

WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF (WOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	4.67 %	7.45 %	3.91 %	0.63	1.30	1.35	4.93 %	-4.90 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	4.73 %	7.44 %	3.91 %	0.64	1.32	1.35	4.98 %	-4.87 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	4.77 %	7.44 %	3.92 %	0.64	1.33	1.35	5.03 %	-4.86 %	1.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	-0.20 %	6.67 %	-	-0.02	-	-	-	-5.07 %	-

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	8.23 %	8.28 %	2.57 %	0.99	0.75	1.14	1.09 %	-4.90 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	8.29 %	8.29 %	2.57 %	1.00	0.77	1.14	1.15 %	-4.87 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	8.34 %	8.29 %	2.57 %	1.01	0.79	1.14	1.19 %	-4.86 %	1.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	6.27 %	6.97 %	-	0.90	-	-	-	-5.07 %	-

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	1.49 %	8.61 %	2.33 %	0.18	0.57	1.01	1.32 %	-18.50 %	23.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	1.55 %	8.61 %	2.33 %	0.18	0.60	1.01	1.38 %	-18.41 %	23.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	1.59 %	8.61 %	2.34 %	0.19	0.61	1.01	1.42 %	-18.34 %	23.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	0.17 %	8.18 %	-	0.02	-	-	-	-20.55 %	37.00

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	2.23 %	7.72 %	2.06 %	0.29	0.06	0.97	0.21 %	-21.07 %	24.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	2.32 %	7.72 %	2.06 %	0.30	0.10	0.97	0.30 %	-20.95 %	24.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	2.37 %	7.72 %	2.06 %	0.31	0.13	0.97	0.35 %	-20.86 %	24.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	2.08 %	7.67 %	-	0.28	-	-	-	-21.30 %	44.00

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