

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	11.85 %	10.12 %	0.79 %	1.12	-0.95	1.04	-1.32 %	-2.50 %	1.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	11.91 %	10.12 %	0.79 %	1.13	-0.87	1.04	-1.25 %	-2.49 %	1.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	11.96 %	10.12 %	0.79 %	1.13	-0.82	1.04	-1.20 %	-2.48 %	1.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>12.70 %</i>	<i>9.96 %</i>	<i>-</i>	<i>1.23</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-2.43 %</i>	<i>1.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	9.94 %	7.78 %	0.76 %	1.22	0.14	1.02	-0.04 %	-5.87 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	10.01 %	7.78 %	0.76 %	1.23	0.22	1.02	0.03 %	-5.84 %	2.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	10.05 %	7.78 %	0.76 %	1.24	0.28	1.02	0.07 %	-5.82 %	2.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>9.83 %</i>	<i>7.63 %</i>	<i>-</i>	<i>1.23</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-5.81 %</i>	<i>2.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	5.71 %	9.17 %	0.77 %	0.58	0.75	0.99	0.68 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.77 %	9.17 %	0.76 %	0.59	0.83	0.99	0.74 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.82 %	9.17 %	0.76 %	0.59	0.88	0.99	0.78 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.10 %</i>	<i>9.26 %</i>	<i>-</i>	<i>0.51</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

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 OPTIMA SCHWEIZ I	5.87 %	8.18 %	0.74 %	0.67	0.12	1.00	0.09 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.95 %	8.18 %	0.74 %	0.68	0.21	1.00	0.17 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	6.02 %	8.18 %	0.74 %	0.69	0.30	1.00	0.23 %	-16.73 %	11.00
<i>SXI Real Estate Funds TR</i>	<i>5.78 %</i>	<i>8.15 %</i>	<i>-</i>	<i>0.66</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.12 %</i>	<i>13.00</i>

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