

IMMO OPTIMA SCHWEIZ (IOS)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	14.97 %	10.24 %	0.80 %	1.27	-0.71	1.03	-1.09 %	-2.50 %	1.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	15.04 %	10.24 %	0.80 %	1.27	-0.63	1.03	-1.02 %	-2.49 %	1.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	15.08 %	10.24 %	0.80 %	1.28	-0.58	1.03	-0.97 %	-2.48 %	1.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>15.63 %</i>	<i>10.12 %</i>	<i>-</i>	<i>1.33</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.43 %</i>	<i>1.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	8.88 %	8.43 %	0.83 %	0.97	0.67	1.01	0.47 %	-6.77 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	8.94 %	8.43 %	0.83 %	0.98	0.75	1.01	0.54 %	-6.70 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	8.99 %	8.43 %	0.83 %	0.99	0.80	1.01	0.58 %	-6.65 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>8.29 %</i>	<i>8.26 %</i>	<i>-</i>	<i>0.92</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-7.65 %</i>	<i>2.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	6.16 %	9.25 %	0.76 %	0.59	0.80	0.99	0.72 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	6.22 %	9.25 %	0.76 %	0.60	0.88	0.99	0.78 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	6.27 %	9.25 %	0.76 %	0.60	0.94	0.99	0.83 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.50 %</i>	<i>9.34 %</i>	<i>-</i>	<i>0.52</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	5.55 %	8.33 %	0.74 %	0.59	0.18	1.00	0.14 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.63 %	8.33 %	0.74 %	0.59	0.28	1.00	0.22 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.70 %	8.33 %	0.74 %	0.60	0.37	1.00	0.29 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.41 %</i>	<i>8.29 %</i>	<i>-</i>	<i>0.57</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr



Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus