

AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	7.68 %	12.01 %	1.22 %	0.53	0.10	0.93	0.71 %	-7.98 %	4.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	7.75 %	12.01 %	1.22 %	0.54	0.15	0.93	0.77 %	-7.97 %	4.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	7.79 %	12.01 %	1.21 %	0.54	0.19	0.93	0.81 %	-7.96 %	4.00
<i>SPI</i>	<i>7.43 %</i>	<i>12.84 %</i>	<i>-</i>	<i>0.48</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-8.86 %</i>	<i>4.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.77 %	13.18 %	1.10 %	0.42	0.49	0.96	0.84 %	-18.43 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	6.83 %	13.19 %	1.10 %	0.42	0.55	0.96	0.90 %	-18.39 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	6.88 %	13.19 %	1.10 %	0.43	0.58	0.96	0.95 %	-18.37 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>6.12 %</i>	<i>13.68 %</i>	<i>-</i>	<i>0.35</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>9.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	7.40 %	12.82 %	1.11 %	0.48	-0.17	0.97	0.03 %	-18.43 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	7.47 %	12.82 %	1.11 %	0.48	-0.11	0.97	0.11 %	-18.39 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	7.52 %	12.82 %	1.11 %	0.49	-0.08	0.97	0.15 %	-18.37 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>7.55 %</i>	<i>13.16 %</i>	<i>-</i>	<i>0.48</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>9.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	7.75 %	11.51 %	1.14 %	0.56	0.21	0.97	0.50 %	-18.43 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	7.80 %	11.51 %	1.14 %	0.57	0.25	0.97	0.55 %	-18.39 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	7.87 %	11.51 %	1.14 %	0.57	0.31	0.97	0.63 %	-18.37 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>7.45 %</i>	<i>11.85 %</i>	<i>-</i>	<i>0.52</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>9.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus