



SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY®

Strategie-Indizes, September 2021

CH0113557489

ISIN

11355745

Valorennummer

1'626.01

Kurs (per 1.9.2021)

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 Couponzahlungen und Discounts auszeichnen.

Marktanalyse

Der SIX Structured Products Yield Enhancement Index (SSPY®) wies in den Monaten Juli/August ein Plus von 0,12% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Underperformance von 2,94%. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPY® einen Anstieg um 62,60%, während die Benchmark um 114,40% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (0,85%) lag Ende August deutlich unter derjenigen der Benchmark (6,59%).

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

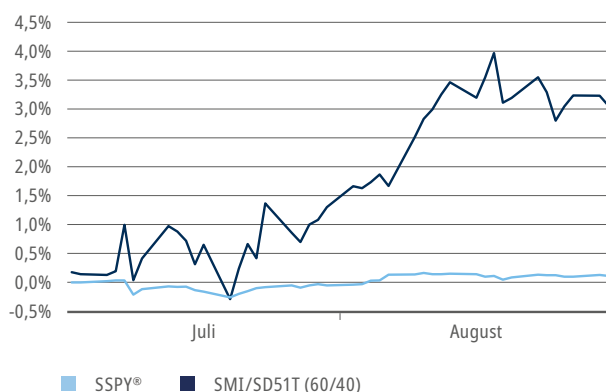
Zeitraum	SSPY®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	0,12%	3,06%	-2,94%
YTD	6,17%	16,08%	-9,91%
Seit Lancierung 27.02.2009	62,60%	114,40%	-51,79%

Zusammensetzung Index per 1.9.2021

ISIN	Coupon (p.a.)	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0521903846	2,75%	Zürcher Kantonalbank	10.07.23	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0571159182	3,00%	UBS	11.10.21	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0570913555	5,00%	Bank Julius Bär	06.10.21	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0567460461	4,25%	Bank Vontobel	06.10.21	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0521984705	6,80%	Raiffeisen	17.03.25	Barrier Reverse Convertible with Conditional Coupon (1260)

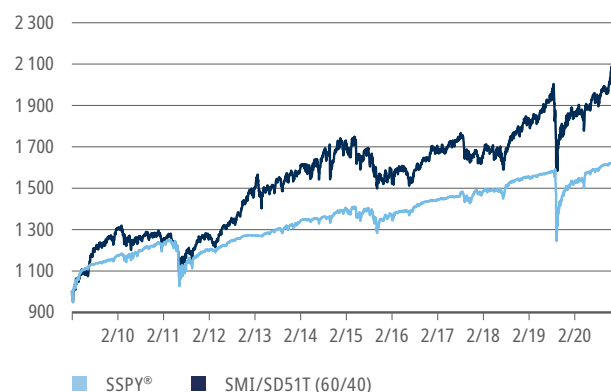
Performance Juli/August 2021 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, September 2021



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, September 2021



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 Index aller Schweizer Obligationen mit Investment Grade und einer Laufzeit von 5 bis 10 Jahren (Symbol: SD51T). Diese Zusammensetzung entspricht in etwa der Struktur und dem Risiko von Renditeoptimierungsprodukten.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (60 Tage)	Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
31. Aug 21	0,85%	6,59%	1,00
30. Jun 21	1,33%	6,90%	2,25
30. Apr 21	2,13%	7,85%	2,50
26. Feb 21	2,74%	7,72%	2,20
31. Dez 20	6,31%	9,86%	4,20
30. Okt 20	6,77%	10,60%	4,20
31. Aug 20	4,87%	9,44%	3,55
30. Jun 20	6,43%	14,13%	4,00
30. Apr 20	41,81%	31,08%	4,00
28. Feb 20	2,46%	13,08%	2,00
31. Dez 19	1,31%	6,59%	2,50
31. Okt 19	1,25%	7,12%	4,00
30. Aug 19	2,12%	8,41%	2,00
28. Jun 19	2,46%	8,12%	4,20
30. Apr 19	1,73%	5,62%	4,25
28. Feb 19	4,29%	8,55%	3,60
31. Dez 18	4,76%	11,22%	4,20
31. Okt 18	1,61%	8,87%	2,20
31. Aug 18	2,86%	6,42%	1,40
29. Jun 18	4,06%	9,00%	3,67
30. Apr 18	5,78%	9,73%	3,00
28. Feb 18	5,13%	9,95%	3,40

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. Keine der hierin enthaltenen Informationen begründet ein Angebot oder eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf eines Finanzinstruments oder stellt ein Angebot zur Dienstleistungserbringung dar. SIX Swiss Exchange AG und Derivative Partners AG haften weder dafür, dass die enthaltenen Informationen vollständig, richtig, aktuell und ununterbrochen verfügbar sind, noch für Schäden infolge von Handlungen, die aufgrund von Informationen vorgenommen wurden, die in dieser oder einer anderen Publikation von SIX Swiss Exchange AG oder Derivative Partners AG enthalten sind. SMI®, SSPC®, SSPP® und SSPPY® sind eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist. © SIX Swiss Exchange AG, 2021. Alle Rechte vorbehalten.

SIX Swiss Exchange AG

Hardturmstrasse 201
Postfach
CH-8021 Zürich

T + 41 58 399 2100
structured-products@six-swiss-exchange.com
www.six-structured-products.com