



SIX Swiss Exchange Mitteilung Nr. 37/2016

Titel	Lancierung von SPI Multi Premia Indexfamilie
Kategorie	Indexanpassungen
Autorisiert durch	Werner Bürki, Member of the Management Committee Christian Bahr, Head Market Data and Analytics
Seiten	1
Datum	13.09.2016

Information 

Inhalt dieser Mitteilung:

- SIX Swiss Exchange lanciert die SPI Multi Premia® Indexfamilie für faktorbasiertes Investieren
-

SIX Swiss Exchange führt heute mit dem SPI Multi Premia® eine neue Indexfamilie für faktorbasiertes Investieren ein. Durch die Kombination von sieben verschiedenen Faktoren ermöglicht die neue Indexfamilie eine breite Diversifikation über mehrere Renditequellen. Die 60 grössten und liquidesten Titel aus dem SPI® (Swiss Performance Index) bilden dabei das zugrunde liegende Titeluniversum.

Die neue Indexfamilie umfasst sieben SPI Single Premia Indices® und einen SPI Multi Premia Index® mit dem Ziel der Diversifikation über statistisch signifikante Renditequellen. Als Renditequellen werden die Faktoren Value, Size, Momentum, Residual Momentum, Reversal, Low Risk und Quality herangezogen.

Auf Basis der 60 grössten und liquidesten SPI® Titel investiert jeder SPI Single Premia Index® in einen der sieben Faktoren. Dabei werden jene 30 Titel selektiert, die die besten Werte bezüglich des spezifischen Faktors aufweisen. Die Gewichtung der 30 ausgewählten Titel erfolgt anschliessend so, dass jeder Titel in gleichem Masse zum Gesamtrisiko des betreffenden SPI Single Premia Indices® beiträgt.

Nachfolgend eine Übersicht der Stammdaten:

Name	ISIN	Symbol
SPI Value Premium® CHF (TR)	CH0329197286	SPIVPC
SPI Size Premium® CHF (TR)	CH0329197294	SPISPC
SPI Momentum Premium® CHF (TR)	CH0329197302	SPIMPC
SPI Residual Momentum Premium® CHF (TR)	CH0329197310	SPIRPC
SPI Reversal Premium® CHF (TR)	CH0329197328	SPIRVC
SPI Low Risk Premium® CHF (TR)	CH0329197336	SPILPC
SPI Quality Premium® CHF (TR)	CH0329197344	SPIQPC
SPI Multi Premia® CHF (TR)	CH0329197351	SPIMTC

* Indices in EUR und CHF verfügbar, jeweils als Total Return und Preisindex

Für Fragen steht Ihnen die Indexabteilung gerne zur Verfügung:

Telefon: +41 58 399 5900

E-Mail: customersupport@stox.com

Links zu SIX Swiss Exchange:

www.six-swiss-exchange.com | [Member Section](#) | [Formulare](#) | [Reglemente](#) | [Weisungen](#)