

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorenummer	Kurs (per 01.09.2017)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557521	11355745	1 348.39

Strategie

Der SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® repliziert das Segment der Kapitalschutzprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich dadurch auszeichnen, dass sie das Marktrisiko minimieren indem sie einen bedingten Kapitalerhalt zusichern.

Marktanalyse

Der SIX Structured Products Capital Protection Index (SSPC®) wies in den Monaten Juli/August ein Minus von 0,47% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine unterdurchschnittliche Performance von 1,53%. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der SSPC® einen Anstieg um 34,84%, während die Benchmark um 30,18% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (5,95%) lag Ende August über derjenigen der Benchmark (3,76%).

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

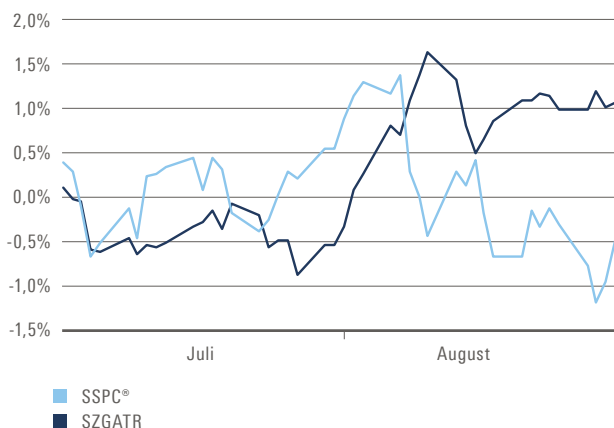
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,47%	1,06%	-1,53%
YTD	5,15%	0,31%	4,85%
Seit Lancierung 27.02.2009	34,84%	30,18%	4,66%

Zusammensetzung Index per 01.09.2017

ISIN	Kapitalschutz	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
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)
CH0228293756	90%	Notenstein La Roche Privatbank	03.08.18	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0228294952	90%	Notenstein La Roche Privatbank	11.03.19	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0266712303	93%	Raiffeisen	30.04.20	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0366669692	90%	Bank Vontobel	07.06.18	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

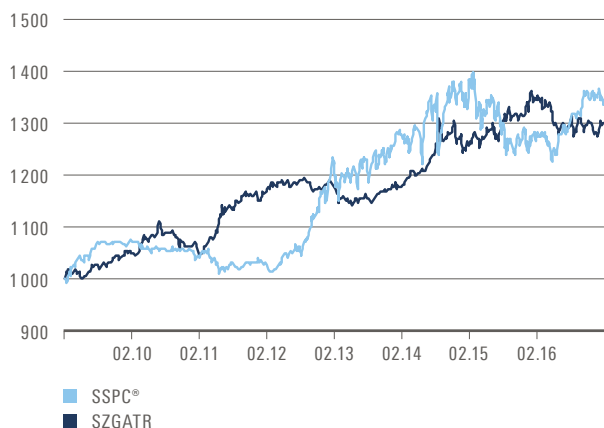
Performance Juli/August 2017 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, September 2017



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, September 2017



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)
31. Aug 17	5,95%	3,76%	2,17
30. Jun 17	4,67%	3,16%	2,83
28. Apr 17	4,14%	5,00%	3,17
28. Feb 17	4,34%	3,94%	2,17
30. Dez 16	6,15%	4,71%	2,17
31. Okt 16	4,75%	4,37%	2,37
31. Aug 16	5,23%	3,32%	2,19
30. Jun 16	7,37%	4,70%	2,30
29. Apr 16	5,54%	3,57%	2,18
29. Feb 16	12,07%	4,96%	2,33
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. Jun 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. Dez 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. Jun 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

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 SSPY® sind eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.
© SIX Swiss Exchange AG, 2017. Alle Rechte vorbehalten.