

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 31.12.2014)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'334,28

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® weist während der letzten zwei Monate im Vergleich zur Benchmark eine leicht unterdurchschnittliche Performance von 0,39% auf. Der Swiss Bond Index hat in diesem 2-Monats-Zeitraum um 28 Basispunkte nachgegeben und eine stolze Rendite von 2,69% erzielt. Trotz der weiter ansteigenden Aktienmärkte konnten die Kapitalschutzprodukte des Index in den letzten zwei Monaten des Jahres nicht ganz mit dem Renditeplus des Bondmarktes mithalten.

Der Strategieindex wies zudem eine deutlich höhere Volatilität auf als die Benchmark.

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

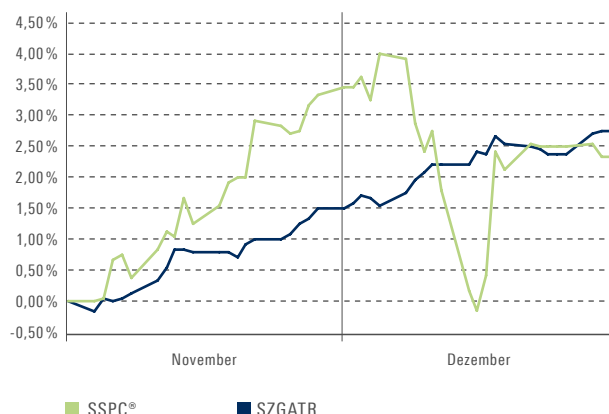
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,30 %	2,69 %	-0,39 %
YTD	9,19 %	8,24 %	0,95 %
Seit Lancierung 27.02.2009	33,43 %	24,27 %	9,15 %

Zusammensetzung Index per 01.01.2015

ISIN	Kapitalschutz in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0102151740	100	Goldman Sachs	08.04.16	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0111993512	95	Credit Suisse	24.04.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0120641904	95	EFG International	21.12.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0122699421	95	Credit Suisse	26.06.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0124744019	95	Credit Suisse	23.05.16	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0214779644	95	Zürcher Kantonalbank	07.07.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242020516	95	Bank Julius Bär	07.07.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242020532	90	Bank Julius Bär	08.07.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242021134	95	Bank Julius Bär	25.09.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242065495	90	Notenstein Privatbank	13.05.15	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

Performance November/Dezember 2015 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners Research, Januar 2015



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners Research, Januar 2015



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)
31. Dez 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
30. Jun 12	2,77 %	3,90 %	1,48
30. Apr 12	2,84 %	3,79 %	1,37
29. Feb 12	1,98 %	2,92 %	1,35
31. Dez 11	2,54 %	2,68 %	1,41
31. Okt 11	4,09 %	4,02 %	1,75
31. Aug 11	3,77 %	5,44 %	1,82

Dieses Factsheet enthält periodisch aktualisierte, ergänzende Informationen und Angaben zu den SIX Structured Products Strategie-Indizes. Die Indizes wurden in Zusammenarbeit mit Derivative Partners Research 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 Research 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.