

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	8.52 %	11.43 %	0.92 %	0.61	-0.65	0.96	-0.29 %	-5.34 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	8.59 %	11.43 %	0.92 %	0.62	-0.59	0.96	-0.22 %	-5.32 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	8.63 %	11.43 %	0.92 %	0.62	-0.54	0.96	-0.18 %	-5.30 %	-
<i>SPI</i>	<i>9.13 %</i>	<i>12.05 %</i>	-	<i>0.63</i>	-	-	-	<i>-4.67 %</i>	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	4.63 %	13.31 %	1.13 %	0.23	0.36	0.96	0.60 %	-18.43 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	4.69 %	13.31 %	1.13 %	0.24	0.41	0.96	0.66 %	-18.39 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	4.74 %	13.31 %	1.13 %	0.24	0.45	0.96	0.70 %	-18.37 %	12.00
<i>SPI</i>	<i>4.13 %</i>	<i>13.79 %</i>	-	<i>0.19</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>12.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	5.67 %	12.74 %	1.09 %	0.33	-0.20	0.97	-0.07 %	-18.43 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	5.74 %	12.74 %	1.09 %	0.33	-0.14	0.97	0.00 %	-18.39 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	5.79 %	12.74 %	1.09 %	0.33	-0.10	0.97	0.04 %	-18.37 %	12.00
<i>SPI</i>	<i>5.86 %</i>	<i>13.04 %</i>	-	<i>0.33</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>12.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.80 %	11.51 %	1.14 %	0.46	0.16	0.97	0.41 %	-18.43 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	6.85 %	11.51 %	1.14 %	0.46	0.20	0.97	0.46 %	-18.39 %	12.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	6.92 %	11.51 %	1.14 %	0.47	0.26	0.97	0.53 %	-18.37 %	12.00
<i>SPI</i>	<i>6.56 %</i>	<i>11.86 %</i>	-	<i>0.43</i>	-	-	-	<i>-19.93 %</i>	<i>12.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2013 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.49 % (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