

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	1.65 %	9.49 %	1.01 %	0.18	-0.34	0.97	-0.27 %	-5.23 %	6.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	1.71 %	9.49 %	1.01 %	0.18	-0.28	0.97	-0.21 %	-5.22 %	6.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	1.75 %	9.49 %	1.01 %	0.19	-0.24	0.97	-0.17 %	-5.22 %	6.00
SXI Real Estate Funds TR	1.98 %	9.47 %	-	0.21	-	-	-	-5.26 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2025 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	9.58 %	8.23 %	0.86 %	1.16	-0.29	1.00	-0.23 %	-5.23 %	6.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	9.64 %	8.23 %	0.86 %	1.17	-0.22	1.00	-0.16 %	-5.22 %	6.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	9.69 %	8.23 %	0.86 %	1.18	-0.17	1.00	-0.12 %	-5.22 %	6.00
SXI Real Estate Funds TR	9.84 %	8.22 %	-	1.20	-	-	-	-5.26 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	3.00 %	8.73 %	0.85 %	0.35	0.51	0.99	0.49 %	-16.68 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	3.06 %	8.73 %	0.85 %	0.35	0.58	0.99	0.55 %	-16.60 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	3.10 %	8.73 %	0.85 %	0.36	0.63	0.99	0.59 %	-16.54 %	11.00
SXI Real Estate Funds TR	2.55 %	8.80 %	-	0.29	-	-	-	-18.82 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
IMMO OPTIMA SCHWEIZ I	5.05 %	8.45 %	0.79 %	0.60	0.12	1.00	0.11 %	-16.91 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ II	5.12 %	8.45 %	0.79 %	0.61	0.20	1.00	0.18 %	-16.80 %	11.00
IMMO OPTIMA SCHWEIZ III	5.18 %	8.45 %	0.79 %	0.62	0.28	1.00	0.25 %	-16.73 %	11.00
SXI Real Estate Funds TR	4.95 %	8.44 %	-	0.59	-	-	-	-19.12 %	13.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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