



SIX Structured Products Participation Index – SSPP®

Strategie-Indizes, September 2020

CH0113557455

ISIN

11355745

Valorennummer

2'495.78

Kurs (per 1.9.2020)

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 SIX Structured Products Participation Index (SSPP®) wies in den Monaten Juli/August ein Plus von 2,02 % auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Outperformance von 1,12 %. Seit der Lancierung Ende April 2009 verzeichnete der SSPP® einen Anstieg um 149,58 %, während die Benchmark um 116,08 % zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (11,87 %) lag Ende August unter derjenigen der Benchmark (13,49 %).

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

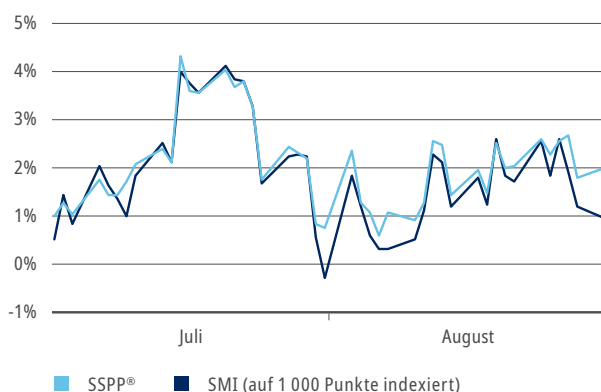
| Zeitraum | SSPP® | Benchmark | Outperformance |
|-------------------------------|---------|-----------|----------------|
| Letzte 2 Monate | 2,02% | 0,90% | 1,12% |
| YTD | -6,69% | -4,53% | -2,16% |
| Seit Lancierung 27.02.2009 | 149,58% | 116,08% | 33,50% |

Zusammensetzung Index per 1.9.2020

| ISIN | Barriere | Emittent | Rückzahlung | SVSP-Bezeichnung |
|--------------|----------|-----------------|-------------|--------------------------|
| CH0410185059 | 62,00% | Bank Julius Bär | 21.06.21 | Bonus Certificate (1320) |
| CH0456281846 | 61,00% | Bank Julius Bär | 07.03.22 | Bonus Certificate (1320) |
| CH0513373123 | 75,00% | UBS | 23.12.20 | Bonus Certificate (1320) |
| CH0493466228 | 57,30% | Credit Suisse | 20.04.23 | Bonus Certificate (1320) |
| CH0532404552 | 65,50% | Bank Julius Bär | 09.06.23 | Bonus Certificate (1320) |

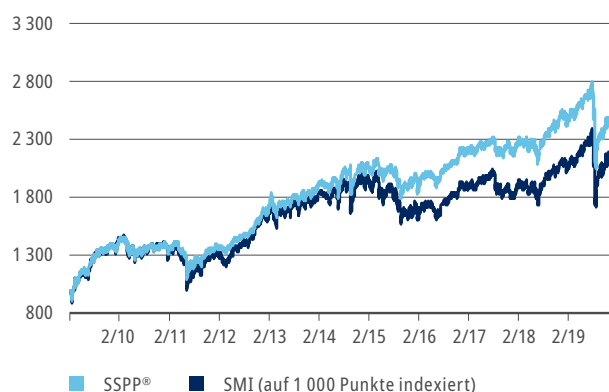
Performance Juli/August 2020 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, September 2020



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, September 2020



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) |
|-------------|-----------------------------|---------------------------------|---------------------------------------|
| 31. Aug 20 | 11,87% | 13,49% | 4,57 |
| 30. Jun 20 | 15,61% | 20,60% | 4,00 |
| 30. Apr 20 | 12,30% | 23,01% | 4,50 |
| 28. Feb 20 | 20,25% | 24,26% | 2,63 |
| 31. Dez 19 | 9,98% | 11,55% | 3,25 |
| 31. Okt 19 | 9,99% | 10,63% | 3,38 |
| 30. Aug 19 | 14,32% | 12,58% | 3,33 |
| 28. Jun 19 | 9,38% | 8,07% | 3,25 |
| 30. Apr 19 | 6,60% | 8,64% | 4,11 |
| 28. Feb 19 | 9,05% | 12,61% | 4,20 |
| 31. Dez 18 | 19,09% | 21,46% | 4,30 |
| 30. Nov 18 | 9,05% | 10,65% | 4,00 |
| 31. Okt 18 | 14,63% | 16,45% | 3,50 |
| 28. Sep 18 | 6,62% | 8,30% | 3,50 |
| 31. Aug 18 | 7,09% | 7,67% | 3,70 |
| 31. Jul 18 | 6,95% | 10,46% | 3,70 |
| 29. Jun 18 | 12,23% | 16,83% | 3,90 |
| 31. Mai 18 | 7,92% | 10,01% | 3,90 |
| 30. Apr 18 | 10,27% | 12,60% | 3,30 |
| 30. Mär 18 | 9,75% | 16,18% | 2,90 |
| 28. Feb 18 | 8,93% | 19,45% | 3,60 |
| 31. Jan 18 | 5,27% | 8,45% | 3,70 |

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. Keine der hierin enthaltenen Informationen begründet ein Angebot oder eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf eines Finanzinstruments oder stellt ein Angebot zur Dienstleistungserbringung dar. SIX Swiss Exchange AG und Derivative Partners AG haften weder dafür, dass die enthaltenen Informationen vollständig, richtig, aktuell und ununterbrochen verfügbar sind, noch für Schäden infolge von Handlungen, die aufgrund von Informationen vorgenommen wurden, die in dieser oder einer anderen Publikation von SIX Swiss Exchange AG oder Derivative Partners AG enthalten sind. SMI®, SSPC®, SSPP® und SSPY® sind eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist. © SIX Swiss Exchange AG, 2020. Alle Rechte vorbehalten.

SIX Swiss Exchange AG

Hardturmstrasse 201
Postfach
CH-8021 Zürich

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