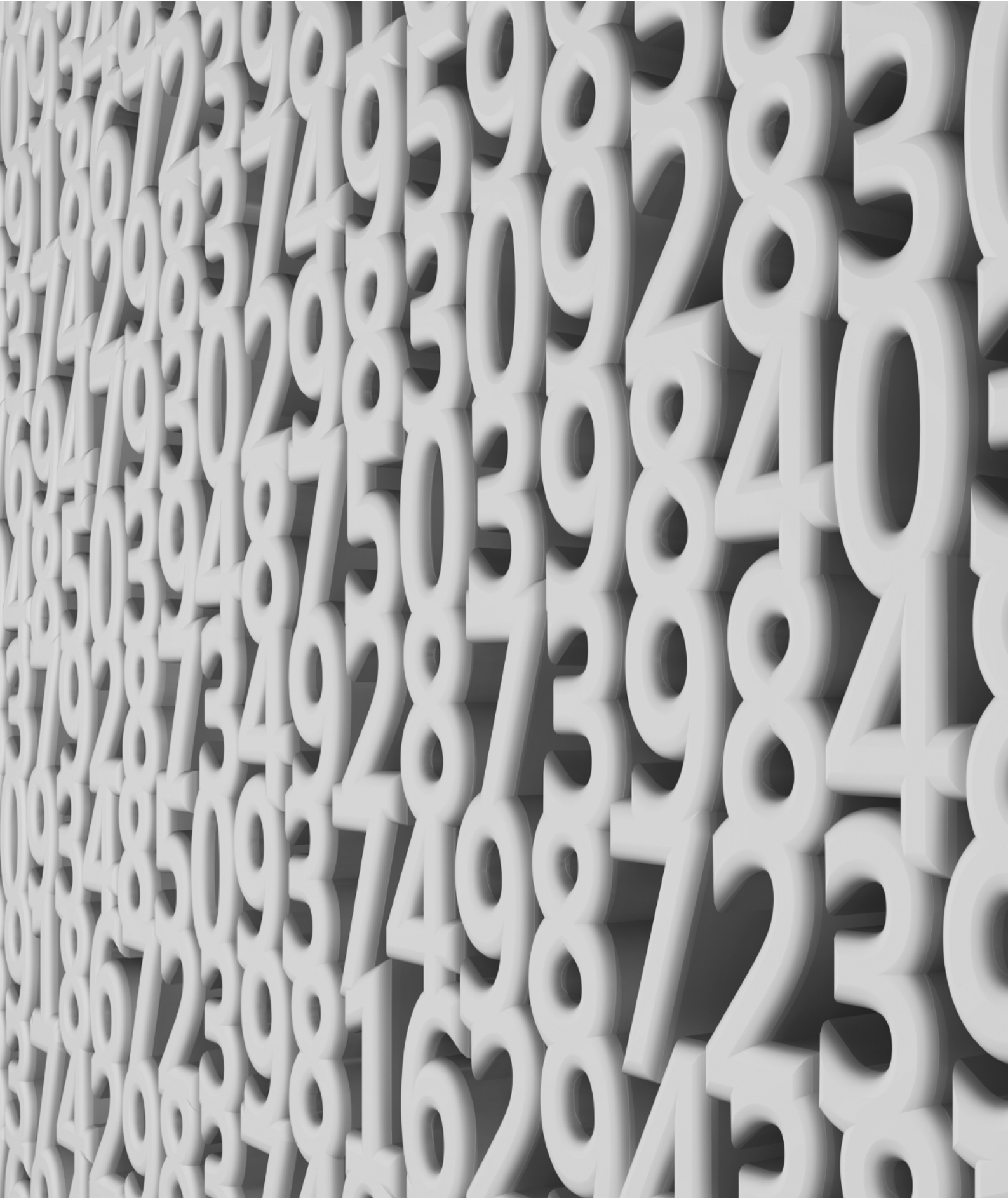




Risikokennzahlen



Anlagegruppen der IST Investmentstiftung

GELDMARKT CHF (GM)	3
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)	4
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)	5
GOVERNO BOND (GB)	6
GOVERNO BOND HEDGED CHF (GBH)	8
OBLIGATIONEN AUSLAND (OA)	9
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF (OAH)	11
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF (GCH)	12
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS (OEM)	13
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF (WOB)	14
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX (ASI)	15
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)	16
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE (ASE)	17
GLOBE INDEX (GI)	18
GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)	19
EUROPE INDEX SRI (EISRI)	20
AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)	21
GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)	23
AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)	24
EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)	25
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)	26
IMMO OPTIMA SCHWEIZ (IOS)	28
IMMO INVEST SCHWEIZ (IIS)	29
IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN (ISW)	30
IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS (ISF)	31
GLOBAL REIT (GR)	32
MIXTA OPTIMA 15 (MO15)	33
MIXTA OPTIMA 25 (MO25)	34
MIXTA OPTIMA 35 (MO35)	36
MIXTA OPTIMA 75 (MO75)	37
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)	38
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)	39
ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)	40

Anlagegruppen der IST2 Investmentstiftung

AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)	41
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE (ASD)	42
MIXTA OPTIMA 30 (MOB)	43
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ (WHS)	44
GLOSSAR	45

GELDMARKT CHF (GM)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GELDMARKT CHF III	0.71 %	0.38 %	0.55 %	-1.52	-0.28	-0.64	-0.85 %	-0.37 %	3.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.86 %	0.04 %	-	-10.15	-	-	-	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
GELDMARKT CHF III	1.00 %	0.45 %	0.38 %	-0.65	0.54	1.03	0.22 %	-0.45 %	4.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.80 %	0.22 %	-	-2.21	-	-	-	-0.26 %	7.00

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
GELDMARKT CHF III	0.45 %	0.42 %	0.33 %	-2.00	0.88	0.93	0.21 %	-1.46 %	11.00
FTSE CHF Eurodep 3m	0.16 %	0.28 %	-	-3.97	-	-	-	-1.82 %	19.00

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
GELDMARKT CHF III	-0.07 %	0.39 %	0.31 %	-3.45	0.96	0.94	0.20 %	-4.12 %	30.00
FTSE CHF Eurodep 3m	-0.37 %	0.25 %	-	-6.54	-	-	-	-6.15 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

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	3.51 %	3.62 %	0.07 %	0.61	2.38	1.01	0.16 %	-1.93 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	3.55 %	3.62 %	0.07 %	0.62	2.93	1.01	0.20 %	-1.92 %	-
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	3.59 %	3.62 %	0.07 %	0.63	3.49	1.01	0.24 %	-1.90 %	-
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	3.33 %	3.62 %	-	0.56	-	-	-	-1.93 %	-

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	1.41 %	5.44 %	0.24 %	0.02	0.25	1.01	0.05 %	-7.17 %	12.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	1.45 %	5.44 %	0.24 %	0.03	0.42	1.01	0.10 %	-7.14 %	12.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	1.49 %	5.44 %	0.24 %	0.04	0.59	1.01	0.14 %	-7.11 %	12.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	1.36 %	5.37 %	-	0.01	-	-	-	-7.06 %	12.00

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	-0.30 %	4.94 %	0.19 %	-0.32	-0.01	1.01	0.01 %	-15.11 %	27.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	-0.26 %	4.94 %	0.20 %	-0.31	0.22	1.01	0.06 %	-15.04 %	27.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	-0.22 %	4.94 %	0.20 %	-0.31	0.42	1.01	0.10 %	-14.97 %	27.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	-0.30 %	4.88 %	-	-0.33	-	-	-	-14.76 %	27.00

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
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX I	-0.01 %	4.58 %	0.16 %	-0.28	-0.75	1.01	-0.11 %	-17.68 %	27.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX II	0.06 %	4.58 %	0.16 %	-0.27	-0.37	1.01	-0.05 %	-17.53 %	27.00
OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX III	0.10 %	4.58 %	0.16 %	-0.26	-0.12	1.01	-0.01 %	-17.42 %	27.00
<i>SBI Dom. AAA-BBB</i>	0.12 %	4.52 %	-	-0.26	-	-	-	-17.17 %	27.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	3.74 %	1.84 %	0.12 %	1.33	0.13	0.97	0.09 %	-0.62 %	1.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	3.80 %	1.84 %	0.12 %	1.36	0.64	0.97	0.15 %	-0.61 %	1.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	3.84 %	1.84 %	0.12 %	1.38	0.98	0.97	0.19 %	-0.61 %	1.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>3.72 %</i>	<i>1.82 %</i>	<i>-</i>	<i>1.33</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-0.65 %</i>	<i>1.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	1.80 %	3.22 %	0.31 %	0.16	0.29	0.99	0.10 %	-5.05 %	14.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	1.86 %	3.22 %	0.31 %	0.18	0.49	0.99	0.16 %	-5.02 %	14.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	1.90 %	3.22 %	0.31 %	0.19	0.62	0.99	0.20 %	-5.00 %	14.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>1.71 %</i>	<i>3.25 %</i>	<i>-</i>	<i>0.13</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.01 %</i>	<i>15.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.78 %	3.25 %	0.29 %	-0.16	0.19	0.99	0.05 %	-11.39 %	30.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.84 %	3.25 %	0.29 %	-0.14	0.40	0.99	0.11 %	-11.33 %	30.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.88 %	3.25 %	0.29 %	-0.13	0.53	0.99	0.15 %	-11.29 %	30.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.72 %</i>	<i>3.26 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.17</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-11.16 %</i>	<i>30.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF I	0.11 %	3.29 %	0.46 %	-0.36	-0.26	1.02	-0.10 %	-12.81 %	30.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF II	0.17 %	3.29 %	0.46 %	-0.34	-0.12	1.02	-0.04 %	-12.64 %	30.00
OBLIGATIONEN AUSLAND CHF III	0.21 %	3.29 %	0.46 %	-0.33	-0.03	1.02	0.00 %	-12.53 %	30.00
<i>SBI For. AAA-BBB</i>	<i>0.23 %</i>	<i>3.20 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.33</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.35 %</i>	<i>30.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

GOVERNO BOND (GB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GOVERNO BOND I	-0.12 %	5.14 %	0.48 %	-0.27	-0.30	1.08	-0.05 %	-2.61 %	4.00
GOVERNO BOND II	-0.06 %	5.14 %	0.48 %	-0.26	-0.17	1.08	0.01 %	-2.57 %	4.00
GOVERNO BOND III	-0.01 %	5.14 %	0.48 %	-0.25	-0.08	1.08	0.05 %	-2.55 %	4.00
<i>JPM Customised</i>	<i>0.04 %</i>	<i>3.74 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.33</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.49 %</i>	<i>3.00</i>

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
GOVERNO BOND I	-4.63 %	6.34 %	0.43 %	-0.93	-0.54	1.00	-0.20 %	-18.15 %	17.00
GOVERNO BOND II	-4.58 %	6.34 %	0.43 %	-0.92	-0.40	1.00	-0.15 %	-18.07 %	17.00
GOVERNO BOND III	-4.54 %	6.34 %	0.43 %	-0.92	-0.30	1.00	-0.11 %	-18.02 %	17.00
<i>JPM Customised</i>	<i>-4.41 %</i>	<i>6.30 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.90</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.71 %</i>	<i>17.00</i>

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
GOVERNO BOND I	-5.00 %	5.68 %	0.43 %	-1.10	-0.50	1.00	-0.19 %	-27.26 %	17.00
GOVERNO BOND II	-4.94 %	5.68 %	0.43 %	-1.09	-0.36	1.00	-0.13 %	-27.11 %	17.00
GOVERNO BOND III	-4.90 %	5.68 %	0.43 %	-1.09	-0.26	1.00	-0.09 %	-27.00 %	17.00
<i>JPM Customised</i>	<i>-4.79 %</i>	<i>5.65 %</i>	<i>-</i>	<i>-1.07</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-26.84 %</i>	<i>17.00</i>

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
GOVERNO BOND I	-1.44 %	5.87 %	0.41 %	-0.46	-0.96	1.01	-0.37 %	-28.06 %	17.00
GOVERNO BOND II	-1.35 %	5.88 %	0.41 %	-0.45	-0.74	1.01	-0.28 %	-27.86 %	17.00
GOVERNO BOND III	-1.30 %	5.88 %	0.41 %	-0.44	-0.61	1.01	-0.23 %	-27.72 %	17.00
<i>JPM Customised</i>	<i>-1.05 %</i>	<i>5.82 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.40</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-27.27 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

GOVERNO BOND (GB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GOVERNO BOND I	-0.12 %	5.14 %	0.94 %	-0.27	-0.21	0.97	-0.22 %	-2.61 %	4.00
GOVERNO BOND II	-0.06 %	5.14 %	0.94 %	-0.26	-0.14	0.97	-0.16 %	-2.57 %	4.00
GOVERNO BOND III	-0.01 %	5.14 %	0.94 %	-0.25	-0.10	0.97	-0.12 %	-2.55 %	4.00
JPM GBI	0.07 %	4.89 %	-	-0.21	-	-	-	-2.78 %	3.00

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
GOVERNO BOND I	-4.63 %	6.34 %	1.75 %	-0.93	-0.16	1.06	0.04 %	-18.15 %	17.00
GOVERNO BOND II	-4.58 %	6.34 %	1.75 %	-0.92	-0.13	1.06	0.09 %	-18.07 %	17.00
GOVERNO BOND III	-4.54 %	6.34 %	1.75 %	-0.92	-0.11	1.06	0.13 %	-18.02 %	17.00
JPM GBI	-4.34 %	5.77 %	-	-0.97	-	-	-	-16.83 %	17.00

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
GOVERNO BOND I	-5.00 %	5.68 %	1.52 %	-1.10	-0.04	1.02	0.03 %	-27.26 %	17.00
GOVERNO BOND II	-4.94 %	5.68 %	1.52 %	-1.09	0.00	1.02	0.09 %	-27.11 %	17.00
GOVERNO BOND III	-4.90 %	5.68 %	1.52 %	-1.09	0.02	1.02	0.13 %	-27.00 %	17.00
JPM GBI	-4.93 %	5.39 %	-	-1.15	-	-	-	-26.77 %	17.00

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
GOVERNO BOND I	-1.44 %	5.87 %	1.76 %	-0.46	-0.25	0.98	-0.46 %	-28.06 %	17.00
GOVERNO BOND II	-1.35 %	5.88 %	1.76 %	-0.45	-0.20	0.99	-0.37 %	-27.86 %	17.00
GOVERNO BOND III	-1.30 %	5.88 %	1.76 %	-0.44	-0.17	0.99	-0.32 %	-27.72 %	17.00
JPM GBI	-1.01 %	5.69 %	-	-0.40	-	-	-	-26.99 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

GOVERNO BOND HEDGED CHF (GBH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-1.78 %	4.40 %	0.44 %	-0.70	-0.45	1.07	-0.01 %	-3.04 %	-
JPM Customised Hedged CHF	-1.58 %	4.22 %	-	-0.68	-	-	-	-2.83 %	-

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
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-4.49 %	6.47 %	0.45 %	-0.89	-0.08	1.01	0.00 %	-15.20 %	17.00
JPM Customised Hedged CHF	-4.45 %	6.41 %	-	-0.89	-	-	-	-15.11 %	17.00

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
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-4.32 %	5.48 %	0.45 %	-1.02	-0.31	1.00	-0.16 %	-23.17 %	17.00
JPM Customised Hedged CHF	-4.18 %	5.48 %	-	-1.00	-	-	-	-22.79 %	17.00

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
GOVERNO BOND HEDGED CHF III	-1.62 %	4.80 %	0.43 %	-0.60	-0.59	1.01	-0.23 %	-23.17 %	17.00
JPM Customised Hedged CHF	-1.37 %	4.76 %	-	-0.56	-	-	-	-22.79 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

OBLIGATIONEN AUSLAND (OA)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND I	0.79 %	5.16 %	0.50 %	-0.10	0.47	1.10	0.30 %	-2.09 %	3.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	0.85 %	5.16 %	0.50 %	-0.09	0.59	1.10	0.36 %	-2.05 %	3.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	0.89 %	5.16 %	0.50 %	-0.08	0.67	1.10	0.40 %	-2.03 %	3.00
<i>Bloomberg Customised</i>	<i>0.56 %</i>	<i>4.99 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-1.90 %</i>	<i>3.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-3.16 %	7.16 %	0.52 %	-0.62	0.96	1.04	0.68 %	-16.39 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-3.10 %	7.16 %	0.52 %	-0.61	1.08	1.04	0.74 %	-16.31 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-3.06 %	7.16 %	0.52 %	-0.61	1.15	1.04	0.78 %	-16.26 %	17.00
<i>Bloomberg Customised</i>	<i>-3.63 %</i>	<i>6.86 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.71</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-16.84 %</i>	<i>17.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-2.59 %	6.33 %	0.65 %	-0.61	0.82	1.05	0.72 %	-26.26 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-2.53 %	6.33 %	0.66 %	-0.60	0.92	1.05	0.79 %	-26.15 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-2.49 %	6.33 %	0.66 %	-0.60	0.98	1.05	0.83 %	-26.07 %	17.00
<i>Bloomberg Customised</i>	<i>-3.10 %</i>	<i>6.01 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.73</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-25.95 %</i>	<i>17.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-0.70 %	5.96 %	0.62 %	-0.33	0.10	1.04	0.12 %	-26.26 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-0.59 %	5.96 %	0.62 %	-0.32	0.26	1.04	0.22 %	-26.15 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-0.54 %	5.96 %	0.62 %	-0.31	0.35	1.04	0.27 %	-26.07 %	17.00
<i>Bloomberg Customised</i>	<i>-0.74 %</i>	<i>5.72 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.35</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-25.95 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

OBLIGATIONEN AUSLAND (OA)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND I	0.79 %	5.16 %	1.41 %	-0.10	0.49	0.85	0.53 %	-2.09 %	3.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	0.85 %	5.16 %	1.41 %	-0.09	0.53	0.85	0.59 %	-2.05 %	3.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	0.89 %	5.16 %	1.41 %	-0.08	0.56	0.85	0.63 %	-2.03 %	3.00
JPM GBI	0.07 %	4.89 %	-	-0.21	-	-	-	-2.78 %	3.00

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-3.16 %	7.16 %	3.16 %	-0.62	0.40	1.12	1.87 %	-16.39 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-3.10 %	7.16 %	3.16 %	-0.61	0.42	1.12	1.92 %	-16.31 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-3.06 %	7.16 %	3.16 %	-0.61	0.43	1.12	1.96 %	-16.26 %	17.00
JPM GBI	-4.34 %	5.77 %	-	-0.97	-	-	-	-16.83 %	17.00

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-2.59 %	6.33 %	3.48 %	-0.61	0.70	0.98	2.23 %	-26.26 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-2.53 %	6.33 %	3.48 %	-0.60	0.72	0.98	2.29 %	-26.15 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-2.49 %	6.33 %	3.48 %	-0.60	0.73	0.98	2.33 %	-26.07 %	17.00
JPM GBI	-4.93 %	5.39 %	-	-1.15	-	-	-	-26.77 %	17.00

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
OBLIGATIONEN AUSLAND I	-0.70 %	5.96 %	3.68 %	-0.33	0.07	0.84	-0.06 %	-26.26 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND II	-0.59 %	5.96 %	3.68 %	-0.32	0.10	0.84	0.04 %	-26.15 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND III	-0.54 %	5.96 %	3.68 %	-0.31	0.11	0.84	0.09 %	-26.07 %	17.00
JPM GBI	-1.01 %	5.69 %	-	-0.40	-	-	-	-26.99 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF (OAH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF I	-0.82 %	3.73 %	0.58 %	-0.57	-0.04	1.02	0.01 %	-2.14 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF II	-0.76 %	3.73 %	0.58 %	-0.55	0.06	1.02	0.07 %	-2.11 %	-
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF III	-0.72 %	3.73 %	0.58 %	-0.54	0.13	1.02	0.11 %	-2.09 %	-
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-0.80 %</i>	<i>3.87 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.49</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.34 %</i>	<i>-</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF I	-2.86 %	6.64 %	0.59 %	-0.62	0.70	1.00	0.41 %	-12.37 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF II	-2.80 %	6.64 %	0.59 %	-0.62	0.81	1.00	0.47 %	-12.29 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF III	-2.77 %	6.64 %	0.59 %	-0.61	0.87	1.00	0.51 %	-12.23 %	17.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-3.27 %</i>	<i>6.59 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.69</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-12.97 %</i>	<i>17.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF I	-2.32 %	5.73 %	0.68 %	-0.63	0.72	1.01	0.51 %	-20.59 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF II	-2.26 %	5.73 %	0.68 %	-0.62	0.81	1.01	0.57 %	-20.46 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF III	-2.22 %	5.73 %	0.68 %	-0.61	0.87	1.01	0.61 %	-20.36 %	17.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-2.80 %</i>	<i>5.65 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.72</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>17.00</i>

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
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF I	-0.87 %	4.78 %	0.63 %	-0.45	0.16	1.02	0.13 %	-20.59 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF II	-0.76 %	4.78 %	0.63 %	-0.43	0.32	1.02	0.23 %	-20.46 %	17.00
OBLIGATIONEN AUSLAND HEDGED CHF III	-0.71 %	4.78 %	0.63 %	-0.42	0.40	1.02	0.28 %	-20.36 %	17.00
<i>Bloomberg Customised Hedged CHF</i>	<i>-0.96 %</i>	<i>4.66 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.48</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.58 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF (GCH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	0.96 %	4.43 %	0.47 %	-0.07	0.15	1.02	0.08 %	-2.82 %	3.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	<i>0.90 %</i>	<i>4.15 %</i>	<i>-</i>	<i>0.04</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.71 %</i>	<i>3.00</i>

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
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	-2.07 %	8.04 %	0.58 %	-0.42	0.31	1.04	0.30 %	-13.54 %	17.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	<i>-2.23 %</i>	<i>7.70 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.46</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-13.19 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBAL CORPORATES IG HEDGED CHF III	-2.92 %	6.96 %	0.63 %	-0.60	0.11	1.04	0.20 %	-21.32 %	17.00
<i>Bloomberg Global Agg - Corporate TR CHF Hedged</i>	<i>-2.97 %</i>	<i>6.70 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.63</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-20.92 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.09.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS (OEM)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS I	0.21 %	7.36 %	1.07 %	-0.15	-1.78	1.14	-2.10 %	-3.16 %	5.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS II	0.28 %	7.36 %	1.06 %	-0.14	-1.74	1.14	-2.03 %	-3.13 %	5.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS III	0.32 %	7.36 %	1.05 %	-0.13	-1.70	1.14	-1.99 %	-3.11 %	5.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>2.18 %</i>	<i>6.94 %</i>	<i>-</i>	<i>0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.32 %</i>	<i>1.00</i>

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
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS I	0.94 %	6.33 %	1.44 %	-0.06	-0.29	1.03	-0.43 %	-6.66 %	9.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS II	1.00 %	6.33 %	1.43 %	-0.05	-0.24	1.03	-0.37 %	-6.65 %	9.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS III	1.05 %	6.33 %	1.44 %	-0.04	-0.22	1.03	-0.33 %	-6.63 %	9.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>1.37 %</i>	<i>6.00 %</i>	<i>-</i>	<i>0.01</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-6.89 %</i>	<i>18.00</i>

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
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS I	0.61 %	7.35 %	1.34 %	-0.09	0.11	1.03	0.15 %	-17.57 %	30.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS II	0.67 %	7.35 %	1.34 %	-0.08	0.15	1.03	0.22 %	-17.51 %	30.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS III	0.71 %	7.35 %	1.34 %	-0.08	0.19	1.03	0.26 %	-17.46 %	30.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>0.48 %</i>	<i>7.01 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.12</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-18.11 %</i>	<i>30.00</i>

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
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS I	-0.23 %	9.48 %	1.32 %	-0.16	-0.38	1.06	-0.50 %	-21.68 %	30.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS II	-0.15 %	9.48 %	1.32 %	-0.15	-0.33	1.06	-0.43 %	-21.55 %	30.00
OBLIGATIONEN EMERGING MARKETS III	-0.11 %	9.48 %	1.32 %	-0.15	-0.30	1.06	-0.39 %	-21.46 %	30.00
<i>JPM GBI EM Glb DivUnhdg</i>	<i>0.33 %</i>	<i>8.90 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-22.44 %</i>	<i>30.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF (WOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	4.06 %	4.97 %	0.90 %	0.55	-1.45	0.99	-1.31 %	-2.04 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	4.12 %	4.97 %	0.90 %	0.57	-1.38	0.99	-1.25 %	-2.04 %	1.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	4.16 %	4.97 %	0.91 %	0.57	-1.33	0.99	-1.21 %	-2.03 %	1.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>5.43 %</i>	<i>5.50 %</i>	<i>-</i>	<i>0.78</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.19 %</i>	<i>4.00</i>

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	-0.60 %	8.25 %	1.63 %	-0.23	-0.51	0.92	-0.86 %	-12.84 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	-0.54 %	8.25 %	1.63 %	-0.22	-0.47	0.92	-0.80 %	-12.76 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	-0.50 %	8.25 %	1.63 %	-0.22	-0.45	0.92	-0.76 %	-12.70 %	17.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>0.17 %</i>	<i>8.80 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.13</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-13.00 %</i>	<i>26.00</i>

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	2.70 %	8.10 %	1.93 %	0.17	-0.40	0.92	-0.55 %	-21.07 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	2.76 %	8.10 %	1.93 %	0.18	-0.37	0.92	-0.48 %	-20.95 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	2.80 %	8.10 %	1.93 %	0.19	-0.34	0.92	-0.44 %	-20.86 %	17.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>3.42 %</i>	<i>8.63 %</i>	<i>-</i>	<i>0.25</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>30.00</i>

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
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEDGED CHF I	0.59 %	7.10 %	1.61 %	-0.10	-0.36	0.91	-0.54 %	-21.07 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF II	0.69 %	7.10 %	1.61 %	-0.08	-0.29	0.91	-0.44 %	-20.95 %	17.00
WANDELOBLIGATIONEN GLOBAL HEGDED CHF III	0.76 %	7.10 %	1.61 %	-0.07	-0.25	0.91	-0.38 %	-20.86 %	17.00
<i>Refinitiv Global Conv. Comp. Hedged CHF</i>	<i>1.12 %</i>	<i>7.59 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.02</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.30 %</i>	<i>30.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX (ASI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	10.54 %	12.18 %	0.01 %	0.76	-15.79	1.00	-0.23 %	-6.65 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	10.59 %	12.18 %	0.01 %	0.76	-12.69	1.00	-0.18 %	-6.64 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	10.64 %	12.18 %	0.01 %	0.76	-9.44	1.00	-0.13 %	-6.62 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	10.67 %	12.18 %	0.02 %	0.77	-4.64	1.00	-0.09 %	-6.60 %	1.00
<i>SMI TR</i>	<i>10.77 %</i>	<i>12.19 %</i>	-	<i>0.77</i>	-	-	-	<i>-6.59 %</i>	<i>1.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	4.07 %	12.61 %	0.02 %	0.22	-11.69	1.00	-0.21 %	-15.11 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	4.11 %	12.61 %	0.02 %	0.22	-9.36	1.00	-0.17 %	-15.10 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	4.16 %	12.61 %	0.02 %	0.23	-7.03	1.00	-0.12 %	-15.09 %	18.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	4.18 %	12.61 %	0.02 %	0.23	-5.28	1.00	-0.10 %	-15.08 %	18.00
<i>SMI TR</i>	<i>4.28 %</i>	<i>12.62 %</i>	-	<i>0.24</i>	-	-	-	<i>-15.05 %</i>	<i>18.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	9.29 %	12.82 %	0.02 %	0.62	-10.15	1.00	-0.22 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	9.33 %	12.82 %	0.02 %	0.62	-7.90	1.00	-0.17 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	9.38 %	12.82 %	0.02 %	0.63	-5.75	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	9.40 %	12.82 %	0.02 %	0.63	-4.93	1.00	-0.11 %	-18.04 %	20.00
<i>SMI TR</i>	<i>9.50 %</i>	<i>12.82 %</i>	-	<i>0.64</i>	-	-	-	<i>-17.98 %</i>	<i>20.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX I	6.35 %	12.26 %	0.03 %	0.41	-9.87	1.00	-0.28 %	-18.09 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX II	6.44 %	12.26 %	0.02 %	0.42	-9.36	1.00	-0.19 %	-18.07 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX III	6.50 %	12.26 %	0.02 %	0.42	-6.63	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX G	6.51 %	12.26 %	0.02 %	0.42	-6.05	1.00	-0.12 %	-18.04 %	20.00
<i>SMI TR</i>	<i>6.63 %</i>	<i>12.26 %</i>	-	<i>0.43</i>	-	-	-	<i>-17.98 %</i>	<i>20.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	8.61 %	11.37 %	1.27 %	0.64	-0.19	0.94	0.26 %	-5.66 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	8.68 %	11.37 %	1.27 %	0.65	-0.14	0.94	0.33 %	-5.64 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	8.72 %	11.37 %	1.27 %	0.65	-0.11	0.94	0.37 %	-5.63 %	1.00
<i>SPI</i>	<i>8.79 %</i>	<i>11.52 %</i>	<i>-</i>	<i>0.65</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-6.25 %</i>	<i>1.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	2.39 %	11.81 %	1.18 %	0.09	-0.27	0.95	-0.17 %	-15.16 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	2.46 %	11.81 %	1.18 %	0.10	-0.22	0.95	-0.11 %	-15.14 %	20.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	2.50 %	11.82 %	1.18 %	0.10	-0.18	0.95	-0.07 %	-15.12 %	20.00
<i>SPI</i>	<i>2.64 %</i>	<i>12.44 %</i>	<i>-</i>	<i>0.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-15.62 %</i>	<i>20.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	8.19 %	12.17 %	1.12 %	0.56	-0.08	0.96	0.26 %	-18.43 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	8.26 %	12.17 %	1.11 %	0.57	-0.02	0.96	0.33 %	-18.39 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	8.30 %	12.17 %	1.12 %	0.57	0.01	0.96	0.37 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>8.22 %</i>	<i>12.65 %</i>	<i>-</i>	<i>0.55</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>23.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.12 %	11.63 %	1.09 %	0.41	-0.19	0.96	0.02 %	-18.43 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS II	6.18 %	11.63 %	1.09 %	0.42	-0.14	0.96	0.08 %	-18.39 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS III	6.23 %	11.63 %	1.09 %	0.42	-0.09	0.96	0.14 %	-18.37 %	23.00
<i>SPI</i>	<i>6.28 %</i>	<i>12.02 %</i>	<i>-</i>	<i>0.41</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>23.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE (ASE)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE I	1.40 %	11.20 %	1.19 %	0.01	-0.77	1.01	-0.94 %	-5.46 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE II	1.47 %	11.20 %	1.19 %	0.02	-0.71	1.01	-0.87 %	-5.44 %	1.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE III	1.56 %	11.20 %	1.19 %	0.02	-0.63	1.01	-0.78 %	-5.42 %	1.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>2.34 %</i>	<i>10.49 %</i>	-	<i>0.10</i>	-	-	-	<i>-4.97 %</i>	<i>1.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE I	-2.51 %	14.78 %	1.76 %	-0.26	-0.70	1.05	-1.18 %	-22.67 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE II	-2.44 %	14.78 %	1.76 %	-0.25	-0.66	1.05	-1.11 %	-22.64 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE III	-2.35 %	14.78 %	1.76 %	-0.25	-0.61	1.05	-1.02 %	-22.61 %	30.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>-1.20 %</i>	<i>13.95 %</i>	-	<i>-0.18</i>	-	-	-	<i>-21.19 %</i>	<i>30.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE I	6.21 %	15.15 %	1.88 %	0.32	-0.37	1.04	-1.04 %	-31.29 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE II	6.28 %	15.15 %	1.88 %	0.33	-0.33	1.04	-0.97 %	-31.25 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE III	6.39 %	15.15 %	1.88 %	0.33	-0.28	1.04	-0.86 %	-31.21 %	30.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>7.03 %</i>	<i>14.48 %</i>	-	<i>0.39</i>	-	-	-	<i>-30.06 %</i>	<i>30.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE I	6.80 %	14.37 %	2.33 %	0.38	0.22	1.02	0.38 %	-31.29 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE II	6.91 %	14.37 %	2.33 %	0.39	0.26	1.02	0.48 %	-31.25 %	30.00
AKTIEN SCHWEIZ ERGÄNZUNGSWERTE III	7.05 %	14.37 %	2.34 %	0.40	0.32	1.02	0.62 %	-31.21 %	30.00
<i>SPI EXTRA</i>	<i>6.30 %</i>	<i>13.85 %</i>	-	<i>0.36</i>	-	-	-	<i>-30.06 %</i>	<i>30.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.26 %	15.00 %	0.04 %	0.26	4.57	1.00	0.20 %	-7.72 %	-
GLOBE INDEX II	5.30 %	15.00 %	0.04 %	0.27	5.52	1.00	0.25 %	-7.71 %	-
GLOBE INDEX III	5.38 %	15.00 %	0.04 %	0.27	7.24	1.00	0.32 %	-7.70 %	-
GLOBE INDEX G	5.40 %	15.00 %	0.04 %	0.27	7.60	1.00	0.34 %	-7.70 %	-
MSCI World ex-CH ndr	5.06 %	14.49 %	-	0.25	-	-	-	-7.76 %	-

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
GLOBE INDEX I	6.53 %	14.98 %	0.09 %	0.35	2.59	1.00	0.24 %	-15.84 %	16.00
GLOBE INDEX II	6.57 %	14.98 %	0.09 %	0.35	3.07	1.00	0.28 %	-15.83 %	16.00
GLOBE INDEX III	6.65 %	14.98 %	0.09 %	0.36	3.94	1.00	0.36 %	-15.80 %	16.00
GLOBE INDEX G	6.67 %	14.98 %	0.09 %	0.36	4.12	1.00	0.37 %	-15.79 %	16.00
MSCI World ex-CH ndr	6.30 %	14.98 %	-	0.33	-	-	-	-15.92 %	16.00

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
GLOBE INDEX I	14.51 %	14.76 %	0.09 %	0.89	2.37	1.00	0.23 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	14.56 %	14.76 %	0.09 %	0.90	2.86	1.00	0.28 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	14.64 %	14.76 %	0.09 %	0.90	3.72	1.00	0.36 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	14.66 %	14.76 %	0.09 %	0.90	3.93	1.00	0.38 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	14.28 %	14.76 %	-	0.88	-	-	-	-19.42 %	17.00

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
GLOBE INDEX I	8.79 %	14.43 %	0.08 %	0.52	2.48	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	8.85 %	14.44 %	0.08 %	0.52	3.11	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.92 %	14.44 %	0.08 %	0.53	3.92	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	8.95 %	14.44 %	0.08 %	0.53	4.27	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.58 %	14.44 %	-	0.50	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	3.13 %	12.28 %	0.11 %	0.15	1.33	1.00	0.16 %	-6.54 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	3.21 %	12.28 %	0.11 %	0.16	2.09	1.00	0.24 %	-6.53 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	3.24 %	12.28 %	0.11 %	0.16	2.28	1.00	0.26 %	-6.52 %	-
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>2.98 %</i>	<i>12.04 %</i>	-	<i>0.16</i>	-	-	-	<i>-6.59 %</i>	-

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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	5.06 %	15.44 %	0.12 %	0.24	1.99	1.00	0.26 %	-19.18 %	10.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	5.13 %	15.44 %	0.12 %	0.25	2.54	1.00	0.33 %	-19.17 %	10.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	5.16 %	15.44 %	0.12 %	0.25	2.79	1.00	0.36 %	-19.14 %	10.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>4.80 %</i>	<i>15.43 %</i>	-	<i>0.23</i>	-	-	-	<i>-19.25 %</i>	<i>10.00</i>

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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	13.97 %	15.26 %	0.13 %	0.83	1.77	1.00	0.24 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	14.02 %	15.26 %	0.13 %	0.83	2.08	1.00	0.29 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	14.09 %	15.26 %	0.13 %	0.84	2.58	1.00	0.35 %	-23.08 %	17.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>13.72 %</i>	<i>15.24 %</i>	-	<i>0.81</i>	-	-	-	<i>-23.18 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	7.83 %	14.39 %	0.14 %	0.45	1.28	1.00	0.20 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	7.85 %	14.39 %	0.14 %	0.45	1.42	1.00	0.22 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	7.93 %	14.40 %	0.14 %	0.46	1.99	1.00	0.30 %	-23.08 %	17.00
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>7.63 %</i>	<i>14.40 %</i>	-	<i>0.44</i>	-	-	-	<i>-23.18 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



EUROPE INDEX SRI (EISRI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
EUROPE INDEX SRI III	-7.68 %	16.48 %	0.09 %	-0.54	0.65	0.99	0.00 %	-10.72 %	-
MSCI Europe ex Switzerland SRI	-7.74 %	15.93 %	-	-0.56	-	-	-	-10.79 %	-

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
EUROPE INDEX SRI III	3.95 %	15.70 %	0.08 %	0.17	-0.38	1.00	-0.02 %	-19.37 %	4.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	3.98 %	15.74 %	-	0.17	-	-	-	-19.36 %	4.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
EUROPE INDEX SRI III	6.27 %	17.21 %	0.09 %	0.29	-0.44	1.00	-0.02 %	-28.50 %	17.00
MSCI Europe ex Switzerland SRI	6.30 %	17.26 %	-	0.29	-	-	-	-28.55 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 14.10.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.69 %	10.57 %	6.50 %	0.98	0.90	0.59	8.17 %	-2.17 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.75 %	10.57 %	6.49 %	0.99	0.91	0.59	8.24 %	-2.16 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.80 %	10.57 %	6.50 %	0.99	0.91	0.59	8.28 %	-2.16 %	-
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>5.06 %</i>	<i>14.49 %</i>	-	<i>0.25</i>	-	-	-	<i>-7.76 %</i>	-

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.47 %	11.51 %	8.19 %	0.36	-0.19	0.65	0.95 %	-10.24 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.53 %	11.51 %	8.19 %	0.37	-0.18	0.65	1.01 %	-10.22 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.57 %	11.51 %	8.19 %	0.37	-0.18	0.65	1.05 %	-10.21 %	18.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>6.30 %</i>	<i>14.98 %</i>	-	<i>0.33</i>	-	-	-	<i>-15.92 %</i>	<i>16.00</i>

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.23 %	11.80 %	7.45 %	0.84	-0.45	0.69	0.94 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.30 %	11.80 %	7.45 %	0.84	-0.44	0.69	1.01 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.34 %	11.80 %	7.45 %	0.85	-0.44	0.69	1.06 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>14.28 %</i>	<i>14.76 %</i>	-	<i>0.88</i>	-	-	-	<i>-19.42 %</i>	<i>17.00</i>

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.23 %	12.18 %	6.34 %	0.40	-0.42	0.76	-0.59 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.32 %	12.18 %	6.34 %	0.41	-0.41	0.76	-0.51 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.36 %	12.18 %	6.34 %	0.41	-0.40	0.76	-0.46 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>8.58 %</i>	<i>14.44 %</i>	-	<i>0.50</i>	-	-	-	<i>-21.61 %</i>	<i>8.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.69 %	10.57 %	2.80 %	0.98	0.13	0.93	1.14 %	-2.17 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.75 %	10.57 %	2.80 %	0.99	0.16	0.93	1.21 %	-2.16 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.80 %	10.57 %	2.80 %	0.99	0.17	0.93	1.26 %	-2.16 %	-
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>11.22 %</i>	<i>9.85 %</i>	<i>-</i>	<i>1.01</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.20 %</i>	<i>1.00</i>

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.47 %	11.51 %	3.47 %	0.36	0.24	1.11	0.38 %	-10.24 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.53 %	11.51 %	3.47 %	0.37	0.26	1.11	0.44 %	-10.22 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.57 %	11.51 %	3.47 %	0.37	0.27	1.11	0.48 %	-10.21 %	18.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>4.71 %</i>	<i>9.93 %</i>	<i>-</i>	<i>0.34</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-9.91 %</i>	<i>18.00</i>

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.23 %	11.80 %	3.31 %	0.84	0.92	1.08	2.69 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.30 %	11.80 %	3.31 %	0.84	0.94	1.08	2.76 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.34 %	11.80 %	3.31 %	0.85	0.96	1.08	2.80 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>8.03 %</i>	<i>10.56 %</i>	<i>-</i>	<i>0.64</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-11.38 %</i>	<i>18.00</i>

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
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.23 %	12.18 %	3.94 %	0.40	-0.07	1.10	-0.98 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.32 %	12.18 %	3.94 %	0.41	-0.05	1.10	-0.90 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.36 %	12.18 %	3.94 %	0.41	-0.04	1.10	-0.85 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>6.67 %</i>	<i>10.52 %</i>	<i>-</i>	<i>0.51</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-16.95 %</i>	<i>15.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

GLOBAL SMALL MID CAPS (GSM)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBAL SMALL MID CAPS I	-5.00 %	15.35 %	1.82 %	-0.41	-1.50	1.03	-2.62 %	-9.91 %	-
GLOBAL SMALL MID CAPS	-4.94 %	15.35 %	1.82 %	-0.40	-1.47	1.03	-2.56 %	-9.90 %	-
GLOBAL SMALL MID CAPS III	-4.90 %	15.35 %	1.82 %	-0.40	-1.45	1.03	-2.52 %	-9.90 %	-
MSCI AC World SC ndr	-2.27 %	14.72 %	-	-0.23	-	-	-	-8.80 %	-

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
GLOBAL SMALL MID CAPS I	-2.23 %	16.54 %	2.04 %	-0.21	-1.22	0.99	-2.48 %	-19.91 %	13.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	-2.17 %	16.54 %	2.04 %	-0.21	-1.19	0.99	-2.43 %	-19.83 %	13.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	-2.13 %	16.54 %	2.04 %	-0.21	-1.17	0.99	-2.39 %	-19.78 %	13.00
MSCI AC World SC ndr	0.25 %	16.53 %	-	-0.06	-	-	-	-16.00 %	18.00

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
GLOBAL SMALL MID CAPS I	7.07 %	15.92 %	3.64 %	0.36	-1.19	0.94	-3.95 %	-29.66 %	17.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	7.13 %	15.92 %	3.64 %	0.37	-1.17	0.94	-3.89 %	-29.57 %	17.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	7.18 %	15.92 %	3.64 %	0.37	-1.16	0.94	-3.84 %	-29.50 %	17.00
MSCI AC World SC ndr	11.69 %	16.60 %	-	0.62	-	-	-	-21.61 %	26.00

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
GLOBAL SMALL MID CAPS I	4.59 %	15.39 %	3.78 %	0.21	-0.27	0.90	-0.40 %	-29.66 %	17.00
GLOBAL SMALL MID CAPS	4.64 %	15.39 %	3.78 %	0.22	-0.26	0.90	-0.35 %	-29.57 %	17.00
GLOBAL SMALL MID CAPS III	4.71 %	15.39 %	3.78 %	0.22	-0.24	0.90	-0.28 %	-29.50 %	17.00
MSCI AC World SC ndr	5.38 %	16.60 %	-	0.25	-	-	-	-30.25 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AMERICA SMALL MID CAPS (ASM)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AMERICA SMALL MID CAPS III	-6.03 %	20.28 %	2.43 %	-0.36	-0.60	0.94	-1.55 %	-13.90 %	-
AMERICA SMALL MID CAPS G	-6.02 %	20.28 %	2.43 %	-0.36	-0.60	0.94	-1.55 %	-13.90 %	-
MSCI USA Small Cap TR	-4.81 %	19.95 %	-	-0.28	-	-	-	-14.54 %	-

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
AMERICA SMALL MID CAPS III	-1.13 %	20.65 %	2.18 %	-0.12	-0.75	0.99	-1.60 %	-18.83 %	5.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	-1.12 %	20.65 %	2.18 %	-0.12	-0.75	0.99	-1.59 %	-18.81 %	5.00
MSCI USA Small Cap TR	0.46 %	20.83 %	-	-0.04	-	-	-	-16.61 %	5.00

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
AMERICA SMALL MID CAPS III	9.95 %	18.67 %	4.34 %	0.46	-0.67	0.92	-2.03 %	-24.91 %	13.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	9.97 %	18.67 %	4.34 %	0.46	-0.66	0.92	-2.00 %	-24.90 %	13.00
MSCI USA Small Cap TR	12.88 %	19.76 %	-	0.58	-	-	-	-21.71 %	9.00

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
AMERICA SMALL MID CAPS III	5.73 %	18.13 %	4.13 %	0.24	-0.24	0.92	-0.32 %	-29.66 %	10.00
AMERICA SMALL MID CAPS G	5.79 %	18.13 %	4.13 %	0.25	-0.22	0.92	-0.26 %	-29.64 %	10.00
MSCI USA Small Cap TR	6.46 %	19.26 %	-	0.27	-	-	-	-30.52 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



EUROPE SMALL MID CAPS (ESM)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
EUROPE SMALL MID CAPS III	-3.04 %	17.09 %	5.42 %	-0.25	-0.83	1.11	-4.70 %	-7.27 %	-
MSCI Europe Small Cap NR	1.63 %	12.93 %	-	0.17	-	-	-	-7.65 %	5.00

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
EUROPE SMALL MID CAPS III	-5.29 %	19.05 %	5.08 %	-0.34	-0.83	1.00	-4.19 %	-29.73 %	30.00
MSCI Europe Small Cap NR	-1.09 %	18.29 %	-	-0.13	-	-	-	-27.07 %	20.00

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
EUROPE SMALL MID CAPS III	4.31 %	19.72 %	6.56 %	0.15	-0.65	1.00	-4.62 %	-46.48 %	30.00
MSCI Europe Small Cap NR	8.92 %	18.56 %	-	0.41	-	-	-	-37.72 %	30.00

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
EUROPE SMALL MID CAPS III	4.77 %	17.94 %	5.62 %	0.19	0.02	0.94	0.52 %	-46.48 %	30.00
MSCI Europe Small Cap NR	4.43 %	18.08 %	-	0.17	-	-	-	-37.72 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	4.16 %	12.22 %	5.26 %	0.23	-0.39	0.85	-1.26 %	-4.11 %	-
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	4.23 %	12.22 %	5.26 %	0.24	-0.37	0.85	-1.19 %	-4.10 %	-
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	4.27 %	12.22 %	5.26 %	0.24	-0.37	0.85	-1.15 %	-4.10 %	-
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>6.17 %</i>	<i>15.39 %</i>	<i>-</i>	<i>0.29</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-3.79 %</i>	<i>2.00</i>

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.25 %	11.66 %	7.13 %	0.17	0.35	0.71	2.79 %	-14.39 %	17.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.31 %	11.66 %	7.13 %	0.17	0.36	0.71	2.85 %	-14.37 %	17.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.35 %	11.66 %	7.13 %	0.18	0.37	0.71	2.89 %	-14.36 %	17.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>0.12 %</i>	<i>14.36 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.08</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-17.49 %</i>	<i>23.00</i>

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	10.16 %	12.10 %	7.36 %	0.73	0.46	0.73	5.39 %	-17.88 %	18.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	10.23 %	12.10 %	7.36 %	0.74	0.47	0.73	5.46 %	-17.82 %	18.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	10.27 %	12.10 %	7.36 %	0.74	0.47	0.73	5.50 %	-17.78 %	18.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>6.03 %</i>	<i>14.03 %</i>	<i>-</i>	<i>0.34</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-30.69 %</i>	<i>29.00</i>

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.19 %	13.91 %	6.28 %	0.14	0.02	0.85	0.67 %	-32.38 %	12.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.26 %	13.91 %	6.28 %	0.14	0.03	0.85	0.73 %	-32.28 %	12.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.30 %	13.91 %	6.28 %	0.14	0.04	0.85	0.77 %	-32.22 %	12.00
<i>MSCI Emerging Markets Net Total Return</i>	<i>2.74 %</i>	<i>14.81 %</i>	<i>-</i>	<i>0.10</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-30.69 %</i>	<i>29.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL (EMMA)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	4.16 %	12.22 %	3.93 %	0.23	-0.09	1.16	-0.97 %	-4.11 %	-
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	4.23 %	12.22 %	3.93 %	0.24	-0.07	1.16	-0.91 %	-4.10 %	-
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	4.27 %	12.22 %	3.93 %	0.24	-0.06	1.16	-0.87 %	-4.10 %	-
<i>MSCI Emerging Market Low Volatility Index</i>	<i>4.59 %</i>	<i>8.03 %</i>	-	<i>0.64</i>	-	-	-	<i>-3.14 %</i>	-

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.25 %	11.66 %	4.42 %	0.17	0.77	1.15	3.47 %	-14.39 %	17.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.31 %	11.66 %	4.42 %	0.17	0.79	1.15	3.53 %	-14.37 %	17.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.35 %	11.66 %	4.42 %	0.18	0.80	1.15	3.57 %	-14.36 %	17.00
<i>MSCI Emerging Market Low Volatility Index</i>	<i>-0.02 %</i>	<i>9.45 %</i>	-	<i>-0.14</i>	-	-	-	<i>-15.36 %</i>	<i>14.00</i>

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	10.16 %	12.10 %	5.24 %	0.73	0.83	1.09	4.07 %	-17.88 %	18.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	10.23 %	12.10 %	5.24 %	0.74	0.84	1.09	4.13 %	-17.82 %	18.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	10.27 %	12.10 %	5.24 %	0.74	0.85	1.09	4.18 %	-17.78 %	18.00
<i>MSCI Emerging Market Low Volatility Index</i>	<i>5.69 %</i>	<i>10.03 %</i>	-	<i>0.44</i>	-	-	-	<i>-16.39 %</i>	<i>17.00</i>

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
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL I	3.19 %	13.91 %	5.75 %	0.14	0.27	1.18	1.22 %	-32.38 %	12.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL II	3.26 %	13.91 %	5.75 %	0.14	0.28	1.18	1.29 %	-32.28 %	12.00
AKTIEN EMERGING MARKETS LOW VOL III	3.30 %	13.91 %	5.75 %	0.14	0.29	1.18	1.33 %	-32.22 %	12.00
<i>MSCI Emerging Market Low Volatility Index</i>	<i>1.87 %</i>	<i>10.87 %</i>	-	<i>0.05</i>	-	-	-	<i>-23.34 %</i>	<i>12.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

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	13.15 %	10.02 %	1.08 %	1.18	0.00	0.97	0.32 %	-2.50 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	13.22 %	10.02 %	1.08 %	1.19	0.06	0.97	0.39 %	-2.49 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	13.27 %	10.02 %	1.08 %	1.19	0.10	0.97	0.43 %	-2.48 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>13.14 %</i>	<i>9.91 %</i>	<i>-</i>	<i>1.19</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-3.07 %</i>	<i>2.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	4.56 %	9.31 %	0.86 %	0.35	0.99	1.00	0.89 %	-13.33 %	5.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	4.62 %	9.31 %	0.86 %	0.36	1.07	1.00	0.95 %	-13.25 %	5.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	4.66 %	9.31 %	0.86 %	0.36	1.11	1.00	0.99 %	-13.20 %	5.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>3.67 %</i>	<i>9.29 %</i>	<i>-</i>	<i>0.26</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-15.29 %</i>	<i>11.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	6.16 %	9.18 %	0.82 %	0.53	0.61	0.99	0.58 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	6.23 %	9.18 %	0.82 %	0.54	0.68	0.99	0.64 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	6.27 %	9.18 %	0.82 %	0.54	0.74	0.99	0.69 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.63 %</i>	<i>9.24 %</i>	<i>-</i>	<i>0.47</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	4.95 %	8.55 %	0.75 %	0.43	0.25	1.00	0.20 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.03 %	8.55 %	0.75 %	0.44	0.35	1.00	0.27 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.10 %	8.55 %	0.75 %	0.44	0.44	1.00	0.34 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>4.76 %</i>	<i>8.52 %</i>	<i>-</i>	<i>0.41</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

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 %	0.63 %	2.24	0.01	0.29	2.03 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.25 %	1.29 %	0.62 %	2.28	0.17	0.30	2.11 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.34 %	1.32 %	0.62 %	2.31	0.31	0.29	2.22 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.45 %	1.34 %	0.62 %	2.34	0.49	0.30	2.32 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.14 %	1.22 %	-	2.32	-	-	-	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	-0.85	0.35	0.79 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	2.95 %	0.67 %	0.71 %	2.48	-0.71	0.36	0.89 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	3.04 %	0.67 %	0.71 %	2.62	-0.58	0.35	0.98 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.16 %	0.67 %	0.71 %	2.79	-0.43	0.36	1.09 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	3.47 %	0.48 %	-	4.54	-	-	-	-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 %	0.75 %	3.40	-0.23	0.65	0.87 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.17 %	0.81 %	0.75 %	3.52	-0.10	0.65	0.97 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.26 %	0.81 %	0.75 %	3.65	0.02	0.65	1.06 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.38 %	0.81 %	0.75 %	3.79	0.17	0.65	1.17 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.24 %	0.57 %	-	5.15	-	-	-	-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	0.13	0.65	1.36 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	5.07 %	1.05 %	1.00 %	3.57	0.23	0.66	1.46 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	5.17 %	1.05 %	1.00 %	3.67	0.32	0.65	1.56 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.28 %	1.05 %	1.00 %	3.77	0.43	0.65	1.68 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.83 %	0.60 %	-	5.91	-	-	-	-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



IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN (ISW)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN I	3.67 %	1.06 %	0.54 %	2.24	-0.83	-0.07	2.58 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.14 %	1.22 %	-	2.32	-	-	-	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
IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN I	3.01 %	1.04 %	1.00 %	1.65	-0.45	0.69	0.22 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	3.47 %	0.48 %	-	4.54	-	-	-	-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
IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN I	3.39 %	0.97 %	0.94 %	2.16	-0.87	0.56	0.44 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.24 %	0.57 %	-	5.15	-	-	-	-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
IMMOBILIEN SCHWEIZ WOHNEN I	3.65 %	1.17 %	1.12 %	2.01	-1.01	0.66	0.03 %	-1.45 %	6.00
KGAST-Index	4.83 %	0.60 %	-	5.91	-	-	-	-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

IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS (ISF)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS III	4.16 %	1.49 %	1.06 %	1.92	0.02	0.03	2.77 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.14 %	1.22 %	-	2.32	-	-	-	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
IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS III	4.15 %	1.08 %	1.27 %	2.65	0.52	-0.46	3.87 %	0.00 %	-
KGAST-Index	3.47 %	0.48 %	-	4.54	-	-	-	-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
IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS III	4.96 %	1.70 %	1.73 %	2.15	0.40	0.35	2.65 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.24 %	0.57 %	-	5.15	-	-	-	-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
IMMOBILIEN SCHWEIZ FOKUS III	7.00 %	3.96 %	3.81 %	1.44	0.55	2.17	-1.96 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.83 %	0.60 %	-	5.91	-	-	-	-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

GLOBAL REIT (GR)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBAL REIT II	-1.22 %	13.32 %	2.74 %	-0.19	-1.98	0.87	-5.12 %	-5.25 %	3.00
GPR 250 World Net CHF	4.28 %	12.91 %	-	0.31	-	-	-	-4.36 %	2.00

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
GLOBAL REIT II	-5.15 %	16.26 %	2.71 %	-0.39	-0.15	1.01	-0.36 %	-29.44 %	17.00
GPR 250 World Net CHF	-4.75 %	15.93 %	-	-0.38	-	-	-	-30.22 %	17.00

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
GLOBAL REIT II	4.16 %	15.10 %	2.76 %	0.19	-0.39	0.97	-0.96 %	-31.46 %	17.00
GPR 250 World Net CHF	5.22 %	15.25 %	-	0.26	-	-	-	-32.15 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBAL REIT II	0.64 %	16.91 %	2.54 %	-0.04	-0.07	0.98	-0.12 %	-31.46 %	17.00
GPR 250 World Net CHF	0.75 %	17.01 %	-	-0.03	-	-	-	-32.15 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2017 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	3.39 %	2.38 %	0.75 %	0.88	-0.73	0.98	-0.50 %	-0.89 %	-
MIXTA OPTIMA 15 III	3.44 %	2.38 %	0.75 %	0.90	-0.66	0.98	-0.45 %	-0.88 %	-
MO15 Customised	3.96 %	2.77 %	-	0.96	-	-	-	-0.94 %	-

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
MIXTA OPTIMA 15 II	1.15 %	4.38 %	0.93 %	-0.03	-0.58	0.91	-0.49 %	-7.14 %	18.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.19 %	4.38 %	0.93 %	-0.02	-0.53	0.91	-0.45 %	-7.14 %	18.00
MO15 Customised	1.68 %	4.72 %	-	0.08	-	-	-	-6.84 %	18.00

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
MIXTA OPTIMA 15 II	2.16 %	3.97 %	0.94 %	0.22	0.03	0.90	0.13 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.18 %	3.97 %	0.93 %	0.22	0.06	0.90	0.15 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	2.11 %	4.29 %	-	0.19	-	-	-	-11.43 %	26.00

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
MIXTA OPTIMA 15 II	1.89 %	3.71 %	1.08 %	0.16	-0.19	0.92	-0.14 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.91 %	3.71 %	1.08 %	0.17	-0.18	0.92	-0.13 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	2.10 %	3.85 %	-	0.21	-	-	-	-11.43 %	26.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.98 %	3.35 %	0.64 %	0.80	-0.87	1.02	-0.65 %	-1.16 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	4.04 %	3.35 %	0.64 %	0.82	-0.77	1.02	-0.59 %	-1.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	4.10 %	3.35 %	0.64 %	0.83	-0.69	1.02	-0.53 %	-1.15 %	-
MO25 Customised	4.56 %	3.55 %	-	0.92	-	-	-	-1.23 %	-

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
MIXTA OPTIMA 25 I	1.37 %	5.16 %	0.92 %	0.01	-0.68	0.93	-0.56 %	-7.87 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.43 %	5.16 %	0.92 %	0.03	-0.61	0.93	-0.50 %	-7.84 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.48 %	5.16 %	0.92 %	0.04	-0.56	0.93	-0.45 %	-7.82 %	18.00
MO25 Customised	1.98 %	5.50 %	-	0.12	-	-	-	-7.85 %	18.00

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
MIXTA OPTIMA 25 I	3.42 %	4.87 %	0.95 %	0.43	-0.01	0.93	0.16 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.49 %	4.87 %	0.95 %	0.45	0.06	0.93	0.23 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.54 %	4.87 %	0.95 %	0.46	0.11	0.93	0.28 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.41 %	5.16 %	-	0.41	-	-	-	-11.81 %	24.00

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
MIXTA OPTIMA 25 I	2.83 %	4.84 %	1.16 %	0.32	0.00	0.99	0.01 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.93 %	4.84 %	1.16 %	0.34	0.09	0.99	0.11 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.99 %	4.84 %	1.16 %	0.35	0.13	0.99	0.16 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.83 %	4.72 %	-	0.32	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.98 %	3.35 %	1.73 %	0.80	0.00	0.86	0.39 %	-1.16 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	4.04 %	3.35 %	1.73 %	0.82	0.03	0.86	0.45 %	-1.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	4.10 %	3.35 %	1.73 %	0.83	0.06	0.86	0.50 %	-1.15 %	-
BVG 25 (2000)	3.97 %	3.87 %	-	0.69	-	-	-	-1.49 %	-

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
MIXTA OPTIMA 25 I	1.37 %	5.16 %	2.11 %	0.01	-0.15	0.78	-0.16 %	-7.87 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.43 %	5.16 %	2.11 %	0.03	-0.12	0.78	-0.10 %	-7.84 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.48 %	5.16 %	2.11 %	0.04	-0.10	0.78	-0.05 %	-7.82 %	18.00
BVG 25 (2000)	1.61 %	6.30 %	-	0.05	-	-	-	-9.57 %	18.00

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
MIXTA OPTIMA 25 I	3.42 %	4.87 %	2.02 %	0.43	0.50	0.80	1.29 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.49 %	4.87 %	2.02 %	0.45	0.53	0.80	1.36 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.54 %	4.87 %	2.02 %	0.46	0.55	0.80	1.42 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.33 %	5.70 %	-	0.18	-	-	-	-15.55 %	30.00

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
MIXTA OPTIMA 25 I	2.83 %	4.84 %	1.83 %	0.32	0.45	0.88	0.95 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.93 %	4.84 %	1.83 %	0.34	0.50	0.89	1.05 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.99 %	4.84 %	1.83 %	0.35	0.53	0.89	1.10 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.97 %	5.11 %	-	0.13	-	-	-	-15.55 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	4.36 %	4.25 %	0.70 %	0.72	-0.82	1.01	-0.63 %	-1.41 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	4.43 %	4.25 %	0.70 %	0.73	-0.74	1.01	-0.56 %	-1.40 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	4.48 %	4.25 %	0.70 %	0.75	-0.67	1.01	-0.51 %	-1.40 %	-
MO35 Customised	4.97 %	4.50 %	-	0.82	-	-	-	-1.59 %	-

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
MIXTA OPTIMA 35 I	1.50 %	6.16 %	0.96 %	0.03	-0.73	0.94	-0.63 %	-9.35 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	1.56 %	6.16 %	0.96 %	0.04	-0.67	0.94	-0.57 %	-9.33 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	1.61 %	6.16 %	0.96 %	0.05	-0.62	0.94	-0.52 %	-9.30 %	18.00
MO35 Customised	2.19 %	6.49 %	-	0.14	-	-	-	-9.22 %	18.00

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
MIXTA OPTIMA 35 I	4.10 %	5.91 %	0.99 %	0.47	-0.24	0.94	-0.05 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	4.17 %	5.92 %	0.99 %	0.48	-0.17	0.94	0.03 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.22 %	5.92 %	0.99 %	0.49	-0.12	0.94	0.08 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	4.32 %	6.20 %	-	0.49	-	-	-	-13.35 %	24.00

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
MIXTA OPTIMA 35 I	3.14 %	5.79 %	1.09 %	0.32	-0.28	0.99	-0.28 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.24 %	5.79 %	1.09 %	0.33	-0.19	0.99	-0.18 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.29 %	5.79 %	1.09 %	0.34	-0.15	0.99	-0.13 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.45 %	5.77 %	-	0.37	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(nach BVV2 – Aktien- und Gesellschaftsbeteiligungs-Quote überschritten)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	5.69 %	7.77 %	1.06 %	0.56	-0.86	0.97	-0.80 %	-2.44 %	-
MIXTA OPTIMA 75 III	5.74 %	7.77 %	1.06 %	0.57	-0.81	0.97	-0.75 %	-2.43 %	-
MO75 Customised	6.65 %	8.08 %	-	0.66	-	-	-	-2.73 %	-

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
MIXTA OPTIMA 75 II	2.31 %	9.44 %	1.35 %	0.11	-0.82	0.96	-1.00 %	-13.37 %	18.00
MIXTA OPTIMA 75 III	2.36 %	9.46 %	1.17 %	0.11	-0.90	0.96	-0.96 %	-13.37 %	18.00
MO75 Customised	3.41 %	9.79 %	-	0.22	-	-	-	-12.78 %	17.00

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
MIXTA OPTIMA 75 II	6.96 %	9.29 %	1.46 %	0.61	-0.87	0.94	-0.85 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	6.99 %	9.30 %	1.37 %	0.61	-0.90	0.94	-0.84 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	8.26 %	9.83 %	-	0.71	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.31 %	9.84 %	1.48 %	0.31	-0.64	0.93	-0.65 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.33 %	9.85 %	1.40 %	0.31	-0.65	0.94	-0.64 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.22 %	10.44 %	-	0.37	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



INSURANCE LINKED STRATEGIES USD (ILS)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	10.66 %	4.54 %	-	-	-	-	-	-1.01 %	1.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	10.69 %	4.55 %	-	-	-	-	-	-1.01 %	1.00

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
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	6.26 %	-	-	-	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	6.29 %	-	-	-	-	-	-	-5.05 %	4.00

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
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	5.29 %	4.06 %	-	-0.07	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	5.32 %	4.06 %	-	-0.06	-	-	-	-5.05 %	4.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD III	3.67 %	3.37 %	-	-0.58	-	-	-	-5.06 %	4.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES USD G	3.69 %	3.37 %	-	-0.57	-	-	-	-5.05 %	4.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 5.64 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF (ILH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	6.02 %	3.66 %	-	-	-	-	-	-1.38 %	1.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	6.09 %	3.66 %	-	-	-	-	-	-1.36 %	1.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	6.14 %	3.67 %	-	-	-	-	-	-1.37 %	1.00

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
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	2.14 %	-	-	-	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	2.21 %	-	-	-	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	2.26 %	-	-	-	-	-	-	-5.35 %	8.00

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
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	2.22 %	3.99 %	-	0.24	-	-	-	-5.36 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	2.31 %	3.99 %	-	0.26	-	-	-	-5.34 %	8.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	2.34 %	3.99 %	-	0.27	-	-	-	-5.35 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF I	0.62 %	3.39 %	-	-0.19	-	-	-	-9.63 %	24.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF II	0.72 %	3.38 %	-	-0.17	-	-	-	-9.21 %	53.00
INSURANCE LINKED STRATEGIES HEDGED CHF III	0.77 %	3.38 %	-	-0.15	-	-	-	-9.10 %	53.00

Beobachtungszeitraum: 17.02.2016 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



ILS SIDE POCKET 2 (ILSSP2)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-24.34 %	21.86 %	-	-	-	-	-	-30.80 %	2.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-24.48 %	22.74 %	-	-	-	-	-	-30.02 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-22.86 %	21.34 %	-	-1.20	-	-	-	-31.19 %	2.00
ILS SIDE POCKET 2 CHF	-25.86 %	22.41 %	-	-1.48	-	-	-	-34.58 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.02.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	8.61 %	11.37 %	1.27 %	0.64	-0.19	0.94	0.26 %	-5.66 %	1.00
<i>SPI</i>	<i>8.79 %</i>	<i>11.52 %</i>	<i>-</i>	<i>0.65</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-6.25 %</i>	<i>1.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	2.39 %	11.81 %	1.18 %	0.09	-0.27	0.95	-0.17 %	-15.16 %	20.00
<i>SPI</i>	<i>2.64 %</i>	<i>12.44 %</i>	<i>-</i>	<i>0.11</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-15.62 %</i>	<i>20.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	8.19 %	12.17 %	1.12 %	0.56	-0.08	0.96	0.26 %	-18.43 %	28.00
<i>SPI</i>	<i>8.22 %</i>	<i>12.65 %</i>	<i>-</i>	<i>0.55</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>23.00</i>

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
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS I	6.12 %	11.62 %	1.09 %	0.41	-0.19	0.96	0.02 %	-18.43 %	28.00
<i>SPI</i>	<i>6.28 %</i>	<i>12.02 %</i>	<i>-</i>	<i>0.41</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.93 %</i>	<i>23.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE (ASD)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE II	11.53 %	10.21 %	3.23 %	1.00	0.70	0.81	4.18 %	-2.99 %	3.00
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE III	11.57 %	10.21 %	3.23 %	1.00	0.72	0.81	4.22 %	-2.99 %	3.00
SPI	8.79 %	11.52 %	-	0.65	-	-	-	-6.25 %	1.00

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
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE II	2.50 %	10.16 %	3.75 %	0.12	-0.12	0.79	0.15 %	-13.80 %	22.00
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE III	2.54 %	10.16 %	3.75 %	0.12	-0.11	0.79	0.19 %	-13.78 %	22.00
SPI	2.64 %	12.44 %	-	0.11	-	-	-	-15.62 %	20.00

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
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE II	7.12 %	11.19 %	3.19 %	0.52	-0.39	0.86	-0.12 %	-16.86 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE III	7.17 %	11.20 %	3.19 %	0.52	-0.37	0.86	-0.08 %	-16.84 %	28.00
SPI	8.22 %	12.65 %	-	0.55	-	-	-	-19.93 %	23.00

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
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE II	6.82 %	10.83 %	2.91 %	0.51	0.12	0.88	1.16 %	-16.86 %	28.00
AKTIEN SCHWEIZ DIVIDENDENSTRATEGIE III	6.86 %	10.83 %	2.91 %	0.51	0.13	0.88	1.20 %	-16.84 %	28.00
SPI	6.28 %	12.02 %	-	0.41	-	-	-	-19.93 %	23.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	4.70 %	3.67 %	0.69 %	0.92	-0.12	0.88	0.33 %	-1.16 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	4.76 %	3.67 %	0.69 %	0.94	-0.03	0.88	0.40 %	-1.15 %	-
MO30 Customised	4.77 %	4.10 %	-	0.85	-	-	-	-1.44 %	-

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
MIXTA OPTIMA 30 I	1.70 %	5.52 %	1.83 %	0.07	0.16	0.77	0.40 %	-8.83 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.76 %	5.52 %	1.83 %	0.08	0.19	0.77	0.46 %	-8.81 %	18.00
MO30 Customised	1.30 %	7.07 %	-	0.00	-	-	-	-11.46 %	21.00

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
MIXTA OPTIMA 30 I	4.02 %	5.50 %	1.67 %	0.49	0.09	0.80	0.74 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	4.05 %	5.50 %	1.67 %	0.50	0.11	0.80	0.78 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.77 %	6.77 %	-	0.36	-	-	-	-16.11 %	30.00

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
MIXTA OPTIMA 30 I	2.74 %	5.60 %	1.49 %	0.26	-0.24	0.87	-0.10 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.76 %	5.60 %	1.50 %	0.26	-0.23	0.87	-0.08 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.07 %	6.25 %	-	0.28	-	-	-	-16.11 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ (WHS)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	5.64 %	4.28 %	1.04 %	1.01	1.42	1.01	1.52 %	-1.90 %	-
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	4.10 %	3.75 %	-	0.75	-	-	-	-1.60 %	-

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
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	-3.94 %	10.26 %	5.46 %	-0.51	-0.95	1.54	-5.60 %	-25.91 %	25.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	1.53 %	6.02 %	-	0.04	-	-	-	-7.69 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
WOHNBAUHYPOTHEKEN SCHWEIZ III	-7.44 %	10.66 %	5.84 %	-0.83	-1.19	1.55	-6.29 %	-35.78 %	25.00
SBI Domestic AAA-BBB 7-10 TR	-0.28 %	6.14 %	-	-0.25	-	-	-	-14.22 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 02.11.2021 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