

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	3.19 %	9.53 %	0.73 %	0.34	-0.99	0.99	-0.72 %	-5.23 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	3.25 %	9.53 %	0.73 %	0.34	-0.91	0.99	-0.65 %	-5.22 %	-
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	3.29 %	9.53 %	0.73 %	0.35	-0.86	0.99	-0.61 %	-5.22 %	-
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>3.93 %</i>	<i>9.41 %</i>	<i>-</i>	<i>0.42</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.26 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2025 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	9.51 %	8.41 %	0.83 %	1.13	-0.01	1.01	-0.13 %	-5.87 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	9.57 %	8.41 %	0.83 %	1.14	0.06	1.01	-0.07 %	-5.84 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	9.62 %	8.41 %	0.83 %	1.14	0.11	1.01	-0.03 %	-5.82 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>9.52 %</i>	<i>8.26 %</i>	<i>-</i>	<i>1.15</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.81 %</i>	<i>2.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	4.02 %	8.87 %	0.81 %	0.46	0.64	0.99	0.59 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	4.08 %	8.87 %	0.81 %	0.46	0.72	0.99	0.66 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	4.13 %	8.87 %	0.81 %	0.47	0.77	0.99	0.70 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>3.47 %</i>	<i>8.94 %</i>	<i>-</i>	<i>0.39</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	5.22 %	8.39 %	0.77 %	0.62	0.06	1.00	0.05 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.29 %	8.39 %	0.77 %	0.63	0.15	1.00	0.13 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.35 %	8.39 %	0.77 %	0.64	0.23	1.00	0.19 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.17 %</i>	<i>8.36 %</i>	<i>-</i>	<i>0.62</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2016 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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