

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	4.14 %	9.02 %	0.81 %	0.27	-2.39	0.97	-1.88 %	-10.27 %	5.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	4.21 %	9.02 %	0.81 %	0.27	-2.32	0.97	-1.81 %	-10.24 %	5.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	4.25 %	9.02 %	0.81 %	0.28	-2.27	0.97	-1.77 %	-10.22 %	5.00
<i>SPI</i>	<i>6.16 %</i>	<i>9.41 %</i>	<i>-</i>	<i>0.47</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-9.66 %</i>	<i>5.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	2.95 %	12.11 %	1.09 %	0.10	-0.38	0.95	-0.26 %	-18.43 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	3.01 %	12.11 %	1.08 %	0.11	-0.32	0.95	-0.20 %	-18.39 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	3.05 %	12.11 %	1.08 %	0.11	-0.29	0.95	-0.16 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>3.29 %</i>	<i>12.72 %</i>	<i>-</i>	<i>0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.23 %	12.27 %	1.12 %	0.37	-0.32	0.97	-0.18 %	-18.43 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	6.29 %	12.27 %	1.11 %	0.37	-0.27	0.97	-0.11 %	-18.39 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	6.34 %	12.27 %	1.11 %	0.37	-0.23	0.97	-0.07 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.56 %</i>	<i>12.61 %</i>	<i>-</i>	<i>0.38</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.48 %	11.68 %	1.13 %	0.41	-0.09	0.97	0.11 %	-18.43 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	6.53 %	11.68 %	1.13 %	0.41	-0.04	0.97	0.17 %	-18.39 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	6.60 %	11.68 %	1.13 %	0.42	0.01	0.97	0.23 %	-18.37 %	18.00
<i>SPI</i>	<i>6.53 %</i>	<i>12.05 %</i>	<i>-</i>	<i>0.40</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2014 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.71 % (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