

# SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

**STRUCTURED  
PRODUCTS**


## Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 29.08.2014)
SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®	CH0113557455	11355745	1'277,46

## 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 Vergleichs-Index SZGATR hatte in den letzten zwei Monaten eine starke Entwicklung dank sinkender Renditen bzw. steigender Anleihekursen, welche einher gingen mit den zunehmenden Marktturbulenzen in der ersten Hälfte des Augusts. Diese Entwicklungen wurden nicht durch den SSPC® abgebildet (0,55% verglichen zu 2,17%). Diese Turbulenzen führen ausserdem zu einem Anstieg der historischen Volatilität des Index.

## 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

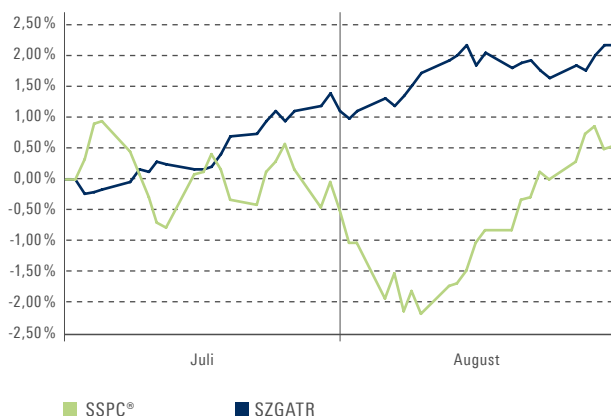
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	0,55 %	2,17 %	-1,62 %
YTD	4,54 %	5,40 %	-0,86 %
Seit Lancierung 27.02.2009	27,75 %	21,01 %	6,74 %

## Zusammensetzung Index per 01.09.2014

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)
CH0112158958	94	Bank Vontobel	23.12.2014	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)
CH0120641904	95	EFG International	21.12.2015	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0122306621	90	EFG International	12.01.2015	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 Juli/August 2014 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners Research, September 2014



## Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners Research, September 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)
31.08.2014	6,45 %	2,48 %	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.