

OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	-1.79 %	2.77 %	0.05 %	-0.63	0.03	1.01	0.02 %	-2.50 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	-1.75 %	2.76 %	0.05 %	-0.61	0.78	1.01	0.06 %	-2.47 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	-1.71 %	2.77 %	0.05 %	-0.60	1.50	1.01	0.10 %	-2.45 %	-
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-1.79 %	2.75 %	-	-0.63	-	-	-	-2.47 %	-

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	2.74 %	3.31 %	0.08 %	0.83	1.06	1.00	0.07 %	-2.50 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	2.78 %	3.31 %	0.08 %	0.85	1.56	1.00	0.12 %	-2.47 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	2.82 %	3.31 %	0.08 %	0.86	2.06	1.00	0.16 %	-2.45 %	-
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	2.65 %	3.29 %	-	0.81	-	-	-	-2.47 %	-

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	-0.44 %	4.90 %	0.19 %	-0.08	-0.06	1.01	-0.01 %	-13.84 %	45.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	-0.40 %	4.90 %	0.19 %	-0.07	0.15	1.01	0.03 %	-13.81 %	45.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	-0.36 %	4.90 %	0.19 %	-0.07	0.36	1.01	0.07 %	-13.77 %	45.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-0.43 %	4.85 %	-	-0.08	-	-	-	-13.63 %	45.00

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	-0.33 %	4.51 %	0.16 %	-0.07	-0.56	1.01	-0.09 %	-17.68 %	45.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	-0.28 %	4.51 %	0.16 %	-0.05	-0.22	1.01	-0.04 %	-17.53 %	45.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	-0.24 %	4.51 %	0.16 %	-0.04	0.03	1.01	0.00 %	-17.42 %	45.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-0.24 %	4.45 %	-	-0.05	-	-	-	-17.17 %	45.00

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