



IMMO OPTIMA SUISSE (IOS)

Indicateurs de risque

| 1 année | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------------------|----------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| IMMO OPTIMA SUISSE I | 11.61 % | 10.21 % | 0.86 % | 0.95 | 1.03 | 1.01 | 0.86 % | -4.57 % | 2.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE II | 11.68 % | 10.21 % | 0.86 % | 0.95 | 1.10 | 1.01 | 0.93 % | -4.56 % | 2.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE III | 11.72 % | 10.21 % | 0.86 % | 0.96 | 1.15 | 1.01 | 0.97 % | -4.56 % | 2.00 |
| <i>SXI Real Estate Funds TR</i> | <i>10.65 %</i> | <i>10.14 %</i> | - | <i>0.86</i> | - | - | - | <i>-4.33 %</i> | <i>2.00</i> |

Période d'observation: 01.07.2023 au 30.06.2024 Période de base: mensuel

| 3 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------------------|----------------|---------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| IMMO OPTIMA SUISSE I | -0.91 % | 9.31 % | 0.76 % | -0.30 | 1.50 | 0.99 | 1.09 % | -16.91 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE II | -0.85 % | 9.31 % | 0.76 % | -0.29 | 1.58 | 0.99 | 1.15 % | -16.80 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE III | -0.81 % | 9.31 % | 0.76 % | -0.29 | 1.64 | 0.99 | 1.19 % | -16.73 % | 8.00 |
| <i>SXI Real Estate Funds TR</i> | <i>-2.04 %</i> | <i>9.37 %</i> | - | <i>-0.42</i> | - | - | - | <i>-19.12 %</i> | <i>8.00</i> |

Période d'observation: 01.07.2021 au 30.06.2024 Période de base: mensuel

| 5 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------------------|---------------|---------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| IMMO OPTIMA SUISSE I | 3.92 % | 9.64 % | 0.79 % | 0.21 | 0.50 | 0.99 | 0.43 % | -16.91 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE II | 3.98 % | 9.64 % | 0.79 % | 0.21 | 0.58 | 0.99 | 0.49 % | -16.80 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE III | 4.03 % | 9.64 % | 0.79 % | 0.22 | 0.64 | 0.99 | 0.54 % | -16.73 % | 8.00 |
| <i>SXI Real Estate Funds TR</i> | <i>3.50 %</i> | <i>9.67 %</i> | - | <i>0.16</i> | - | - | - | <i>-19.12 %</i> | <i>8.00</i> |

Période d'observation: 01.07.2019 au 30.06.2024 Période de base: mensuel

| 10 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------------------|---------------|---------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| IMMO OPTIMA SUISSE I | 5.43 % | 8.66 % | 0.71 % | 0.41 | 0.36 | 1.00 | 0.28 % | -16.91 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE II | 5.50 % | 8.66 % | 0.71 % | 0.41 | 0.46 | 1.00 | 0.35 % | -16.80 % | 8.00 |
| IMMO OPTIMA SUISSE III | 5.58 % | 8.66 % | 0.71 % | 0.42 | 0.56 | 1.00 | 0.43 % | -16.73 % | 8.00 |
| <i>SXI Real Estate Funds TR</i> | <i>5.16 %</i> | <i>8.65 %</i> | - | <i>0.38</i> | - | - | - | <i>-19.12 %</i> | <i>8.00</i> |

Période d'observation: 01.07.2014 au 30.06.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.89 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

| Chiffre-clé | Calcul | Description |
|-----------------------------------|---|--|
| Volatilité | $\sqrt{\text{Variance}}$ | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne |
| Ratio de Sharpe | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$ | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru |
| Tracking error | Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark) | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif) Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$ | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru |
| Coefficient bêta | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$ | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché |
| Alpha de Jensen | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$ | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période |
| Délai de récupération | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée |
| Duration modifiée | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$ | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt |