

IMMO OPTIMA SCHWEIZ (IOS)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	-14.19 %	14.56 %	0.81 %	-0.95	2.71	0.98	1.51 %	-14.96 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	-14.14 %	14.56 %	0.81 %	-0.94	2.78	0.98	1.56 %	-14.93 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	-14.10 %	14.56 %	0.81 %	-0.94	2.84	0.98	1.60 %	-14.91 %	-
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>-16.08 %</i>	<i>14.64 %</i>	<i>-</i>	<i>-1.07</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-16.76 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	1.86 %	10.53 %	0.84 %	0.20	0.37	0.98	0.36 %	-15.20 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	1.93 %	10.53 %	0.84 %	0.21	0.44	0.98	0.43 %	-15.14 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	1.98 %	10.53 %	0.84 %	0.21	0.50	0.98	0.48 %	-15.10 %	-
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>1.53 %</i>	<i>10.67 %</i>	<i>-</i>	<i>0.17</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.08 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	3.14 %	9.44 %	0.76 %	0.36	0.22	0.99	0.19 %	-15.20 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	3.21 %	9.44 %	0.76 %	0.37	0.31	0.99	0.26 %	-15.14 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	3.28 %	9.45 %	0.75 %	0.38	0.40	0.99	0.33 %	-15.10 %	-
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>2.97 %</i>	<i>9.47 %</i>	<i>-</i>	<i>0.34</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.08 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	4.38 %	8.34 %	0.66 %	0.56	0.16	0.99	0.15 %	-15.20 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	4.46 %	8.34 %	0.66 %	0.57	0.28	0.99	0.23 %	-15.14 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	4.55 %	8.34 %	0.66 %	0.58	0.40	0.99	0.31 %	-15.10 %	-
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>4.26 %</i>	<i>8.36 %</i>	<i>-</i>	<i>0.54</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.08 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	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