

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	2.34 %	1.89 %	0.10 %	1.03	1.06	0.98	0.15 %	-0.46 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	2.40 %	1.89 %	0.10 %	1.06	1.67	0.98	0.21 %	-0.45 %	2.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	2.44 %	1.89 %	0.10 %	1.08	2.08	0.98	0.25 %	-0.45 %	2.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	2.23 %	1.91 %	-	0.96	-	-	-	-0.47 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	4.06 %	2.23 %	0.29 %	1.64	0.44	0.98	0.21 %	-1.33 %	1.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	4.12 %	2.23 %	0.29 %	1.67	0.65	0.98	0.27 %	-1.33 %	1.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	4.17 %	2.23 %	0.29 %	1.69	0.79	0.98	0.31 %	-1.32 %	1.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	3.93 %	2.26 %	-	1.56	-	-	-	-1.36 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.19 %	3.11 %	0.28 %	-0.06	0.12	0.99	0.03 %	-11.39 %	36.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.25 %	3.11 %	0.28 %	-0.04	0.33	0.99	0.09 %	-11.33 %	36.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.29 %	3.11 %	0.28 %	-0.03	0.48	0.99	0.13 %	-11.29 %	32.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	0.16 %	3.11 %	-	-0.07	-	-	-	-11.16 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.34 %	3.30 %	0.44 %	-0.01	-0.04	1.02	-0.02 %	-12.81 %	36.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.41 %	3.30 %	0.44 %	0.01	0.11	1.02	0.05 %	-12.64 %	36.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.45 %	3.30 %	0.44 %	0.02	0.20	1.02	0.09 %	-12.53 %	36.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	0.36 %	3.21 %	-	-0.01	-	-	-	-12.35 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (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