

IMMO INVEST SCHWEIZ (IIS)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.29 %	1.30 %	0.68 %	2.80	-0.11	0.02	3.58 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.40 %	1.32 %	0.68 %	2.82	0.04	0.02	3.67 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.49 %	1.35 %	0.68 %	2.84	0.17	0.02	3.77 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.61 %	1.37 %	0.68 %	2.87	0.33	0.02	3.87 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.37 %	1.28 %	-	2.90	-	-	-	0.00 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	3.03 %	0.64 %	0.68 %	3.73	-0.65	0.37	1.33 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	3.13 %	0.64 %	0.68 %	3.89	-0.50	0.37	1.43 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	3.23 %	0.63 %	0.68 %	4.04	-0.37	0.37	1.52 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.34 %	0.63 %	0.68 %	4.21	-0.21	0.37	1.63 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	3.49 %	0.48 %	-	5.82	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.02 %	0.81 %	0.75 %	4.13	-0.25	0.65	1.06 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.12 %	0.81 %	0.75 %	4.26	-0.12	0.65	1.15 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.22 %	0.81 %	0.75 %	4.38	0.00	0.65	1.25 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.33 %	0.81 %	0.75 %	4.52	0.15	0.65	1.36 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.22 %	0.57 %	-	6.20	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.93 %	1.05 %	1.00 %	4.04	0.11	0.66	1.54 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	5.04 %	1.06 %	1.00 %	4.13	0.21	0.66	1.65 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	5.14 %	1.06 %	1.00 %	4.23	0.30	0.66	1.75 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.25 %	1.06 %	1.00 %	4.34	0.41	0.66	1.87 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.82 %	0.60 %	-	6.94	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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