

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	17.52 %	12.06 %	0.11 %	1.44	-1.69	1.00	-0.24 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	17.57 %	12.06 %	0.02 %	1.45	-8.69	1.00	-0.16 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	17.63 %	12.07 %	0.02 %	1.45	-5.93	1.00	-0.11 %	-7.62 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	17.66 %	12.07 %	0.02 %	1.45	-4.10	1.00	-0.07 %	-7.62 %	3.00
SMI TR	17.74 %	12.07 %	-	1.46	-	-	-	-7.62 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2025 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	11.26 %	12.11 %	0.06 %	0.93	-3.26	1.00	-0.23 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	11.31 %	12.10 %	0.02 %	0.93	-9.59	1.00	-0.18 %	-7.63 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	11.36 %	12.10 %	0.02 %	0.94	-6.87	1.00	-0.12 %	-7.62 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	11.39 %	12.10 %	0.02 %	0.94	-4.54	1.00	-0.09 %	-7.62 %	3.00
SMI TR	11.49 %	12.10 %	-	0.95	-	-	-	-7.62 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2026 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 %	12.41 %	0.05 %	0.53	-3.92	1.00	-0.21 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	6.56 %	12.40 %	0.02 %	0.53	-9.02	1.00	-0.16 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	6.61 %	12.40 %	0.02 %	0.53	-6.52	1.00	-0.11 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	6.63 %	12.40 %	0.02 %	0.54	-4.91	1.00	-0.09 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	6.73 %	12.40 %	-	0.54	-	-	-	-17.98 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	8.56 %	11.98 %	0.04 %	0.72	-5.74	1.00	-0.26 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	8.63 %	11.98 %	0.02 %	0.72	-9.00	1.00	-0.19 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	8.70 %	11.98 %	0.02 %	0.73	-6.65	1.00	-0.13 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	8.71 %	11.98 %	0.02 %	0.73	-5.66	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
SMI TR	8.82 %	11.98 %	-	0.74	-	-	-	-17.98 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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