

# SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY®

## Produktdetails

Name	ISIN	Valorenummern	Kurs (per 01.09.2016)
SIX Structured Products Yield Enhancement Index – SSPY®	CH0113557455	11355745	1'389,15

## 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 SSPY wies in den Monaten Juli/August ein Plus von 1,01% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine unterdurchschnittliche Performance von -1,62%. Year-to-Date liegt der SSPY aber mit einer Outperformance von 2,13% vorne. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der Strategieindex der Renditeoptimierungsprodukte ein Plus von 38,92%, während die Benchmark um 59,19% zulegte. Die Volatilität des SSPY lag in den letzten beiden Monaten mit 2,63% deutlich unter den 7,36% der Benchmark.

## 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

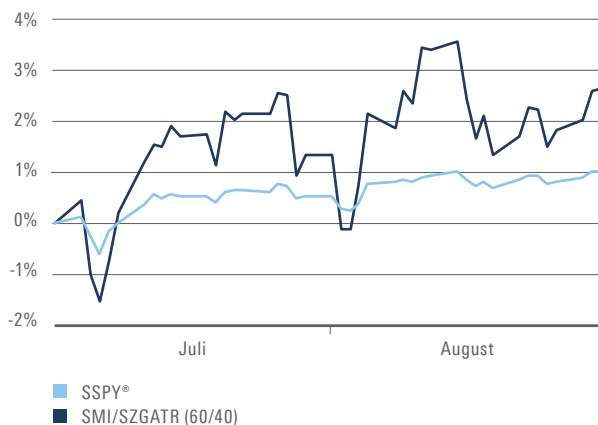
Zeitraum	SSPY®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	1,01%	2,62%	-1,62%
YTD	-0,54%	-2,66%	2,13%
Seit Lancierung 27.02.2009	38,92%	59,19%	-20,28%

## Zusammensetzung Index per 01.09.2016

ISIN	Coupon (p.a.)	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0299692753	6,2%	Bank Julius Bär	20.01.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0300497317	3,0%	Notenstein La Roche Privatbank	29.05.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0300503015	1,0%	Notenstein La Roche Privatbank	28.06.17	Reverse Convertible (1220)
CH0309390083	2,5%	Bank Vontobel	27.01.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0316278446	5,0%	UBS	17.02.17	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0318521009	4,4%	Bank Julius Bär	23.06.17	Barrier Reverse Convertible (1230)

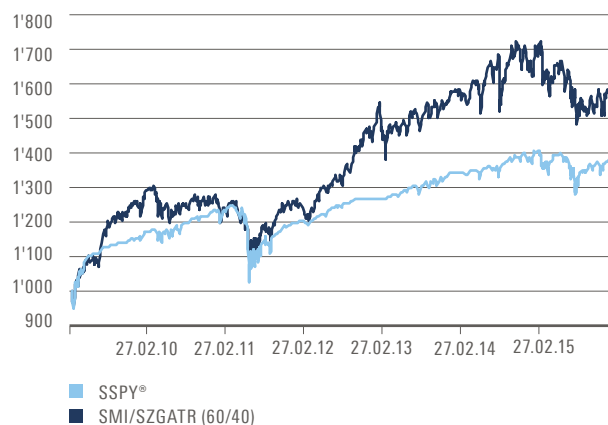
## Performance Juli/August 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, September 2016



## Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, September 2016



## 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 Indexes aller Schweizer Obligationen von Bloomberg (Bloomberg Code: SZGATR). Diese Zusammensetzung entspricht in etwa der Struktur von Renditeoptimierungsprodukten.

## Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (60 Tage)	Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
31. Aug. 16	2,63%	7,36%	1,97
30. Jun. 16	5,80%	11,73%	2,60
29. Apr. 16	4,51%	8,65%	3,01
29. Feb. 16	15,08%	16,64%	4,03
30. Dez. 15	5,61%	11,07%	2,67
30. Okt. 15	9,58%	13,61%	2,99
31. Aug. 15	7,05%	15,18%	3,70
30. Jun. 15	5,36%	10,53%	4,32
29. Apr. 15	2,92%	8,76%	4,33
27. Feb. 15	6,09%	20,75%	4,59
31. Dez. 14	1,83%	9,08%	1,60
31. Okt. 14	3,34%	9,15%	1,40
31. Aug. 14	1,74%	6,48%	1,36
30. Jun. 14	1,44%	4,44%	1,38
30. Apr. 14	4,33%	7,43%	2,15
28. Feb. 14	3,98%	7,27%	2,28
31. Dez. 13	3,16%	6,99%	2,27
31. Okt. 13	1,87%	6,44%	2,15
31. Aug. 13	1,91%	7,83%	1,51
30. Jun. 13	0,55%	14,62%	1,61
30. Apr. 13	0,45%	8,99%	1,58
28. Feb. 13	1,32%	9,07%	1,62

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®, SSPPY® 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