

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	4.14 %	1.27 %	-	2.24	-	0.14	2.53 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.25 %	1.29 %	-	2.28	-	0.15	2.61 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.34 %	1.32 %	-	2.31	-	0.14	2.72 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.45 %	1.34 %	-	2.34	-	0.15	2.82 %	0.00 %	-
KGAST-Index	3.65 %	1.18 %	-	-	-	-	-	0.00 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	2.85 %	0.67 %	0.72 %	2.33	-0.90	0.28	1.00 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	2.95 %	0.67 %	0.72 %	2.48	-0.76	0.28	1.09 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	3.04 %	0.67 %	0.72 %	2.62	-0.64	0.28	1.18 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.16 %	0.67 %	0.72 %	2.79	-0.49	0.28	1.29 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	3.31 %	-	-	-	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.07 %	0.81 %	0.76 %	3.40	-0.25	0.64	0.96 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.17 %	0.81 %	0.76 %	3.52	-0.12	0.64	1.06 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.26 %	0.81 %	0.76 %	3.65	0.00	0.64	1.15 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.38 %	0.81 %	0.76 %	3.79	0.14	0.64	1.27 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.15 %	0.57 %	-	5.08	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.96 %	1.05 %	1.00 %	3.48	0.12	0.65	1.40 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	5.07 %	1.05 %	1.00 %	3.57	0.22	0.65	1.50 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	5.17 %	1.05 %	1.00 %	3.67	0.32	0.65	1.60 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.28 %	1.05 %	1.00 %	3.77	0.42	0.65	1.72 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.78 %	0.60 %	-	5.88	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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