



SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Strategie-Indizes, Juli 2021

CH0113557521
ISIN

11355745
Valorennummer

1'615.61
Kurs (per 1.7.2021)

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 Mai/Juni ein schönes Plus von 5,05% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Outperformance von 4,87%. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPC® einen Anstieg um 61,56%, während die Benchmark um 38,22% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (5,34%) lag Ende Juni deutlich über derjenigen der Benchmark (1,72%).

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

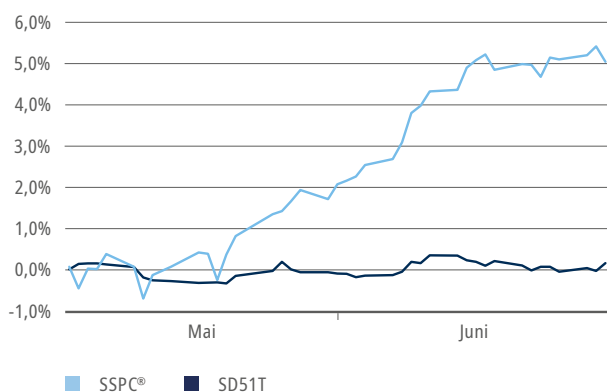
| Zeitraum | SSPC® | Benchmark | Outperformance |
|-------------------------------|--------|-----------|----------------|
| Letzte 2 Monate | 5,05% | 0,18% | 4,87% |
| YTD | 9,75% | 0,65% | 9,10% |
| Seit Lancierung 27.02.2009 | 61,56% | 38,22% | 23,34% |

Zusammensetzung Index per 1.7.2021

| ISIN | Kapitalschutz | Emittent | Rückzahlung | SVSP-Bezeichnung |
|--------------|---------------|----------------------|-------------|--|
| CH0506111209 | 92,00% | Bank Vontobel | 23.05.22 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0392553233 | 90,00% | Raiffeisen | 19.01.23 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0214778281 | 100,00% | Zürcher Kantonalbank | 04.04.24 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0242047170 | 101,00% | Leonteq Securities | 24.10.22 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |
| CH0493466020 | 100,00% | Credit Suisse | 21.03.24 | Capital Protection Certificate with Participation (1100) |

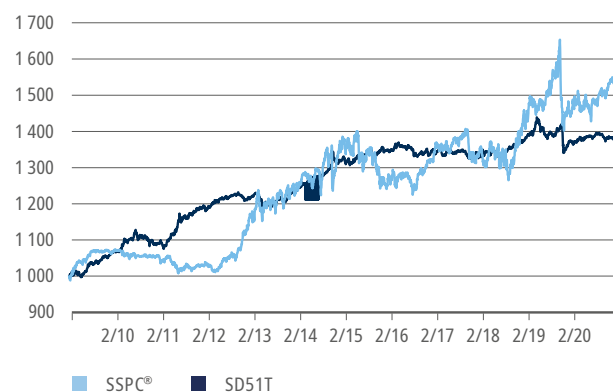
Performance Mai/Juni 2021 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2021



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Juli 2021



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 mit Investment Grade und einer Laufzeit von 5 bis 10 Jahren (Symbol: SD51T) vergleichen.

Weitere Kennzahlen

| Datum Hist. | Hist. Volatilität (60 Tage) | Volatilität (60 Tage) Benchmark | durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage) |
|-------------|-----------------------------|---------------------------------|---------------------------------------|
| 30. Jun 21 | 5,34% | 1,72% | 2,60 |
| 30. Apr 21 | 5,32% | 2,12% | 2,80 |
| 26. Feb 21 | 4,48% | 1,87% | 2,60 |
| 31. Dez 20 | 7,08% | 1,65% | 2,20 |
| 30. Okt 20 | 8,27% | 1,41% | 2,20 |
| 31. Aug 20 | 8,36% | 2,32% | 2,20 |
| 30. Jun 20 | 9,09% | 2,06% | 2,40 |
| 30. Apr 20 | 11,73% | 6,52% | 2,33 |
| 28. Feb 20 | 18,13% | 2,46% | 2,67 |
| 31. Dez 19 | 8,54% | 2,52% | 3,00 |
| 31. Okt 19 | 6,52% | 3,49% | 2,40 |
| 30. Aug 19 | 7,41% | 3,47% | 2,50 |
| 28. Jun 19 | 10,64% | 1,88% | 4,89 |
| 30. Apr 19 | 9,40% | 2,36% | 1,63 |
| 28. Feb 19 | 8,18% | 1,88% | 1,75 |
| 31. Dez 18 | 11,66% | 1,31% | 1,78 |
| 31. Okt 18 | 11,50% | 1,86% | 2,50 |
| 31. Aug 18 | 5,98% | 1,63% | 2,60 |
| 29. Jun 18 | 6,52% | 2,68% | 2,14 |
| 30. Apr 18 | 6,61% | 1,92% | 2,43 |
| 28. Feb 18 | 6,22% | 1,97% | 2,33 |
| 29. Dez 17 | 5,06% | 1,35% | 1,50 |

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, 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