

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

| Name | ISIN | Valorennummern | Kurs (per 30.12.2015) |
|--|--------------|----------------|-----------------------|
| SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® | CH0113557455 | 11355745 | 1'341,96 |

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® wies in den Monaten November/Dezember ein Minus von 0,41 % auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine überdurchschnittliche Performance von 0,99 %. Seit Anfang Jahr stieg der SSPC® um 0,58 %, während die Benchmark ein Plus von 2,11 % verzeichnete. Die Minderperformance der Kapitalschutzprodukte des Index, deren Partizipation an den SMI® gekoppelt ist, rührt von der höheren Performance des Swiss Bond Index im Vergleich zum SMI®. Die Volatilität des Strategieindex (7,55 %) lag weiter über derjenigen der Benchmark (5,31 %).

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

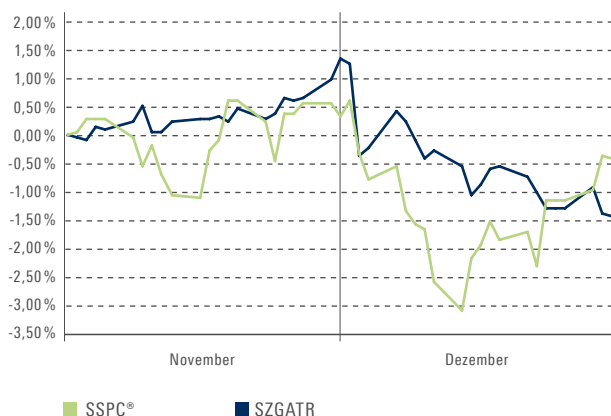
| Zeitraum | SSPC® | Benchmark | Outperformance |
|-------------------------------|---------|-----------|----------------|
| Letzte 2 Monate | -0,41 % | -1,39 % | 0,99 % |
| YTD | 0,58 % | 2,11 % | -1,53 % |
| Seit Lancierung 27.02.2009 | 34,20 % | 26,89 % | 7,30 % |

Zusammensetzung Index per 01.01.2016

| ISIN | Kapitalschutz in % | Emittent | Rückzahlung | SVSP-Bezeichnung |
|--------------|--------------------|--------------------------------|-------------|--|
| CH0141505567 | 90 % | Bank Vontobel | 20.03.17 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0301885890 | 94 % | Bank Vontobel | 16.12.16 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0124744019 | 95 % | Credit Suisse | 23.05.16 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0208891090 | 90 % | Credit Suisse | 06.06.17 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0115890136 | 100 % | EFG International | 15.10.18 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0118173233 | 100 % | EFG International | 14.12.18 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0207112498 | 90 % | Notenstein La Roche Privatbank | 20.03.17 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0228293756 | 90 % | Notenstein La Roche Privatbank | 03.08.18 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |

Performance November/Dezember 2015 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Dezember 2015



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Dezember 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) |
|-------------|-----------------------------|---------------------------------|---------------------------------------|
| 30. Dez 15 | 7,55 % | 5,31 % | 2,60 |
| 30. Okt 15 | 11,75 % | 4,16 % | 3,08 |
| 31. Aug 15 | 12,07 % | 4,61 % | 3,77 |
| 30. Juni 15 | 8,25 % | 5,12 % | 4,00 |
| 29. Apr 15 | 7,87 % | 4,19 % | 3,58 |
| 27. Feb 15 | 17,90 % | 7,87 % | 2,61 |
| 31. Dec 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. Juni 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. Juni 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. Juni 12 | 2,77 % | 3,90 % | 1,48 |

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.