



SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC®

Strategie-Indizes, November 2019

CH0113557521
ISIN

11355745
Valorennummer

1'495.44
Kurs (per 1.11.2019)

Strategie

Der SIX Structured Products Capital Protection Index – SSPC® repliziert das Segment der Kapitalschutzprodukte gemäss SVSP Swiss Derivative Map, die sich dadurch auszeichnen, dass sie das Marktrisiko minimieren indem sie einen bedingten Kapitalerhalt zusichern.

Marktanalyse

Der SIX Structured Products Capital Protection Index (SSPC®) wies in den Monaten September/Oktober ein Plus von 1,28% auf. Relativ zur Benchmark resultierte eine Outperformance von 4,07%. Seit der Lancierung Ende Februar 2009 verzeichnete der SSPC einen Anstieg um 49,54%, während die Benchmark um 39% zulegte. Die historische 60-Tage-Volatilität des Strategieindex (6,52%) lag Ende Oktober über derjenigen der Benchmark (3,49%).

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

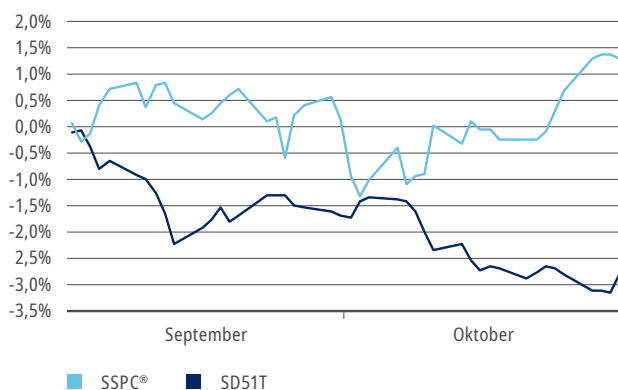
Zeitraum	SSPC®	Benchmark	Outperformance
Letzte 2 Monate	1,28%	-2,79%	4,07%
YTD	16,67%	2,72%	13,95%
Seit Lancierung 27.02.2009	49,54%	39,00%	10,54%

Zusammensetzung Index per 1.11.2019

ISIN	Kapitalschutz	Emittent	Rückzahlung	SVSP-Bezeichnung
CH0480396883	90%	Bank Vontobel	22.06.20	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0461383330	90%	Leonteq Securities	14.09.21	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0464676102	90%	Bank Vontobel	20.03.20	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0451138306	90%	Leonteq Securities	25.01.22	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0469749367	90%	Bank Vontobel	15.04.20	Capital Protection Certificate with Participation (1100)
CH0266712303	93%	Raiffeisen	30.04.20	Capital Protection Certificate with Participation (1100)

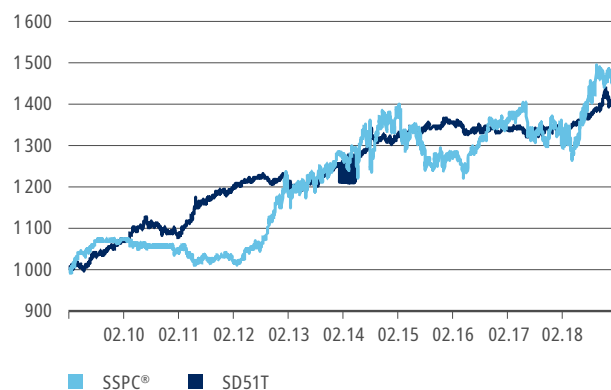
Performance September/Oktober 2019 (Veränderung in %)

Grafik: Derivative Partners, November 2019



Indexentwicklung seit Lancierung (seit 27.02.2009)

Grafik: Derivative Partners, November 2019



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 mit Investment Grade und einer Laufzeit von 5 bis 10 Jahren (Symbol: SD51T) vergleichen.

Weitere Kennzahlen

Datum Hist.	Hist. Volatilität (60 Tage)	Volatilität (60 Tage) Benchmark	durchschnittl. Risikoklasse (60 Tage)
31. Okt 19	6,52%	3,49%	2,40
30. Aug 19	7,41%	3,47%	2,50
28. Jun 19	10,64%	1,88%	4,89
30. Apr 19	9,40%	2,36%	1,63
28. Feb 19	8,18%	1,88%	1,75
31. Dez 18	11,66%	1,31%	1,78
31. Okt 18	11,50%	1,86%	2,50
31. Aug 18	5,98%	1,63%	2,60
29. Jun 18	6,52%	2,68%	2,14
30. Apr 18	6,61%	1,92%	2,43
28. Feb 18	6,22%	1,97%	2,33
29. Dez 17	5,06%	1,35%	1,50
31. Okt 17	4,04%	1,70%	2,33
31. Aug 17	5,95%	1,86%	2,17
30. Jun 17	4,67%	1,46%	2,83
28. Apr 17	4,14%	2,39%	3,17
28. Feb 17	4,34%	1,95%	2,17
30. Dez 16	6,15%	2,73%	2,17
31. Okt 16	4,75%	2,12%	2,37
31. Aug 16	5,23%	1,65%	2,19
30. Jun 16	7,37%	2,32%	2,30
29. Apr 16	5,54%	1,79%	2,18

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, 2017. Alle Rechte vorbehalten.

SIX

Securities & Exchanges
Postfach
CH-8021 Zürich

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