierung 27.02.2009	26,4%	33,36%	-6,89%

Zusammensetzung Index per 29.02.2016

ISIN	Kapitalschutz in %	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)
CH0141505567	90%	Bank Vontobel	20.03.17	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0207112498	90%	Notenstein La Roche Privatbank	20.03.17	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)
CH0301885890	94%	Bank Vontobel	16.12.16	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

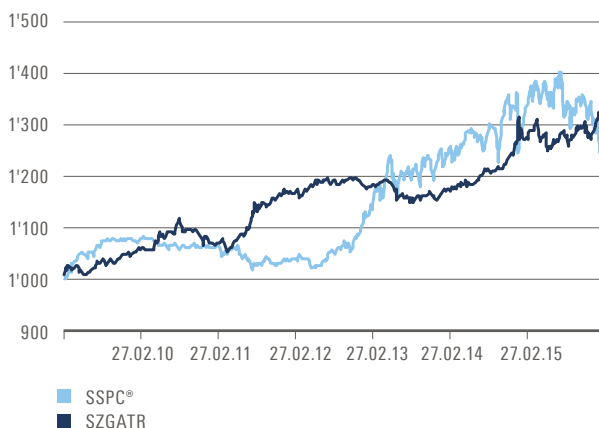
Performance Januar/Februar 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Februar 2016



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Februar 2016



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)
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. Dec 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
30. Apr 13	8,84%	1,65%	2,31
28. Feb 13	6,46%	2,56%	2,14
31. Dez 12	4,60%	1,80%	1,95
31. Okt 12	4,39%	2,20%	1,73
31. Aug 12	3,46%	2,85%	1,62

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 5111
F +41 58 499 5112
sales.global@six-financial-information.com
www.six-financial-information.com