

SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

**STRUCTURED
PRODUCTS**


Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 30.06.2014)
SIX Structured Products Participation Index – SSPP®	CH0113557455	11355745	1'904,29

Strategie

Der SIX Structured Products Participation Index – SSPP® repliziert das Segment der Partizipationsprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich durch eine direkte Teilnahme an der Wertentwicklung eines Basiswerts auszeichnen.

Marktanalyse

Der SSPP® und der SMI® haben sich in den letzten beiden Monaten in gleicher Richtung bewegt. Mit dem Anstieg des SMI® hat sich der SSPP® von seiner Barriere entfernt und replizierte im Wesentlichen das Kursbild des Swiss Markt Index. Man stellt fest, dass das Risikolevel des SSPP® erneut unter dem des SMI® liegt (6,23 % gegenüber 6,90 %), was sich im attraktiven Rendite-Risiko-Profil der Strategie widerspiegelt.

Auswahlkriterien

Der SIX Structured Products Participation Index – SSPP® basiert auf den besten typischen Partizipationsprodukten auf den SMI®. Die Zusammensetzung wird jeden Monat überprüft und gegebenenfalls gemäss Regelwerk angepasst.

Performance in Zahlen

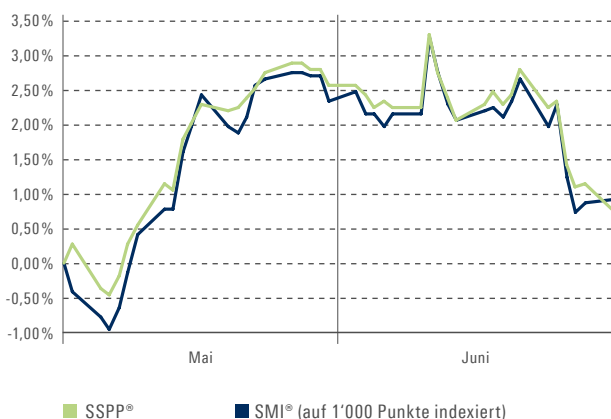
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	0,80 %	0,92 %	-0,12 %
YTD	4,97 %	4,29 %	0,68 %
Seit Lancierung 27.02.2009	90,43 %	82,37 %	8,06 %

Zusammensetzung Index per 01.07.2014

ISIN	Barriere in %	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0225511119	80	Notenstein	04.12.2014	Barrier Reverse Convertible (1230)
CH0112162307	70	Bank Vontobel	16.06.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0186675820	70	Basler Kantonalbank	15.06.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0201202287	70	BCV	03.12.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0209435814	60	BCV	18.03.2016	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0199039691	70	Leonteq	30.11.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0207118156	69	Notenstein	13.05.2016	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0206367655	70	UBS	21.08.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0207356608	70	UBS	11.09.2015	Bonus-Zertifikat (1320)
CH0207630531	75	Zürcher Kantonalbank	09.07.2015	Bonus-Zertifikat (1320)

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

Auch der SSPP® Index braucht einen Vergleichsindex, anhand dessen er sich messen lässt. Da Partizipationsprodukte direkt die Wertentwicklung eines Basiswerts widerspiegeln, lässt sich der SSPP® hervorragend mit dem SMI® vergleichen.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (30 Tage)	Volatilität (30 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (30 Tage)
30.06.2014	6,23 %	6,90 %	3,14
30.05.2014	4,63 %	5,47 %	2,45
30.04.2014	8,06 %	9,01 %	2,51
31.03.2014	11,12 %	12,91 %	2,90
28.02.2014	7,02 %	8,84 %	2,91
31.01.2014	10,13 %	11,65 %	2,90
31.12.2013	8,11 %	12,84 %	2,90
29.11.2013	5,31 %	7,18 %	2,89
31.10.2013	8,80 %	10,34 %	2,74
30.09.2013	7,67 %	8,99 %	2,84
31.08.2013	9,57 %	12,33 %	3,01
31.07.2013	8,11 %	10,77 %	3,25
30.06.2013	17,53 %	24,65 %	3,63
31.05.2013	14,23 %	16,30 %	3,51
30.04.2013	13,74 %	16,92 %	3,61
31.03.2013	11,98 %	9,19 %	3,31
28.02.2013	8,46 %	13,86 %	3,45
31.01.2013	9,65 %	14,35 %	3,40
31.12.2012	3,89 %	6,35 %	3,05
30.11.2012	6,34 %	12,26 %	3,41
31.10.2012	7,29 %	10,46 %	3,60

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.