

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 | 8.61 % | 11.37 % | 1.27 % | 0.64 | -0.19 | 0.94 | 0.26 % | -5.66 % | 1.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II | 8.68 % | 11.37 % | 1.27 % | 0.65 | -0.14 | 0.94 | 0.33 % | -5.64 % | 1.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III | 8.72 % | 11.37 % | 1.27 % | 0.65 | -0.11 | 0.94 | 0.37 % | -5.63 % | 1.00 |
| <i>SPI</i> | <i>8.79 %</i> | <i>11.52 %</i> | <i>-</i> | <i>0.65</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-6.25 %</i> | <i>1.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

| 3 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|-----------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I | 2.39 % | 11.81 % | 1.18 % | 0.09 | -0.27 | 0.95 | -0.17 % | -15.16 % | 20.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II | 2.46 % | 11.81 % | 1.18 % | 0.10 | -0.22 | 0.95 | -0.11 % | -15.14 % | 20.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III | 2.50 % | 11.82 % | 1.18 % | 0.10 | -0.18 | 0.95 | -0.07 % | -15.12 % | 20.00 |
| <i>SPI</i> | <i>2.64 %</i> | <i>12.44 %</i> | <i>-</i> | <i>0.11</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-15.62 %</i> | <i>20.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

| 5 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|-----------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I | 8.19 % | 12.17 % | 1.12 % | 0.56 | -0.08 | 0.96 | 0.26 % | -18.43 % | 28.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II | 8.26 % | 12.17 % | 1.11 % | 0.57 | -0.02 | 0.96 | 0.33 % | -18.39 % | 28.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III | 8.30 % | 12.17 % | 1.12 % | 0.57 | 0.01 | 0.96 | 0.37 % | -18.37 % | 23.00 |
| <i>SPI</i> | <i>8.22 %</i> | <i>12.65 %</i> | <i>-</i> | <i>0.55</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-19.93 %</i> | <i>23.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

| 10 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|-----------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I | 6.12 % | 11.63 % | 1.09 % | 0.41 | -0.19 | 0.96 | 0.02 % | -18.43 % | 28.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II | 6.18 % | 11.63 % | 1.09 % | 0.42 | -0.14 | 0.96 | 0.08 % | -18.39 % | 28.00 |
| AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III | 6.23 % | 11.63 % | 1.09 % | 0.42 | -0.09 | 0.96 | 0.14 % | -18.37 % | 23.00 |
| <i>SPI</i> | <i>6.28 %</i> | <i>12.02 %</i> | <i>-</i> | <i>0.41</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-19.93 %</i> | <i>23.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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 |