

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 30.06.2014)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'270,53

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.

Marktanalyse

Obwohl der seit zwei Monaten anhaltende Bullenmarkt zu positiven Renditen sowohl für die Benchmark als auch für den SSPC® geführt hat, weicht der Level ihrer Performance signifikant voneinander ab (0,98% und 0,52%). Der SSPC® hat dank der in den Strukturierten Produkten einbezogenen Call-Optionen eine grössere Rendite erzielt. Als Folge des Bullenmarkts fällt im Vergleich zu zwei Monaten zuvor gesamthaft ein Absinken des Risikolevels auf.

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

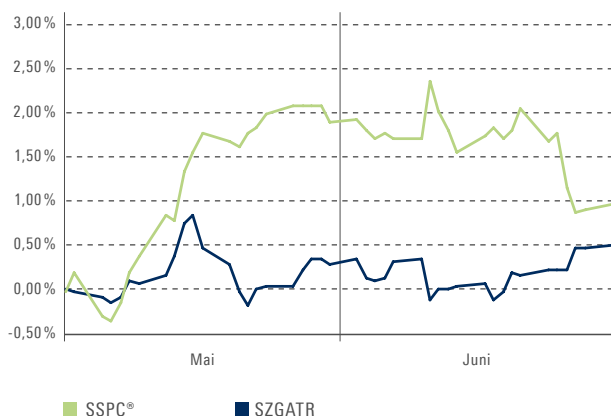
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	0,98%	0,52%	0,46%
YTD	3,97%	3,16%	0,81%
Seit Lancierung 27.02.2009	27,05%	18,44%	8,61%

Zusammensetzung Index per 01.07.2014

ISIN	Kapitalschutz in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0112158958	94	Bank Vontobel	05.01.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0122699421	95	Clariden Leu	03.07.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0207112498	90	Clariden Leu	27.03.2017	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0122306621	95	Credit Suisse	03.07.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0111993512	95	Credit Suisse	30.04.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0124744019	95	Credit Suisse	27.05.2016	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0102151740	100	Goldman Sachs	15.04.2016	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0120641904	95	Leonteq	30.12.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0228511454	90	Leonteq	07.04.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)
CH0242065495	90	Notenstein	22.05.2015	Kapitalschutz mit Partizipation (1100)

Performance Mai/Juni 2014 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners Research, Juli 2014



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners Research, Juli 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)
30.06.2014	3,93 %	2,54%	2,55
30.04.2014	7,51 %	2,92 %	2,76
28.02.2014	6,69 %	2,04 %	2,30
31.12.2013	6,41 %	2,39 %	2,25
31.10.2013	7,35 %	3,06 %	2,61
31.08.2013	6,89 %	2,52 %	2,42
30.06.2013	10,08 %	3,51 %	2,17
30.04.2013	8,84 %	1,65 %	2,31
28.02.2013	6,46 %	2,56 %	2,14
31.12.2012	4,60 %	1,80 %	1,95
31.10.2012	4,39 %	2,20 %	1,73
31.08.2012	3,46 %	2,85 %	1,62
30.06.2012	2,77 %	3,90 %	1,48
30.04.2012	2,84 %	3,79 %	1,37
29.02.2012	1,98 %	2,92 %	1,35
31.12.2011	2,54 %	2,68 %	1,41
31.10.2011	4,09 %	4,02%	1,75
31.08.2011	3,77 %	5,44%	1,82
30.06.2011	3,16 %	3,02%	1,59

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 respektive hinterlegte Marken der SIX Structured Products Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.