

# SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

**STRUCTURED  
PRODUCTS**


## Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 27.02.2015)
SIX Structured Products Participation Index – SSPP®	CH0113557455	11355745	2'016,14

## 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

Die Performance des SSPP® lag im Zeitraum Januar/Februar mit -0,74% unter derjenigen der Benchmark SMI® (+0,35%). Das war der Abkoppelung des CHF vom Euro geschuldet. Der von der Schweizerischen Nationalbank verursachte Schock konnte von den im Strategieindex enthaltenen Outperformance-Zertifikaten noch nicht vollständig wieder wettgemacht werden. Dank der bedingten Barrieren überstand der Strategieindex die turbulenten Zeiten allerdings mit wesentlich geringeren Ausschlägen als die Bench-

mark. Nach dem Extremwert im Januar sank die Volatilität Ende Februar bereits wieder auf Normalmass.

## 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

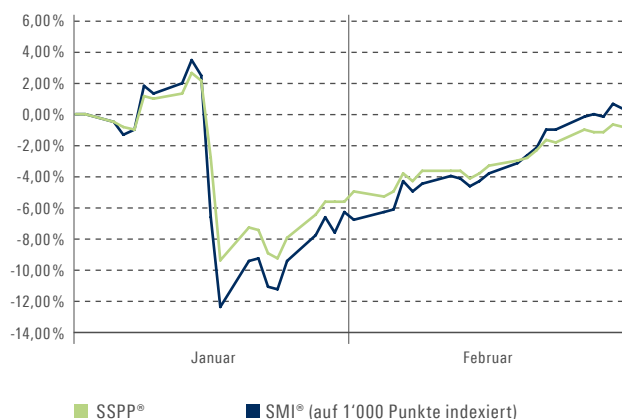
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,74 %	0,35 %	-1,09 %
YTD	-0,74 %	0,35 %	-1,09 %
Seit Lancierung 27.02.2009	101,61 %	92,18 %	9,43 %

## Zusammensetzung Index per 01.03.2015

ISIN	Barriere in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0242022017	75	Bank Julius Bär	23.01.17	Bonus Certificate (1320)
CH0112162307	70	Bank Vontobel	09.06.15	Bonus Certificate (1320)
CH0201202287	70	Banque Cantonale Vaudoise	26.11.15	Bonus Certificate (1320)
CH0209435814	60	Banque Cantonale Vaudoise	14.03.16	Bonus Certificate (1320)
CH0225511119	69	Leonteq Securities	25.11.15	Bonus Certificate (1320)
CH0262433755	69	Notenstein Privatbank	10.08.16	Bonus Certificate (1320)
CH0207118156	69	Notenstein Privatbank	06.05.16	Bonus Certificate (1320)
CH0207356608	70	UBS	04.09.15	Bonus Certificate (1320)
CH0214025238	68	UBS	21.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0207630531	75	Zürcher Kantonalbank	02.07.15	Bonus Certificate (1320)

## Performance Januar/Februar 2015 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, März 2015



## Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, März 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)
27. Feb 15	7,22 %	9,50 %	4,05
30. Jan 15	31,78 %	41,90 %	3,30
31. Dez 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. Jul 14	8,61 %	9,68 %	2,32
30. Jun 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
28. Feb 14	7,02 %	8,84 %	2,91
31. Jan 14	10,13 %	11,65 %	2,90
31. Dez 13	8,11 %	12,84 %	2,90
29. Nov 13	5,31 %	7,18 %	2,89
31. Okt 13	8,80 %	10,34 %	2,74
30. Sep 13	7,67 %	8,99 %	2,84
31. Aug 13	9,57 %	12,33 %	3,01
31. Jul 13	8,11 %	10,77 %	3,25
30. Jun 13	17,53 %	24,65 %	3,63
31. Mai 13	14,23 %	16,30 %	3,51
30. Apr 13	13,74 %	16,92 %	3,61
31. Mär 13	8,46 %	9,19 %	3,31

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 Kauf oder Verkauften 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.