

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 01.01.2014)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'222,00

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.

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.

Marktanalyse

Während der Swiss Bond Index SZGATR über die letzten zwei Monate etwas an Wert verlor, konnte sich der SIX Structured Products Index SSPC® auf fast anfänglichem Niveau behaupten. Dies nachdem sich der SMI von einer Korrektur erholte. Der SSPC® verzeichnet eine positive YTP Performance von 17,29%.

Performance in Zahlen

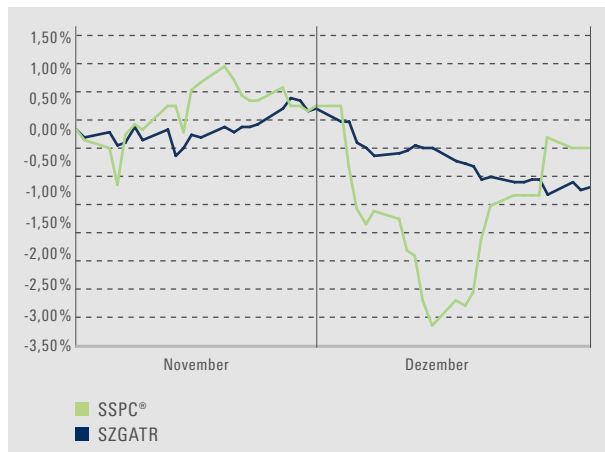
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	-0,31 %	-0,97 %	0,65 %
Year to date	14,03 %	-3,26 %	17,29 %
Seit Lancierung 27.02.2009	22,20 %	14,81 %	7,39 %

Zusammensetzung Index per 01.01.2014

ISIN	Kapitalschutz in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0102151740	100	Goldman Sachs	15.04.16	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0110368559	90	Bank Vontobel	23.04.14	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0111993512	95	Credit Suisse	30.04.15	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0112158958	94	Bank Vontobel	05.01.15	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0120641904	95	Leonteq	30.12.15	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0122306621	95	Credit Suisse	03.07.15	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0207118297	90	Notenstein	23.05.14	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0215791713	95	Bank Vontobel	03.07.14	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0215791747	95	Bank Vontobel	03.07.14	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0124744019	95	Credit Suisse	27.05.16	Kapitalschutz mit Cap (1120)

Performance November/Dezember (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners Research, Januar 2014



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners Research, Januar 2014



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. 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. Jun 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. Jun 12	2,77 %	3,90 %	1,48
30. Apr 12	2,84 %	3,79 %	1,37
29. Feb 12	1,98 %	2,92 %	1,35
31. Dez 11	2,54 %	2,68 %	1,41
31. Okt 11	4,09 %	2,94 %	1,75
31. Aug 11	3,77 %	3,18 %	1,82
30. Jun 11	3,16 %	3,18 %	1,59
30. Apr 11	3,28 %	2,86 %	1,56

Dieses Factsheet enthält periodisch aktualisierte, ergänzende Informationen und Angaben zu den SIX Structured Products Strategie-Indizes. Die Indizes wurden in Zusammenarbeit mit Derivative Partners Research 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 Research AG lehnen jegliche Haftung für Schäden, die aus der Verwendung der SIX Structured Products Strategie-Indizes entstehen, ab. SSPP®, SSPY® und SSPC® sind eingetragene Marken der SIX Structured Products Exchange AG.