

SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Produktdetails

Name	ISIN	Valorennummern	Kurs (per 01.01.2017)
SIX Structured Products Participation Index – SSPP®	CH0113557455	11355745	2'040,64

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® wies in den Monaten November/Dezember ein Plus von 4,29% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine unterdurchschnittliche Performance von 0,72%. Im abgelaufenen Jahr verlor der SSPP® allerdings nur 1,01%, während der Vergleichsmassstab ein Minus von 6,78% verzeichnete. Der Strategieindex der Partizipationsprodukte auf den SMI® übertraf im 2016 somit den Kursindex des Swiss Market Index um 5,77%. Die Volatilität des Strategieindex (7,64%) lag erneut deutlich unter derjenigen der Benchmark (10,45%).

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

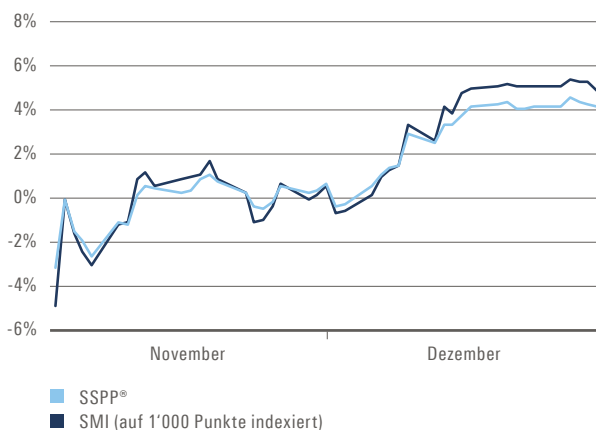
Zeitraum	SSPP®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	4,29%	5,01%	-0,72%
YTD	-1,01%	-6,78%	5,77%
Seit Lancierung 27.02.2009	104,06%	75,24%	28,83%

Zusammensetzung Index per 01.01.2017

ISIN	Barriere	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0301886997	70,50%	Bank Vontobel	16.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0202770944	71,40%	Bank Julius Bär	01.09.17	Bonus Certificate (1320)
CH0254430975	70,00%	Bank Vontobel	16.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0202770860	64,50%	Bank Julius Bär	11.06.18	Bonus Certificate (1320)
CH0216758067	68,75%	UBS	10.07.17	Bonus Certificate (1320)
CH0214025238	67,50%	UBS	21.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0316759700	69,01%	UBS	15.02.19	Bonus Certificate (1320)
CH0300497390	82,50%	Notenstein La Roche Privatbank	29.06.17	Bonus Certificate (1320)
CH0314520971		Notenstein La Roche Privatbank	06.05.19	Outperformance Certificate (1310)
CH0248748300	80,00%	Credit Suisse	18.05.17	Bonus Outperformance Certificate (1330)

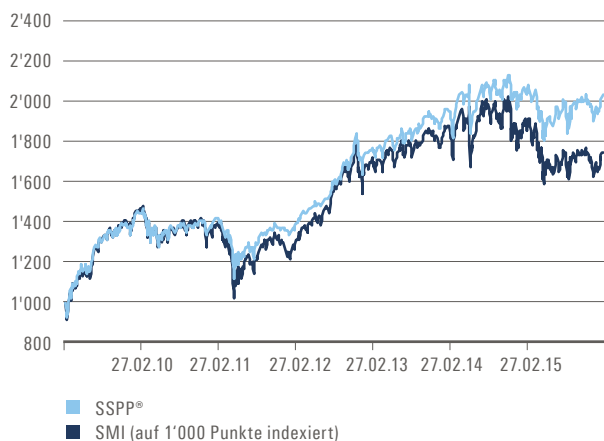
Performance November/Dezember 2016 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2017



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, Januar 2017



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. Dez 16	7,64%	10,45%	2,87
30. Nov 16	9,93%	13,62%	2,87
31. Okt 16	7,78%	10,15%	2,72
30. Sep 16	8,37%	11,36%	3,06
31. Aug 16	8,09%	10,89%	2,95
29. Jul 16	10,76%	11,24%	3,35
30. Jun 16	22,50%	24,25%	3,78
31. Mai 16	8,78%	12,84%	3,70
29. Apr 16	9,87%	14,34%	3,56
31. Mär 16	7,49%	12,26%	3,96
29. Feb 16	24,13%	25,86%	3,84
30. Jan 16	19,28%	26,44%	3,92
30. Dez 15	10,56%	17,83%	3,96
30. Nov 15	9,37%	13,59%	3,94
30. Okt 15	9,72%	15,26%	3,73
30. Sep 15	16,42%	24,43%	4,33
31. Aug 15	15,19%	29,09%	4,34
31. Jul 15	9,57%	15,18%	4,32
30. Jun 15	8,55%	14,35%	4,45
29. Mai 15	11,52%	14,89%	4,57
29. Apr 15	9,49%	12,54%	4,44
31. Mär 15	8,43%	11,64%	4,32

Dieses Factsheet enthält periodisch aktualisierte, ergänzende Informationen und Angaben zu den SIX Structured Products Strategie-Indizes. Die Indizes wurden in Zusammenarbeit mit Derivative Partners 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 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.

SIX Structured Products Exchange AG
Selnaustrasse 30
Postfach
CH-8021 Zürich

T + 41 58 399 2100
F + 41 58 499 2099
structured-products@six-swiss-exchange.com
www.six-structured-products.com