

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	-11.31 %	15.45 %	1.35 %	-0.71	0.90	0.95	0.52 %	-18.43 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	-11.25 %	15.45 %	1.35 %	-0.70	0.94	0.95	0.57 %	-18.39 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	-11.22 %	15.45 %	1.35 %	-0.70	0.97	0.95	0.61 %	-18.37 %	-
<i>SPI</i>	<i>-12.48 %</i>	<i>16.00 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.76</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	2.56 %	13.93 %	1.17 %	0.20	0.03	0.98	0.15 %	-18.43 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	2.63 %	13.93 %	1.17 %	0.21	0.08	0.98	0.21 %	-18.39 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	2.67 %	13.93 %	1.17 %	0.21	0.12	0.98	0.25 %	-18.37 %	-
<i>SPI</i>	<i>2.48 %</i>	<i>14.21 %</i>	<i>-</i>	<i>0.19</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	4.42 %	12.62 %	1.11 %	0.37	-0.32	0.97	-0.18 %	-18.43 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	4.49 %	12.62 %	1.11 %	0.38	-0.25	0.97	-0.11 %	-18.39 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	4.53 %	12.62 %	1.11 %	0.38	-0.21	0.97	-0.06 %	-18.37 %	-
<i>SPI</i>	<i>4.74 %</i>	<i>12.93 %</i>	<i>-</i>	<i>0.39</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	8.53 %	11.58 %	1.13 %	0.76	0.27	0.97	0.64 %	-18.43 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	8.58 %	11.58 %	1.13 %	0.76	0.31	0.97	0.69 %	-18.39 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	8.66 %	11.58 %	1.13 %	0.77	0.37	0.97	0.76 %	-18.37 %	-
<i>SPI</i>	<i>8.16 %</i>	<i>11.90 %</i>	<i>-</i>	<i>0.71</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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