OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.95 %	1.61 %	0.08 %	0.62	1.29	1.02	0.09 %	-1.13 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	1.01 %	1.61 %	0.08 %	0.66	2.02	1.02	0.15 %	-1.12 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	1.05 %	1.61 %	0.08 %	0.69	2.52	1.02	0.19 %	-1.12 %	2.00
SBI For. AAA-BBB	*0.84 %*	*1.60 %*	-	*0.56*	-	-	-	*-1.15 %*	*2.00*

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	3.22 %	1.81 %	0.11 %	1.81	0.47	0.99	0.08 %	-1.13 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	3.28 %	1.81 %	0.11 %	1.85	1.01	0.99	0.14 %	-1.12 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	3.32 %	1.81 %	0.11 %	1.87	1.37	0.99	0.18 %	-1.12 %	2.00
SBI For. AAA-BBB	*3.17 %*	*1.82 %*	-	*1.77*	-	-	-	*-1.15 %*	*2.00*

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.15 %	3.17 %	0.27 %	0.07	0.13	0.99	0.04 %	-11.39 %	37.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.21 %	3.17 %	0.27 %	0.09	0.35	0.99	0.10 %	-11.33 %	36.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.25 %	3.17 %	0.27 %	0.10	0.50	0.99	0.14 %	-11.29 %	32.00
SBI For. AAA-BBB	*0.12 %*	*3.18 %*	-	*0.06*	-	-	-	*-11.16 %*	*41.00*

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.09 %	3.29 %	0.36 %	0.05	-0.15	1.03	-0.07 %	-12.81 %	45.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.16 %	3.29 %	0.36 %	0.07	0.02	1.03	0.00 %	-12.64 %	45.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.20 %	3.29 %	0.36 %	0.08	0.13	1.03	0.04 %	-12.53 %	45.00
SBI For. AAA-BBB	*0.15 %*	*3.18 %*	-	*0.07*	-	-	-	*-12.35 %*	*45.00*

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