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	7.32 %	9.73 %	0.96 %	0.75	-0.79	0.97	-0.56 %	-5.23 %	3.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	7.38 %	9.73 %	0.96 %	0.76	-0.73	0.97	-0.49 %	-5.22 %	3.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	7.43 %	9.73 %	0.96 %	0.76	-0.69	0.97	-0.45 %	-5.22 %	3.00
SXI Real Estate Funds TR	*8.12 %*	*9.68 %*	-	*0.84*	-	-	-	*-5.26 %*	*3.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	11.26 %	8.33 %	0.88 %	1.35	-0.17	1.00	-0.20 %	-5.23 %	3.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	11.32 %	8.33 %	0.88 %	1.36	-0.10	1.00	-0.13 %	-5.22 %	3.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	11.37 %	8.33 %	0.88 %	1.37	-0.06	1.00	-0.09 %	-5.22 %	3.00
SXI Real Estate Funds TR	*11.42 %*	*8.26 %*	-	*1.38*	-	-	-	*-5.26 %*	*3.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	3.72 %	8.65 %	0.84 %	0.44	0.50	0.99	0.49 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	3.78 %	8.65 %	0.84 %	0.44	0.57	0.99	0.55 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	3.83 %	8.65 %	0.84 %	0.45	0.62	0.99	0.59 %	-16.73 %	11.00
SXI Real Estate Funds TR	*3.28 %*	*8.74 %*	-	*0.38*	-	-	-	*-19.12 %*	*13.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	5.52 %	8.39 %	0.79 %	0.66	0.08	1.00	0.09 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.59 %	8.39 %	0.79 %	0.67	0.17	1.00	0.16 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.65 %	8.39 %	0.79 %	0.68	0.25	1.00	0.22 %	-16.73 %	11.00
SXI Real Estate Funds TR	*5.44 %*	*8.38 %*	-	*0.66*	-	-	-	*-19.12 %*	*13.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus