

Swiss Performance Index (SPI®)-Familie

Die SPI®-Familie: SPI® und SPI EXTRA®

Die SPI-Familie umfasst verschiedene, von SIX berechnete und publizierte Börsenindizes, wobei das zugrunde liegende Titel-Universum rund 230 Beteiligungspapiere enthält. Damit ein Titel einer Gesellschaft ins SPI-Universum aufgenommen werden kann, muss die Gesellschaft in der Schweiz primärkotiert sein, und der Titel selbst muss einen frei handelbaren Anteil von grösser oder gleich 20% aufweisen. Im Jahr 1998 wurden die Investmentgesellschaften aus dem Titel-Universum der SPI-Familie ausgegliedert und in einen eigenen Index übergeführt, den Investment-Index. Der Swiss All Share Index, der alle an der SIX primärkotierten Gesellschaften repräsentiert, wird ebenfalls seit 1998 berechnet und publiziert.

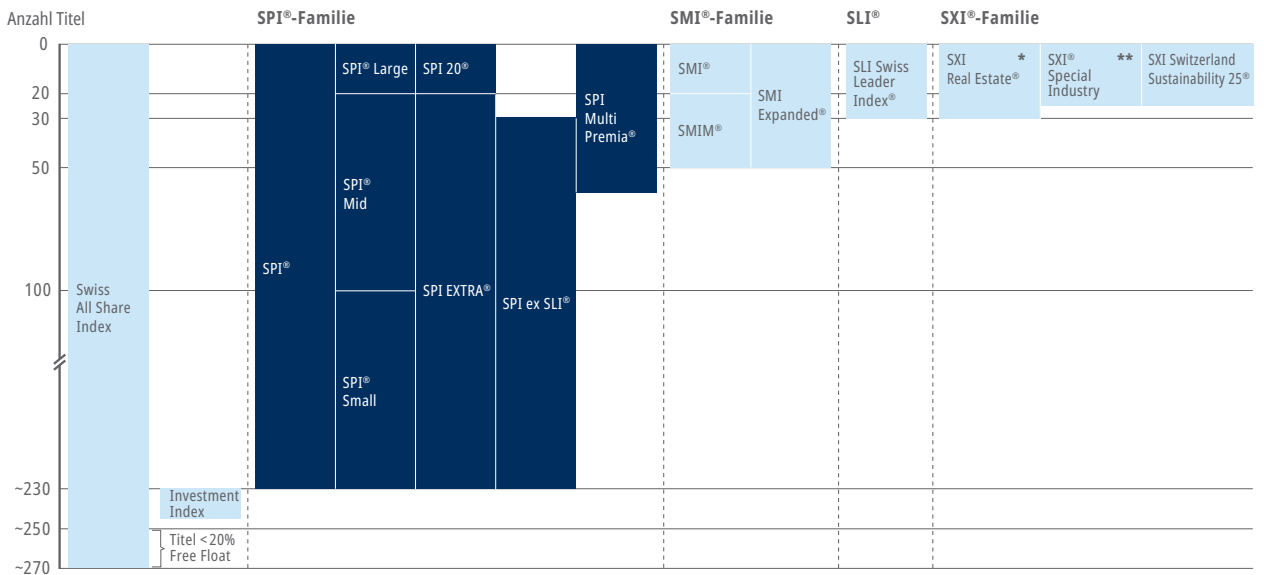
SPI®

Der SPI beinhaltet alle Titel der Indexfamilie und ist gleichzeitig in verschiedene Subindizes unterteilt. Neben der Gliederung in Sektorindizes werden auch Subindizes nach Kapitalisierungsgrösse berechnet: SPI Large, SPI Mid und SPI Small.

SPI EXTRA®

Der SPI EXTRA, welcher seit dem Jahr 2004 publiziert wird, umfasst seinerseits alle SPI-Titel mit Ausnahme der Schweizer Blue-Chips. Diese sind im SMI abgebildet. Der SPI EXTRA ist rasch zu einem unverzichtbaren Benchmark für diejenigen Portfoliomanager geworden, welche ihre Mittel in kleine und mittelgrosse Unternehmen investieren.

Aktienindex-Struktur



* SXI Real Estate®: SXI Real Estate® All Shares, SXI Real Estate® Broad, SXI Real Estate® Shares Broad, SXI Real Estate® Funds Broad, SXI Swiss Real Estate®, SXI Swiss Real Estate® Shares, SXI Swiss Real Estate® Funds

** SXI® Special Industry: SXI Life Sciences®, SXI-Bio+Medtech®

Daten SPI®-Familie

	Symbol	Security no.	ISIN	Reuters RIC	Bloomberg ticker
SPI®					
Price	SPIX	0222235	CH0000222353	.SPIX	SPIND
Total Return	SXGE	998750	CH0009987501	.SSHI	SPI
SPI Extra®					
Price	SPIEXX	1781100	CH0017811008	.SPIEXX	SPIEXX
Total Return	SPIEX	1781097	CH0017810976	.SPIEX	SPIEX
SPI® Large					
Price	SLCIX	62997	CH0000629979	.SBCX	SPIIND
Total Return	SLCI	62983	CH0000629839	.SBCC	SPI21
SPI® Mid					
Price	SMCIX	62992	CH0000629920	.SMIX	SPIMND
Total Return	SMCI	62983	CH0000629821	.SMII	SPI20
SPI® Small					
Price	SSCIX	62991	CH0000629912	.SSIX	SPISMLND
Total Return	SSCI	62975	CH0000629755	.SSCC	SPI19

Risiko-Rendite-Profil

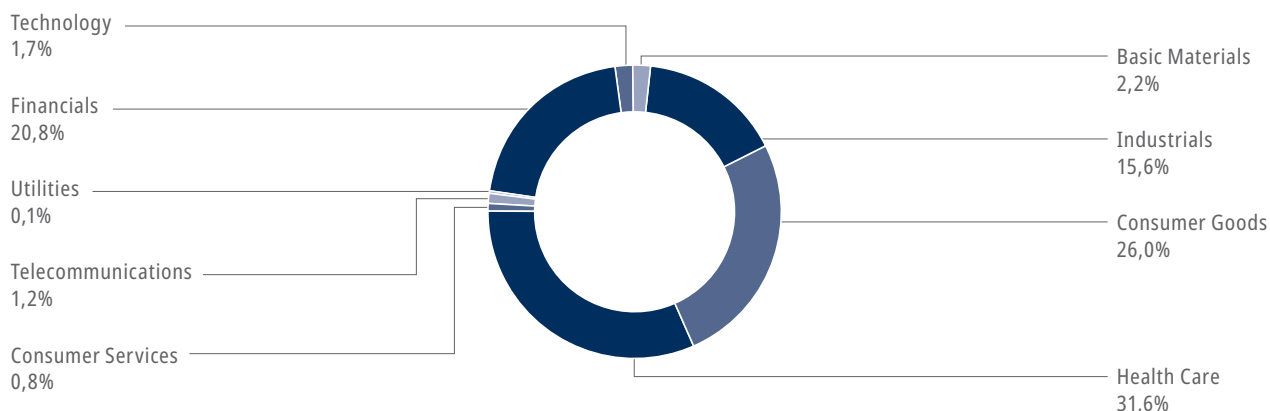
	YTD	Über 1 Jahr	Über 3 Jahre	Über 5 Jahre
Rendite				
SPI®	19,92%	19,92%	6,67%	11,32%
SPI Extra®	29,73%	29,73%	16,04%	17,31%
SPI® Large	17,76%	17,76%	4,76%	9,97%
SPI® Mid	30,70%	30,70%	16,20%	17,99%
SPI® Small	21,06%	21,06%	16,55%	18,52%
Risiko				
SPI®	5,60%	5,60%	12,08%	10,76%
SPI Extra®	7,18%	7,18%	12,10%	10,24%
SPI® Large	5,45%	5,45%	12,31%	11,13%
SPI® Mid	7,53%	7,53%	12,65%	10,69%
SPI® Small	5,27%	5,27%	8,87%	8,09%
Sharpe Ratio				
SPI®	3,28	3,28	1,52	1,71
SPI Extra®	3,69	3,69	1,29	1,58
SPI® Large	3,04	3,04	0,43	0,88
SPI® Mid	3,62	3,62	1,25	1,57
SPI® Small	3,67	3,67	1,77	2,11
Dividenden-Rendite				
SPI®	3,10%	3,10%	3,15%	3,08%
SPI Extra®	2,23%	2,23%	2,31%	2,38%
SPI® Large	3,30%	3,30%	3,33%	3,23%
SPI® Mid	2,20%	2,20%	2,30%	2,37%
SPI® Small	2,08%	2,08%	2,21%	2,22%
Tracking Error*				
SPI Extra®	0,90%	0,90%	1,42%	1,50%
SPI® Large	0,21%	0,21%	0,29%	0,29%
SPI® Mid	0,96%	0,96%	1,47%	1,53%
SPI® Small	1,14%	1,14%	2,11%	2,15%

* Die Benchmark für den SPI Extra®, SPI Large®, SPI Mid® und SPI Small® ist der SPI®

Branchengewichte und Indexkorbuszusammensetzung

SPI®

Die 5 grössten Effekten aus jedem Sektor



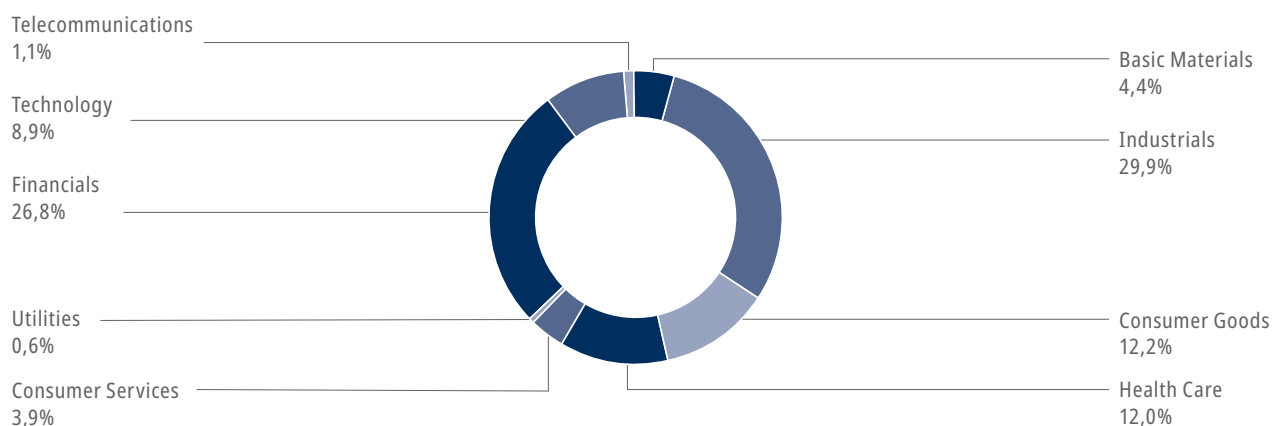
Short Name	Mkt value
Health Care	31,61%
NOVARTIS N	15,01%
ROCHE GS	12,80%
LONZA N	1,45%
SONOVA N	0,61%
STRAUMANN N	0,57%
VIFOR N	0,38%
TECAN GROUP AG N	0,17%
Consumer Goods	25,96%
NESTLE N	19,28%
RICHEMONT N	3,41%
SWATCH GROUP I	0,91%
LINDT N	0,57%
LINDT PS	0,46%
SWATCH GROUP N	0,34%
BARRY CALLEBAUT N	0,34%
Financials	20,78%
UBS GROUP N	5,11%
ZURICH INSURANCE N	3,32%
CS GROUP N	3,12%
SWISS RE N	2,16%
PARTNERS GROUP N	1,12%
JULIUS BAER N	0,99%
SWISS LIFE HOLDING AG N	0,86%

Short Name	Mkt value
Industrials	15,64%
ABB LTD N	3,51%
LAFARGEHOLCIM N	1,95%
SIKA I	1,23%
GEBERIT N	1,18%
SGS N	0,99%
ADECCO N	0,94%
KUEHNE+NAGEL INT N	0,72%
Basic Materials	2,19%
GIVAUDAN N	1,32%
CPH N	0,01%
Technology	1,74%
TEMENOS N	0,56%
AMS	0,43%
LOGITECH N	0,40%
U-BLOX N	0,10%
Telecommunications	1,20%
SWISSCOM N	0,97%
SUNRISE N	0,22%
Consumer Services	0,76%
DUFRY N	0,27%
GALENICA N	0,19%
VALORA N	0,07%
ZUR ROSE GROUP N	0,05%
APG SGA N	0,05%
Utilities	0,12%
BKW N	0,08%
ROMANDE ENERGIE N	0,03%
Total	100,00%

Branchengewichte und Indexkorbbzusammensetzung

SPI Extra®

Die 5 grössten Effekten aus jedem Sektor

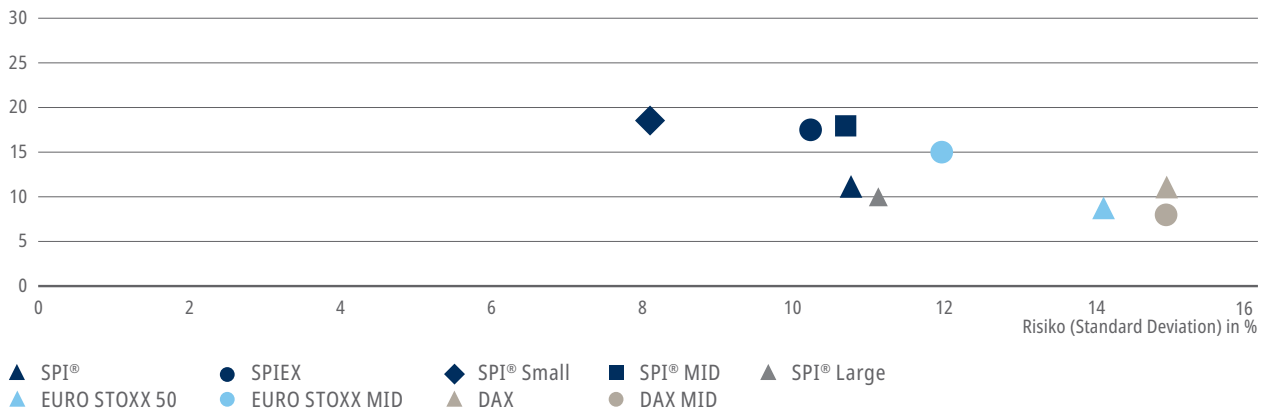


Short Name	Mkt value
Industrials	29,95%
KUEHNE+NAGEL INT N	3,67%
SCHINDLER PS	3,47%
FISCHER N	2,00%
SCHINDLER N	1,63%
FLUGHAFEN ZUERICH N	1,60%
Financials	26,81%
PARTNERS GROUP N	5,75%
BALOISE N	2,81%
SWISS PRIME SITE N	2,44%
PSP N	1,41%
HELVETIA HOLDING N	1,36%
PARGESA I	1,22%
CEMBRA MONEY BANK N	0,97%
GAM N	0,95%
LUMX GROUP N	0,01%
Consumer Goods	12,18%
LINDT N	2,90%
LINDT PS	2,36%
SWATCH GROUP N	1,77%
BARRY CALLEBAUT N	1,75%
ARYZTA N	1,35%
LECLANCHE N	0,03%
AIRESIS N	0,01%
Health Care	12,04%
SONOVA N	3,16%
STRAUMANN N	2,94%
VIFOR N	1,94%
TECAN GROUP AG N	0,90%
IDORSIA N	0,67%
SIEGFRIED N	0,47%
ADDEX N	0,01%

Short Name	Mkt value
Technology	8,95%
TEMENOS N	2,89%
AMS	2,20%
LOGITECH N	2,04%
U-BLOX N	0,51%
ASCOM N 10	0,34%
Basic Materials	4,43%
CLARIANT N	2,27%
EMS-CHEMIE N	1,75%
GURIT I	0,15%
SCHMOLZ+BICKENBACH AG N	0,13%
CHAM PAPER GROUP N	0,08%
CPH N	0,05%
APG SGA N	0,23%
JUNGFRAUBAHN HLD N	0,22%
MOBILEZONE N	0,16%
TAMEDIA N	0,16%
TITL BN BERG N	0,09%
lastminute.com N.V.	0,04%
O FUESSLI N	0,03%
VILLARS N	0,02%
HIGHLIGHT E AND E I	0,01%
Telecommunications	1,15%
SUNRISE N	1,15%
Utilities	0,59%
BKW N	0,44%
ROMANDE ENERGIE N	0,15%
Total	100,00%

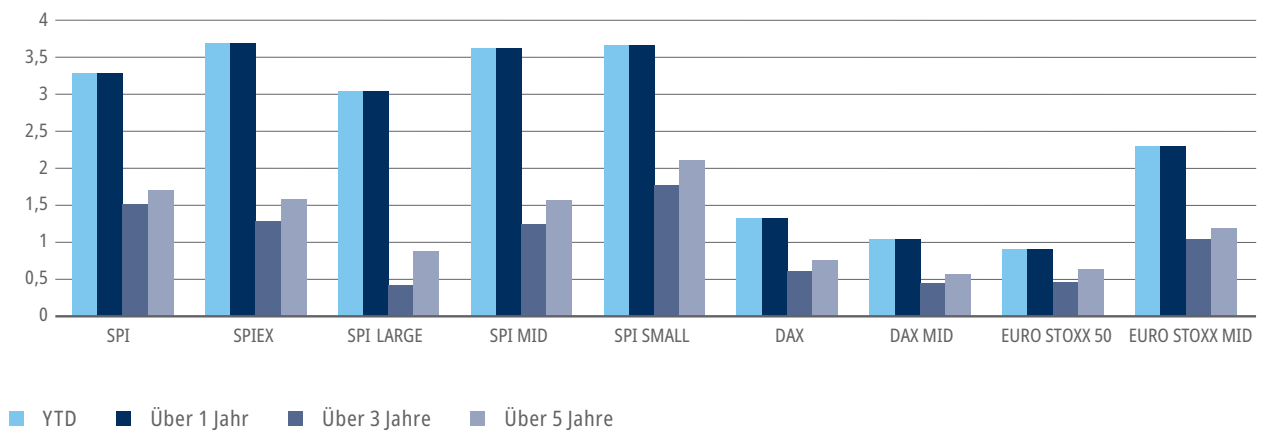
Risiko und Rendite über 5 Jahre

Durchschnittliche Jahreserträge (TR) in %

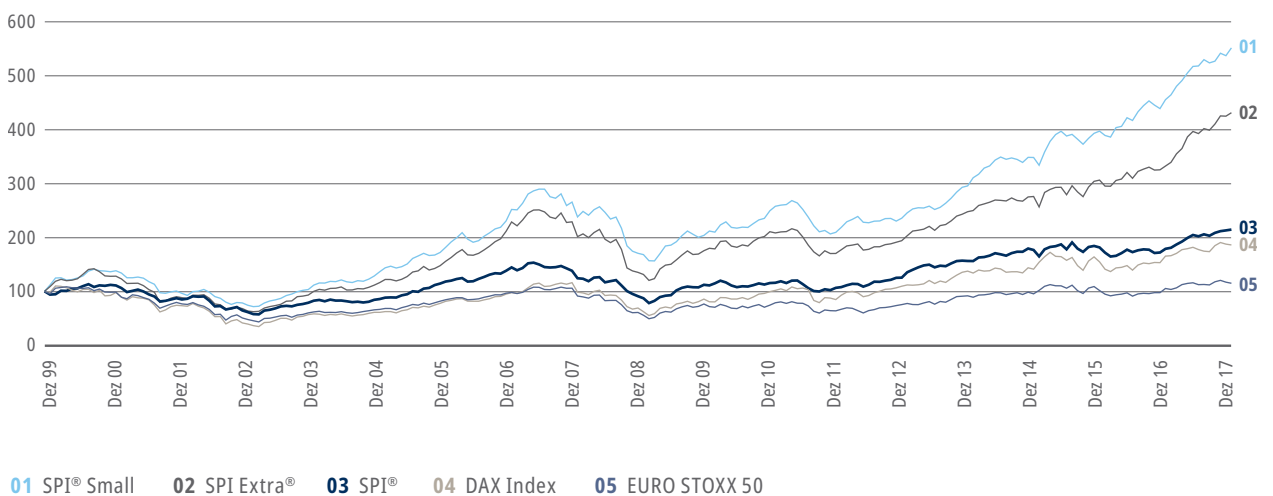


Sharpe Ratio

Sharpe Ratio (TR)



Internationaler Blue-Chip-Index-Performancevergleich (TR, CHF-bereinigt)



Kurzinfo

	SPI®	SPI EXTRA®
Name	Swiss Performance Index®	SPI EXTRA®
Aufnahmekriterien	– An SIX primärkotierte Wertpapiere – Keine Investmentgesellschaften – Freefloat ≥ 20%	– An SIX primärkotierte Wertpapiere – Keine Investmentgesellschaften – Freefloat ≥ 20% – SPI® ohne SMI®-Titel
Berechnungsmethode	Laspeyres Freefloat; kapitalgewichtet	Laspeyres Freefloat; kapitalgewichtet
Nominierung	Total Return Index: 01.06.1987 = 1 000 Price Index: 31.12.1992 = 100	Total Return Index: 31.12.1999 = 1 000 Price Index: 31.12.1999 = 100
Historische Daten seit	03.01.1996	03.01.1996
Lancierung	01.06.1987	29.04.2004
Publikation	Alle 3 Minuten	Alle 3 Minuten
Indekorb-Revision	Am dritten Freitag im September (nach Handelsschluss)	Am dritten Freitag im September (nach Handelsschluss)
Anpassungstermine für Anzahl Titel und Freefloat	Am dritten Freitag im März, Juni, September und Dezember (nach Handelsschluss)	Am dritten Freitag im März, Juni, September und Dezember (nach Handelsschluss)
Anzahl Titel	Small: 105 Middle: 80 Large: 20	Small: 105 Middle: 79 Large: 1
Marktkapitalisierung total (per 29.12.2017)	CHF 1 553 Milliarden	CHF 408 Milliarden
Freefloat Marktkapitalisierung (per 29.12.2017)	CHF 1 353 Milliarden	CHF 263 Milliarden

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Webseite: www.six-group.com/indices

Keine der hierin enthaltenen Informationen begründet ein Angebot oder eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf eines Finanzinstrumentes. SIX Group AG bzw. ihre direkten und indirekten Tochtergesellschaften (nachfolgend SIX) haften weder dafür, dass die enthaltenen Informationen vollständig, richtig, aktuell und ununterbrochen verfügbar sind, noch für Schäden von Handlungen, die aufgrund von Informationen vorgenommen werden, die in dieser oder einer anderen Publikation von SIX enthalten sind. SIX behält sich ausdrücklich vor, jederzeit die Preise oder die Produktzusammenstellung zu ändern.

© SIX Group AG, 2018. Alle Rechte vorbehalten.

® SIX, SIX Swiss Exchange, SMI Indices, SMI, SMI Swiss Market Index, Swiss Market Index (SMI), SMIM, SMI MID (SMIM), SMI Expanded, SPI, Swiss Performance Index (SPI), SPI EXTRA, SPI ex SLI, SPI Select Dividend 20 Index, SPI 20, SPI Multi Premia Index, SPI Single Premia Indices, SPI Value Premium, SPI Size Premium, SPI Momentum Premium, SPI Low Risk Premium, SPI Quality Premium, SPI Residual Momentum Premium, SPI Reversal Premium, SLI, SLI Swiss Leader Index, SXI, SXI Real Estate, SXI Swiss Real Estate, SXI LIFE SCIENCES, SXI Bio+Medtech, SXI Switzerland Sustainability 25, SBI, SBI Swiss Bond Index, SAR, SAR SWISS AVERAGE RATE, SARON, SCR, SCR SWISS CURRENT RATE, SCRON, SAION, SCION, VSMI sind eingetragene respektive hinterlegte Marken von SIX Swiss Exchange AG, deren Verwendung lizenzpflichtig ist.

Alle verwendeten Daten sind auf jährlicher Basis per 29.12.2017 aggregiert. Quelle: SIX Swiss Exchange AG.

SIX
Pfungstweidstrasse 110
Postfach
CH-8021 Zürich
www.six-group.com/indices

Business Support
Index Sales, Licensing and Data
T +41 58 399 2600
indexdata@six-group.com

Technical Support
Index Operations
T +41 58 399 2229
indexsupport@six-group.com