

SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 30.12.2015)
SIX Structured Products Participation Index – SSPP®	CH0113557455	11355745	2'061,49

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 SSPP® wies in den Monaten November/Dezember ein Minus von 0,25% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine überdurchschnittliche Performance von 1,10%. Seit Anfang Jahr stieg der SSPP® um 1,49%, während der Vergleichsmassstab ein Minus von 1,84% verzeichnete. Auf Jahresbasis übertraf der Strategieindex der Partizipationsprodukte den SMI® somit um 3,33%. Die Volatilität zog in den letzten beiden Monaten leicht an von 9,72% auf 10,56%. Sie lag

damit weiterhin deutlich unter derjenigen der Benchmark (17,83%).

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

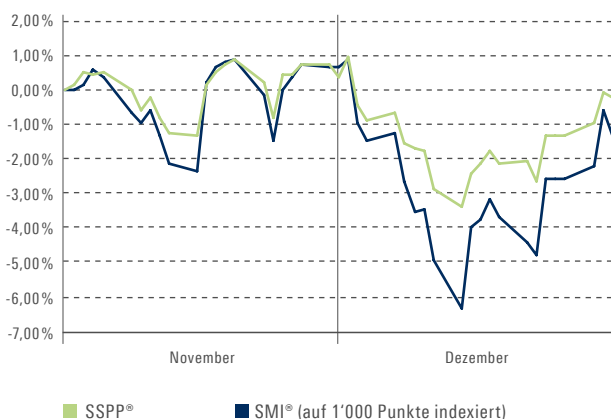
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,25%	-1,35%	1,10%
YTD	1,49%	-1,84%	3,33%
Seit Lancierung 27.02.2009	106,15%	87,99%	18,16%

Zusammensetzung Index per 01.01.2016

ISIN	Barriere in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0202770860	65 %	Bank Julius Bär	11.06.18	Bonus Certificate (1320)
CH0202770944	71 %	Bank Julius Bär	01.09.17	Bonus Certificate (1320)
CH0242022017	75 %	Bank Julius Bär	23.01.17	Bonus Certificate (1320)
CH0254430975	70 %	Bank Vontobel	16.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0207118156	69 %	Notenstein La Roche Privatbank	06.05.16	Bonus Certificate (1320)
CH0262433755	69 %	Notenstein La Roche Privatbank	10.08.16	Bonus Certificate (1320)
CH0211799801	68 %	UBS	14.06.16	Bonus Certificate (1320)
CH0214025238	68 %	UBS	21.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0216758067	69 %	UBS	10.07.17	Bonus Certificate (1320)
CH0262433763	75 %	Notenstein La Roche Privatbank	10.08.16	Bonus Outperformance Certificate (1330)

Performance November/Dezember 2015 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Dezember 2015



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Dezember 2015



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)
30. Dez 15	10,56 %	17,83 %	3,96
30. Nov 15	9,37 %	13,59 %	3,94
30. Okt 15	9,72 %	15,26 %	3,73
30. Sep 15	16,42 %	24,43 %	4,33
31. Aug 15	15,19 %	29,09 %	4,34
31. Juli 15	9,57 %	15,18 %	4,32
30. Juni 15	8,55 %	14,35 %	4,45
29. Mai 15	11,52 %	14,89 %	4,57
29. Apr 15	9,49 %	12,54 %	4,44
31. Mär 15	8,43 %	11,64 %	4,32
27. Feb 15	7,22 %	9,50 %	4,05
30. Jan 15	31,78 %	41,90 %	3,30
31 Dec. 14	11,34 %	12,85 %	2,72
28. Nov 14	5,88 %	9,35 %	2,78
31. Okt 14	14,69 %	18,15 %	2,38
30. Sep 14	5,88 %	5,98 %	2,45
31. Aug 14	7,65 %	9,52 %	2,31
31. Juli 14	8,61 %	9,68 %	2,32
30. Juni 14	6,23 %	6,90 %	3,14
30. Mai 14	4,63 %	5,47 %	2,45
30. Apr 14	8,06 %	9,01 %	2,51
31. Mär 14	11,12 %	12,91 %	2,90

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.