

SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorenummern	Kurs (per 01.07.2016)
SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY®	CH0113557455	11355745	1'375,31

Strategie

Der SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY® repliziert das Segment der Renditeoptimierungsprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich bei seitwärts tendierenden Märkten durch Coupzahlungen und Discounts auszeichnen.

Marktanalyse

Der SSPY wies in den Monaten Mai/Juni ein Plus von 0,96% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine überdurchschnittliche Performance von 0,22%. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der Strategieindex der Renditeoptimierungsprodukte ein Plus von 37,53%, während die Benchmark um 56,80% zulegte. Die Volatilität des SSPY stieg in den letzten beiden Monaten von 4,51% auf 5,80%. Sie lag damit jedoch weiterhin deutlich unter derjenigen der Benchmark (11,73%).

Auswahlkriterien

Der SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY® basiert auf den besten typischen Renditeoptimierungsprodukten auf den SMI®. Die Zusammensetzung wird alle zwei Monate überprüft und gegebenenfalls gemäss Regelwerk angepasst.

Performance in Zahlen

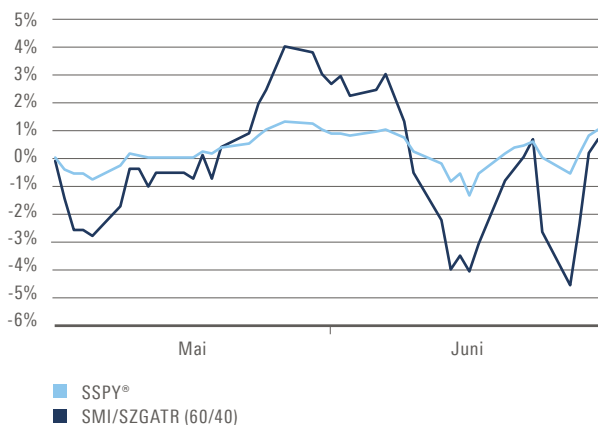
Zeitraum	SSPY®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	0,96%	0,74%	0,22%
YTD	-1,53%	-4,13%	2,60%
Seit Lancierung 27.02.2009	37,53%	56,80%	-19,26%

Zusammensetzung Index per 01.07.2016

ISIN	Coupon (p.a.) in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0124485670	2,05%	Credit Suisse	04.03.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0299692753	6,20%	Bank Julius Bär	20.01.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0300497317	3,00%	Notenstein La Roche Privatbank	29.05.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0309390083	2,50%	Bank Vontobel	27.01.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0316278446	5,00%	UBS	17.02.17	Barrier Reverse Convertible (1230)

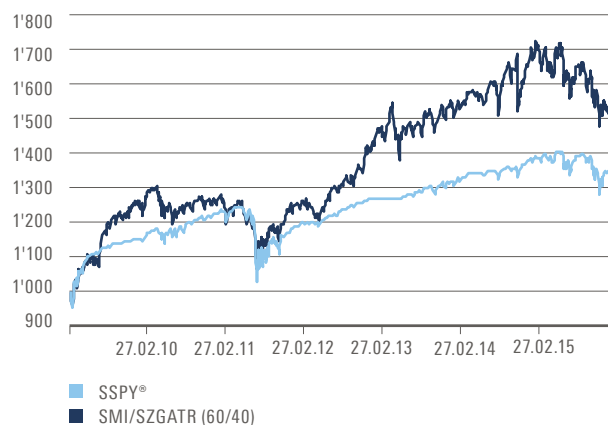
Performance Mai/Juni 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2016



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2016



Benchmark

Um den Renditeoptimierungsindex mit einem adäquaten Benchmark vergleichen zu können, wurde ein neuer, fiktiver Index zusammengestellt. Dieser Referenzindex besteht aus einem Aktienanteil von 60% des SMI® und einem Obligationenanteil von 40% eines Total Return Indexes aller Schweizer Obligationen von Bloomberg (Bloomberg Code: SZGATR). Diese Zusammensetzung entspricht in etwa der Struktur von Renditeoptimierungsprodukten.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (30 Tage)	Volatilität (30 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (30 Tage)
30. Jun 16	5,80%	11,73%	2,60
29. Apr 16	4,51%	8,65%	3,01
29. Feb 16	15,08%	16,64%	4,03
30. Dez 15	5,61%	11,07%	2,67
30. Okt 15	9,58%	13,61%	2,99
31. Aug 15	7,05%	15,18%	3,70
30. Jun 15	5,36%	10,53%	4,32
29. Apr 15	2,92%	8,76%	4,33
27. Feb 15	6,09%	20,75%	4,59
31 Dec. 14	1,83%	9,08%	1,60
31. Okt 14	3,34%	9,15%	1,40
31. Aug 14	1,74%	6,48%	1,36
30. Jun 14	1,44%	4,44%	1,38
30. Apr 14	4,33%	7,43%	2,15
28. Feb 14	3,98%	7,27%	2,28
31. Dez 13	3,16%	6,99%	2,27
31. Okt 13	1,87%	6,44%	2,15
31. Aug 13	1,91%	7,83%	1,51
30. Jun 13	0,55%	14,62%	1,61
30. Apr 13	0,45%	8,99%	1,58
28. Feb 13	1,32%	9,07%	1,62
31. Dez 12	1,66%	6,50%	1,65

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