

# SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

## Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 01.07.2016)
SIX Structured Products Participation Index – SSPP®	CH0113557455	11355745	1'956,57

## 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

Der SSPP wies in den Monaten Mai/Juni ein Minus von 0,06% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine unterdurchschnittliche Performance von 0,81%. Seit Beginn der Indexberechnung Ende Februar 2009 stieg der SSPP um 95,66%, während der Vergleichsmassstab ein Plus von 70,98% verzeichnete. Der Strategieindex der Partizipationsprodukte den SMI übertraf somit den Kursindex des Swiss Market Index um 24,68%. Die Volatilität zog wegen des Brexit-Entscheids Grossbritanniens am 24.6. stark an.

## 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

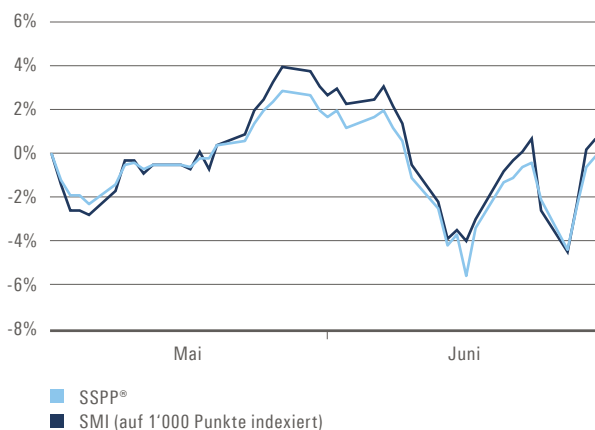
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,06%	0,74%	-0,81%
YTD	-5,09%	-9,05%	3,96%
Seit Lancierung 27.02.2009	95,66%	70,98%	24,68%

## Zusammensetzung Index per 01.07.2016

ISIN	Barriere in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0202770860	64,50%	Bank Julius Bär	11.06.18	Bonus Certificate (1320)
CH0202770944	71,40%	Bank Julius Bär	01.09.17	Bonus Certificate (1320)
CH0214025238	67,50%	UBS	21.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0216758067	68,75%	UBS	10.07.17	Bonus Certificate (1320)
CH0242022017	75,00%	Bank Julius Bär	23.01.17	Bonus Certificate (1320)
CH0248748300	80,00%	Credit Suisse	18.05.17	Bonus Outperformance Certificate (1320)
CH0254430975	70,00%	Bank Vontobel	16.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0301886997	70,50%	Bank Vontobel	16.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0316759700	69,01%	UBS	15.02.19	Bonus Certificate (1320)

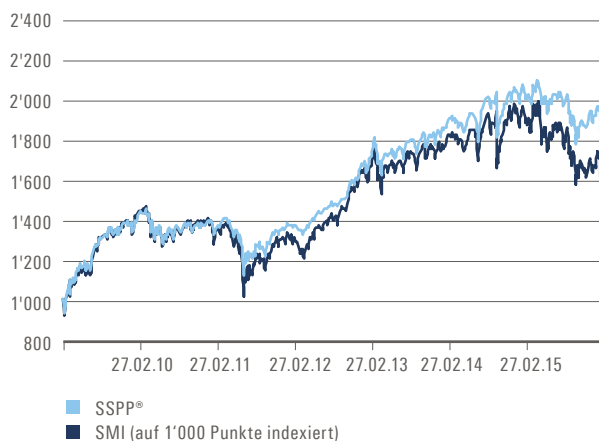
## Performance Mai/Juni 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2016



## Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2016



### Benchmark

Strukturierte 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)
30. Jun 16	22,50%	24,25%	3,78
31. Mai 16	8,78%	12,84%	3,70
29. Apr 16	9,87%	14,34%	3,56
31. Mrz 16	7,49%	12,26%	3,96
29. Feb 16	24,13%	25,86%	3,84
30. Jan 16	19,28%	26,44%	3,92
30. Dez 15	10,56%	17,83%	3,96
30. Nov 15	9,37%	13,59%	3,94
30. Okt 15	9,72%	15,26%	3,73
30. Sep 15	16,42%	24,43%	4,33
31. Aug 15	15,19%	29,09%	4,34
31. Jul 15	9,57%	15,18%	4,32
30. Jun 15	8,55%	14,35%	4,45
29. Mai 15	11,52%	14,89%	4,57
29. Apr 15	9,49%	12,54%	4,44
31. Mär 15	8,43%	11,64%	4,32
27. Feb 15	7,22%	9,50%	4,05
30. Jan 15	31,78%	41,90%	3,30
31. Dec. 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

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