

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	5.31 %	10.68 %	1.27 %	0.35	-0.69	0.93	-0.55 %	-5.66 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	5.38 %	10.68 %	1.27 %	0.35	-0.64	0.93	-0.49 %	-5.64 %	-
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	5.42 %	10.68 %	1.27 %	0.36	-0.61	0.93	-0.44 %	-5.63 %	-
<i>SPI</i>	<i>6.18 %</i>	<i>10.91 %</i>	-	<i>0.42</i>	-	-	-	-6.25 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.01.2024 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	-2.00 %	11.39 %	1.17 %	-0.31	-0.05	0.95	-0.18 %	-18.43 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	-1.94 %	11.39 %	1.17 %	-0.31	0.00	0.95	-0.12 %	-18.39 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	-1.90 %	11.39 %	1.17 %	-0.30	0.03	0.95	-0.08 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>-2.01 %</i>	<i>11.99 %</i>	-	<i>-0.30</i>	-	-	-	-19.93 %	23.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	3.49 %	12.52 %	1.13 %	0.15	-0.31	0.97	-0.24 %	-18.43 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	3.56 %	12.52 %	1.13 %	0.16	-0.25	0.97	-0.18 %	-18.39 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	3.60 %	12.52 %	1.13 %	0.16	-0.22	0.97	-0.13 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>3.80 %</i>	<i>12.86 %</i>	-	<i>0.17</i>	-	-	-	-19.93 %	23.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	5.69 %	11.81 %	1.15 %	0.35	-0.08	0.96	0.10 %	-18.43 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	5.75 %	11.82 %	1.15 %	0.35	-0.04	0.96	0.16 %	-18.39 %	27.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	5.81 %	11.82 %	1.15 %	0.36	0.01	0.96	0.22 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>5.74 %</i>	<i>12.20 %</i>	-	<i>0.34</i>	-	-	-	-19.93 %	23.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (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