

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	4.60 %	1.37 %	0.80 %	3.05	-0.17	-0.11	4.70 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.71 %	1.40 %	0.79 %	3.07	-0.04	-0.10	4.78 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.81 %	1.42 %	0.80 %	3.08	0.07	-0.11	4.89 %	0.00 %	-
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.92 %	1.45 %	0.80 %	3.10	0.20	-0.10	4.98 %	0.00 %	-
KGAST-Index	4.74 %	1.40 %	-	3.08	-	-	-	0.00 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	3.01 %	0.59 %	0.66 %	4.40	-0.78	0.35	1.52 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	3.11 %	0.59 %	0.66 %	4.57	-0.63	0.35	1.61 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	3.20 %	0.59 %	0.66 %	4.74	-0.49	0.35	1.71 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	3.31 %	0.59 %	0.66 %	4.92	-0.33	0.35	1.82 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	3.53 %	0.52 %	-	6.05	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.00 %	0.78 %	0.75 %	4.60	-0.33	0.57	1.42 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	4.11 %	0.78 %	0.75 %	4.73	-0.20	0.57	1.52 %	-0.09 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	4.20 %	0.78 %	0.75 %	4.85	-0.08	0.57	1.61 %	-0.08 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	4.31 %	0.78 %	0.75 %	5.00	0.07	0.57	1.73 %	-0.07 %	1.00
KGAST-Index	4.26 %	0.59 %	-	6.55	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO INVEST SCHWEIZ I	4.95 %	1.06 %	1.01 %	4.31	0.14	0.64	1.73 %	-0.16 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ II	5.06 %	1.06 %	1.01 %	4.41	0.24	0.64	1.84 %	-0.15 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ III	5.16 %	1.06 %	1.01 %	4.50	0.33	0.64	1.94 %	-0.14 %	1.00
IMMO INVEST SCHWEIZ G	5.27 %	1.06 %	1.01 %	4.61	0.44	0.64	2.06 %	-0.13 %	1.00
KGAST-Index	4.80 %	0.60 %	-	7.37	-	-	-	-0.02 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (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