AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX (ASI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	22.52 %	11.85 %	0.11 %	1.89	-1.68	1.00	-0.26 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	22.57 %	11.85 %	0.02 %	1.89	-7.88	1.00	-0.17 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	22.63 %	11.85 %	0.02 %	1.90	-5.31	1.00	-0.11 %	-7.62 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	22.66 %	11.85 %	0.02 %	1.90	-3.65	1.00	-0.08 %	-7.62 %	3.00
SMI TR	*22.74 %*	*11.85 %*	-	*1.91*	-	-	-	*-7.62 %*	*3.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	11.17 %	12.03 %	0.06 %	0.93	-3.24	1.00	-0.23 %	-8.04 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	11.21 %	12.02 %	0.02 %	0.93	-9.41	1.00	-0.17 %	-8.03 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	11.26 %	12.02 %	0.02 %	0.94	-6.81	1.00	-0.12 %	-8.02 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	11.29 %	12.02 %	0.02 %	0.94	-4.61	1.00	-0.09 %	-8.01 %	3.00
SMI TR	*11.39 %*	*12.02 %*	-	*0.95*	-	-	-	*-8.00 %*	*3.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	6.52 %	12.69 %	0.05 %	0.52	-3.93	1.00	-0.21 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	6.56 %	12.68 %	0.02 %	0.52	-9.08	1.00	-0.16 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	6.61 %	12.68 %	0.02 %	0.52	-6.59	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	6.63 %	12.68 %	0.02 %	0.53	-5.06	1.00	-0.09 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	*6.73 %*	*12.68 %*	-	*0.53*	-	-	-	*-17.98 %*	*20.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	9.01 %	11.93 %	0.04 %	0.76	-5.82	1.00	-0.27 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	9.09 %	11.92 %	0.02 %	0.76	-9.11	1.00	-0.19 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	9.15 %	11.93 %	0.02 %	0.77	-6.72	1.00	-0.13 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	9.16 %	11.93 %	0.02 %	0.77	-5.79	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	*9.28 %*	*11.92 %*	-	*0.78*	-	-	-	*-17.98 %*	*20.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus