

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	10.37 %	13.59 %	0.95 %	0.81	-0.56	0.95	0.07 %	-7.23 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	10.44 %	13.59 %	0.95 %	0.82	-0.49	0.95	0.14 %	-7.22 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	10.48 %	13.59 %	0.95 %	0.82	-0.45	0.95	0.18 %	-7.22 %	1.00
<i>SPI</i>	<i>10.87 %</i>	<i>13.60 %</i>	-	<i>0.85</i>	-	-	-	-7.74 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	11.02 %	12.39 %	1.10 %	0.95	-0.33	0.98	-0.17 %	-12.96 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	11.09 %	12.39 %	1.10 %	0.95	-0.27	0.98	-0.09 %	-12.94 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	11.14 %	12.39 %	1.10 %	0.96	-0.23	0.98	-0.05 %	-12.93 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>11.40 %</i>	<i>12.56 %</i>	-	<i>0.96</i>	-	-	-	-12.05 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	9.30 %	11.64 %	0.99 %	0.86	-0.69	0.98	-0.53 %	-12.96 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	9.38 %	11.64 %	0.99 %	0.87	-0.62	0.98	-0.45 %	-12.94 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	9.42 %	11.64 %	0.99 %	0.87	-0.58	0.98	-0.40 %	-12.93 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>10.02 %</i>	<i>11.82 %</i>	-	<i>0.91</i>	-	-	-	-12.05 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	10.68 %	11.15 %	1.09 %	1.02	0.10	0.97	0.46 %	-12.96 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	10.74 %	11.15 %	1.09 %	1.03	0.16	0.97	0.52 %	-12.94 %	9.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	10.82 %	11.15 %	1.09 %	1.04	0.22	0.97	0.60 %	-12.93 %	9.00
<i>SPI</i>	<i>10.52 %</i>	<i>11.40 %</i>	-	<i>0.99</i>	-	-	-	-13.70 %	13.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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