

SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 31.10.2014)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'304,22

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

Der SSPC® weist im Vergleich zum Swiss Bond Index SZGATR eine recht hohe Outperformance von 2,09% während der letzten zwei Monate auf. Der Swiss Bond Index hat in diesem 2-Monats-Zeitraum praktisch gar keine Rendite erzielt. Das Renditeplus des Index ist auf weiterhin ansteigende Aktienmärkte zurückzuführen, von denen die Kapitalschutzprodukte des Index aufgrund ihrer Partizipation nach oben profitieren können. Allerdings wird auch die höhere Volatilität des

Index aufgrund des Aktienanteils gegenüber der anleihenbasierten Benchmark ersichtlich.

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

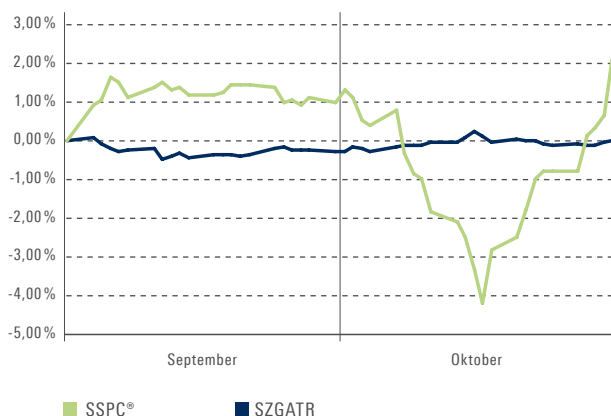
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	2,09 %	0,01 %	2,09 %
YTD	6,73 %	5,40 %	1,32 %
Seit Lancierung 27.02.2009	30,42 %	21,02 %	9,41 %

Zusammensetzung Index per 01.11.2014

ISIN	Kapitalschutz in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0242020516	95	Bank Julius Bär	07.07.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242020532	90	Bank Julius Bär	08.07.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242021134	95	Bank Julius Bär	25.09.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0111993512	95	Credit Suisse	24.04.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0122699421	95	Credit Suisse	26.06.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0124744019	95	Credit Suisse	23.05.2016	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0120641904	95	EFG International	21.12.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0102151740	100	Goldman Sachs	08.04.2016	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0228511454	90	Leonteq Securities	27.03.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0242065495	90	Notenstein Privatbank	13.05.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

Performance September/Oktober 2014 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners Research, November 2014



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners Research, November 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)
30.10.2014	8,54 %	2,38 %	2,60
31.08.2014	6,33 %	2,51 %	2,41
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.