

AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 (ASE2)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 II	12.81 %	12.38 %	1.62 %	1.03	-1.04	1.12	-3.76 %	-7.81 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 III	12.92 %	12.38 %	1.62 %	1.04	-0.99	1.12	-3.66 %	-7.80 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 G	12.93 %	12.38 %	1.62 %	1.04	-0.98	1.12	-3.65 %	-7.80 %	3.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>14.85 %</i>	<i>11.27 %</i>	-	<i>1.31</i>	-	-	-	-6.50 %	<i>3.00</i>

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 ERGÄNZUNGSWERTE 2 II	8.12 %	11.11 %	1.51 %	0.73	-1.42	1.07	-3.21 %	-7.81 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 III	8.22 %	11.11 %	1.51 %	0.74	-1.36	1.07	-3.11 %	-7.80 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 G	8.23 %	11.11 %	1.51 %	0.74	-1.35	1.07	-3.11 %	-7.80 %	3.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>10.56 %</i>	<i>10.28 %</i>	-	<i>1.02</i>	-	-	-	-6.50 %	<i>3.00</i>

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 ERGÄNZUNGSWERTE 2 II	0.65 %	13.96 %	1.75 %	0.05	-0.73	1.06	-1.53 %	-31.25 %	48.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 III	0.74 %	13.96 %	1.75 %	0.06	-0.68	1.06	-1.44 %	-31.21 %	48.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 G	0.74 %	13.96 %	1.75 %	0.06	-0.67	1.06	-1.44 %	-31.21 %	48.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>2.05 %</i>	<i>13.06 %</i>	-	<i>0.16</i>	-	-	-	-29.20 %	<i>40.00</i>

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 ERGÄNZUNGSWERTE 2 II	6.84 %	14.13 %	2.18 %	0.48	-0.08	1.03	-0.42 %	-31.25 %	48.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 III	6.97 %	14.13 %	2.18 %	0.49	-0.03	1.03	-0.29 %	-31.21 %	48.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE 2 G	6.97 %	14.13 %	2.18 %	0.49	-0.03	1.03	-0.29 %	-31.21 %	48.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>7.07 %</i>	<i>13.61 %</i>	-	<i>0.52</i>	-	-	-	-30.06 %	<i>41.00</i>

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