

AXA Swiss Institutional Fund - Multi Asset Plus 1 CHF

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Kennzahlen (CHF)*

Absolute Wertentwicklung des Fonds (%)					Aktueller NAV
YTD	1J	3J	10J	Auflage	Aus.
+8.00	+14.90	+0.79	+34.21	+65.48	1 477.57
Annualisierte Fondsperformance (%)					Nettovermögen (M)
3 J.	5 J.	10 J.	Auflage	CHF	
+0.26	+2.14	+2.98	+3.50	44.74	

Dividendenentwicklung

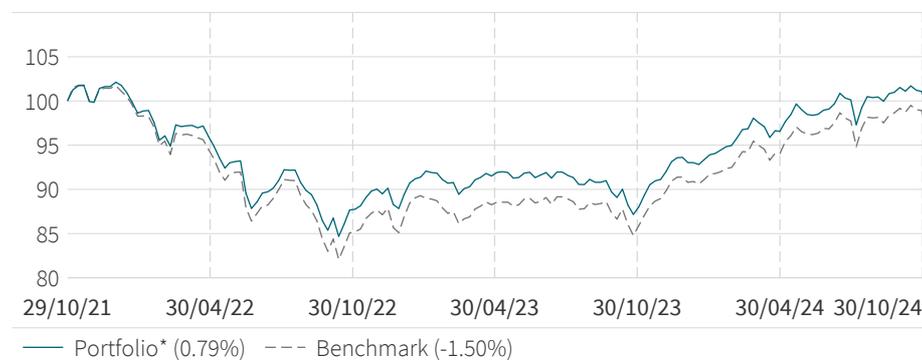
	Stichtag	ex-Datum	Dividende je Anteil	12-Monats-Rendite
Dez 2019	29/11/2019	02/12/2019	7.00	0.51
Dez 2020	30/11/2020	01/12/2020	7.57	0.56
Dez 2021	30/11/2021	01/12/2021	6.79	0.45
Dez 2022	30/11/2022	01/12/2022	7.68	0.57
Dez 2023	30/11/2023	01/12/2023	21.79	1.62

12-Monatsrendite = (Summe der Dividenden) / (Schluss-NIW). Die 12-Monatsrendite wird basierend auf der Summe der Ausschüttungen in den vorherigen 12 Monaten und dem letzten NIW berechnet. Die 12-Monatsrendite kann höher oder niedriger als die tatsächliche jährliche Dividendenrendite sein. Eine positive Ausschüttungsrendite ist nicht mit einem positiven Gesamtertrag gleichzusetzen. Die Dividenden sind nicht garantiert. Aus den Dividenden in der Vergangenheit kann nicht auf die künftigen Dividenden geschlossen werden.

Anleger sollten sich bei Anlageentscheidungen nicht ausschließlich auf die in der obigen Tabelle enthaltenen Informationen verlassen. Sie sollten das Angebotsdokument (einschließlich der Eckdaten) des Fonds lesen, das weitere Einzelheiten enthält, unter anderem zu den Risikofaktoren.

Performance & Risiken

Wertentwicklung (CHF)



Die Daten von AXA IM sind auf der Basis von 100 zum Anfangsdatum der Grafik angegeben.

Performanceberechnungen verstehen sich nach Abzug von Gebühren, bei Wiederanlage von Dividenden. Sofern eine Benchmark angegeben ist, könnte sie auf der Basis von Netto- oder Bruttodividenden berechnet sein. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt.

* Datum des ersten Nettoinventarwerts: 12/03/2010

Quellen : AXA Investment Managers - FTSE - GICS - MSCI per 30/10/2024

Weitere Informationen über AXA IM finden Sie unter axa-im.com

Benchmark

Seit: 01/10/2021

25% SPI Total Return Gross + 20% ICE BofA Global Large Cap Hedged CHF + 20% MSCI AC World Ex Switzerland Total Return Net + 15% SBI Domestic AAA-BBB Total Return + 5% Bloomberg Global Aggregate OECD Hedged CHF + 5% FTSE EPRA Nareit Euro Zone Total Return Net + 5% SARON Index + 5% SXI Real Estate Funds Total Return Gross

Der Fonds wird aktiv verwaltet, mit einer Abweichung, die im Hinblick auf die Zusammensetzung und die Wertentwicklung im Vergleich zum Referenzindex begrenzt sein sollte.

Fonds-Profil

ESG-Rating 

Relatives ESG Rating

Niedriger  Höher

Relative CO2-Intensität

Mehr CO2  Weniger CO2

% des verwalteten Vermögens, das vom absoluten ESG-Rating abgedeckt wird: Portfolio = 80.8%
Benchmark = 87.5% (nicht bedeutend bei einer Abdeckung von weniger als 50%)

% des verwalteten Vermögens, das vom Indikator der CO2-Intensität abgedeckt wird: Portfolio = 73.8%
Benchmark = 73.7% (nicht bedeutend bei einer Abdeckung von weniger als 50%)

Mehr Informationen über die Methodik finden Sie weiter unten im Abschnitt „Definition von ESG-Kennzahlen“.

Fondsmanager

Frédérique MAHERAULT

Brenda CLARKE - Co-Manager

Performance & Risiken (Fortsetzung)

Risikoanalyse

	1J	3J	5J	Auflage
Portfolio Volatilität* (%)	5.69	8.21	8.59	6.55
Benchmark Volatilität (%)	5.89	8.71	8.72	6.55
Relatives Risiko/Tracking Error (%)	0.91	1.13	1.24	0.96
Sharpe Ratio	2.81	0.19	0.39	0.63
Information Ratio	0.09	1.11	0.49	0.31

Alle Definitionen der Risikoindikatoren finden Sie weiter unten im Abschnitt „Glossar“.

Rollierende Performance (%)

	1M	3M	6M	YTD	3J	5J	31/10/23 31/10/24	31/10/22 31/10/23	31/10/21 31/10/22	31/10/20 31/10/21	31/10/19 31/10/20	Auflage
Portfolio*	-0.86	0.39	4.38	8.00	0.79	11.15	14.90	-0.41	-11.92	15.64	-4.64	65.48
Benchmark	-0.76	0.44	4.73	8.11	-1.50	10.55	15.38	-0.18	-14.48	15.18	-2.56	71.75
Abstände	-0.10	-0.05	-0.35	-0.10	2.29	0.61	-0.48	-0.23	2.56	0.46	-2.08	-6.27

Performance im Kalenderjahr (%)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portfolio*	6.28	-14.01	10.80	-0.03	14.60	-6.56	9.86	1.90	0.73	9.50
Benchmark	7.04	-16.34	10.02	2.19	15.11	-5.07	9.32	3.06	0.35	10.51
Abstände	-0.76	2.32	0.78	-2.22	-0.51	-1.49	0.54	-1.16	0.38	-1.01

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Ergebnisse. Performanceberechnungen verstehen sich nach Abzug von Gebühren, bei Wiederanlage von Dividenden. Sofern eine Benchmark angegeben ist, könnte sie auf der Basis von Netto- oder Bruttodividenden berechnet sein. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt.

* Datum des ersten Nettoinventarwerts: 12/03/2010

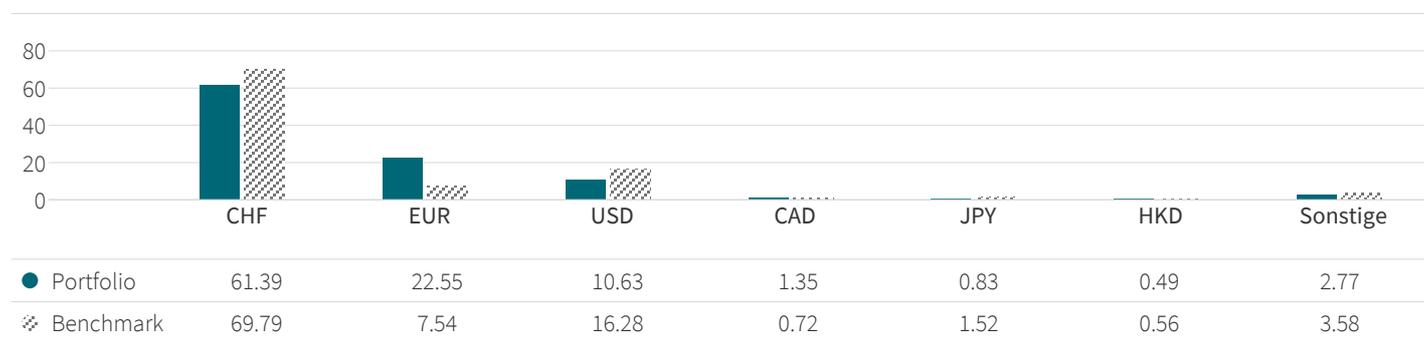
Portfolioanalyse

Portfolio-Strukturierung (%)



	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024	29/02/2024	28/03/2024	30/04/2024	31/05/2024	28/06/2024	31/07/2024	30/08/2024	30/09/2024	30/10/2024
● Aktien	56.36	55.43	55.76	58.29	59.19	59.39	60.34	54.55	54.98	56.70	56.25	57.09
● Anleihen	43.64	44.57	44.24	41.71	40.81	40.61	39.66	45.45	45.02	43.30	43.75	42.91

Engagement nach Wahrung (%)



Aktien

Top 10 Positionen

Aktie	Gewichtung (%)	Sektor	Geografie
AXA Swiss - Global Factors	15.57	Fonds	International
AXA CH Strategy Fund-Swiss ...	14.25	Fonds	Schweiz
Swisscanto CH Index Equity ...	9.14	Fonds	Schweiz
AXA WF Sustainable Equity QI	6.34	Fonds	International
SWC CH Index REF Switzerlan...	4.72	Fonds	Schweiz
AXA WF Europe Real Estate	3.12	Fonds	Europa
MSCI EMGMKT DEC24 Expo	1.97	Nicht klassifiziert	Pays Emergent
BNP Paribas Easy FTSE EPRA ...	1.53	Fonds	Euroland
UBS CH Property Fund - Swis...	0.44	Fonds	Schweiz
Summe (%)	57.09		

Die aufgeführten Unternehmen dienen ausschließlich zur Veranschaulichung zum Zeitpunkt dieses Berichts und sind später möglicherweise nicht mehr im Portfolio enthalten. Es ist nicht als Empfehlung für den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren aufzufassen.

Sektorengewichtung (%)

	Portfolio	Benchmark
Fonds	25.52	0.00
Finanzen	11.76	23.75
Gesundheit	11.72	19.59
Industrieunternehmen	11.21	9.51
Informatik	9.51	10.40
Real Estate	9.25	10.02
Kurzleb. Konsumg.	7.36	9.32
Dauerh. Konsumg.	4.84	6.25
Komm. Dienste	3.91	3.36
Werkstoffe	3.14	5.12
Öffentliche Dienste	1.33	1.12
Energie	0.45	1.55

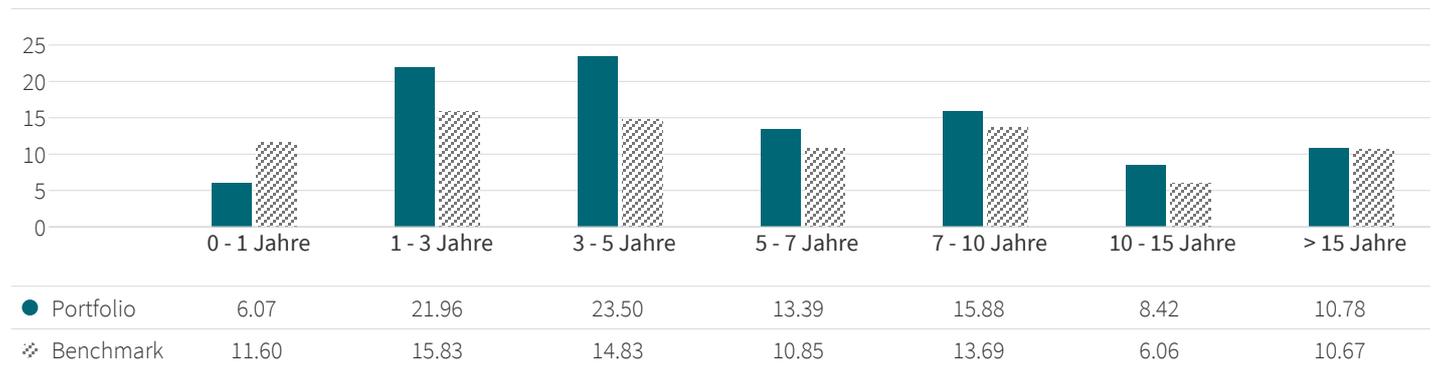
Anleihen

Top 10 Positionen

Name	Gewichtung (%)	Investiert in	Mod. Duration	Beitrag
AXA IM Swiss Fund	18.09	Schweiz	7.0	1.27
AXA WF Global Responsible Aggregate	6.81	International	7.0	0.48
AXA WF Global Responsible Aggregate	3.96	International	7.0	0.28
AXA WF ACT Emerging Markets Short	3.00	International	2.7	0.08
AXA WF ACT Green Bonds	2.77	International	6.1	0.17
AXA WF Euro Credit Short Duration	2.21	Europa	2.0	0.04
AXA WF Euro Credit Total Return	1.99	Pays de l'OCDE	3.6	0.07
AXA WF Global Strategic Bonds	1.58	International	5.3	0.08
EURO-BUND FUTURE DEC24 Expo	1.39	Deutschland	7.7	0.11
EURO-BUND FUTURE DEC24 Margin	-0.01	Deutschland	0.0	0.00
Summe (%)	41.80			

Die aufgeführten Unternehmen dienen ausschließlich zur Veranschaulichung zum Zeitpunkt dieses Berichts und sind später möglicherweise nicht mehr im Portfolio enthalten. Es ist nicht als Empfehlung für den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren aufzufassen.

Engagement nach Laufzeit (%)



Weitere Informationen

Wichtige Fondsdaten: 1 CHF

Rechtsform	Anlagefonds
UCITS	Nein
AIF-konform	Nein
Domizil	Schweiz
Datum des ersten Nettoinventarwerts	12/03/2010
Währung Anteilsklasse	CHF
Bewertung	Täglich
Anteilstyp	Ausschüttend
ISIN code	CH0105340019
Maximale Ausgabekommission	5%
Maximale Rücknahmekommission	5%
Verwaltungsvergütung	0.05%
Maximale Verwaltungsgebühr	1.5%
Verwaltungsgesellschaft	AXA Investment Managers Schweiz AG
Portfolio Management	AXA INVESTMENT MANAGERS PARIS S.A.
Delegierung der Kontoverwaltung	State Street Bank International GmbH, Muenchen, Zweigniederlassung Zuerich
Depotbank	State Street Bank International GmbH, Muenchen, Zweigniederlassung Zuerich

Wie im letzten Jahresbericht angegeben, berücksichtigt die Berechnung der laufenden Kosten keine Performancegebühren, beinhaltet jedoch die Verwaltungsgebühren und die erhobenen Servicegebühren. Die effektive erhobene Servicegebühr läuft bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts auf und wird in den laufenden Kosten der einzelnen Anteilsklassen berücksichtigt. Die Anlage vermindert sich um die Zahlung der oben genannten Gebühren.

Fondsziele

Beim AXA Swiss Institutional Fund - Multi Asset Plus handelt es sich um einen Anlagefonds für qualifizierte Anleger mit dem Ziel, regelmässig einen stark diversifizierten Vergleichsindex zu schlagen. Dieser Vergleichsindex (Strategische Asset Allokation) setzt sich aus 35% Aktienanlagen, 45% Obligationen, 10% Immobilien und 10% Alternative Anlagen zusammen. Bei der Umsetzung stützt sich der Portfolio Manager im Wesentlichen auf drei Säulen: Erstens auf eine aktive taktische Asset Allokation; zweitens auf eine breit gestreute Diversifizierung der Anlageklassen (Aktien, Obligationen, Immobilien, Alternative Anlagen wie Hedge Fonds, Private Equity, Infrastruktur und Rohstoffe) und drittens zur Optimierung der Portfoliostruktur und zur Portfoliokonstruktion auf adäquate Risiko-/ Returnmodelle. Die BVV2-Anlagebegrenzungen werden jederzeit eingehalten.

Der empfohlene Anlagehorizont für den AXA Swiss Institutional Fund - Multi Asset Plus beträgt fünf Jahre.

Anlagehorizont

Dieser Teilfonds ist unter Umständen für Anleger nicht geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von 5 Jahren aus dem Teilfonds wieder zurückziehen wollen.

Zeichnung Rücknahme

Informationen zur Order-Abwicklung für institutionelle Kunden: Tel.: +41 58 360 79 00 Fax: +41 58 360 78 63; e-mail: instclientservice_ch@axa-im.com

Wie anlegen?

Bevor sie eine Anlage vornehmen, sollten Anleger den entsprechenden Verkaufsprospekt und die Wesentlichen Anlegerinformationen (insbesondere für Anleger im Vereinigten Königreich), Wesentlichen Informationen (Key Information Document) und Programmdokumente lesen. Diese enthalten alle Produktdetails einschließlich der Anlagegebühren und -risiken. Die Informationen in diesem Dokument sind kein Ersatz für diese Dokumente oder eine professionelle externe Beratung.

Privatanleger

Privatanleger sollten sich an ihren Finanzintermediär wenden.

ESG-Rating

Das absolute ESG Rating basiert auf einer Scoring-Methode eines Drittanbieters. Ein Baum (5 Bäume) bedeutet (bedeuten), dass sich der Fonds in der niedrigsten (höchsten) ESG-Bewertungskategorie befindet.

Weitere Informationen zur Methodik finden Sie unter <https://www.axa-im.com/responsible-investing>.

Das relative ESG Rating basiert auf der Differenz zwischen dem absoluten ESG Ratings des Portfolios und dem absoluten ESG Rating der Benchmark. Ist das relative ESG Rating positiv (negativ), bedeutet dies, dass das Portfolio ein höheres (niedrigeres) absolutes ESG Rating

Weitere Informationen (Fortsetzung)

als die Benchmark hat.

Die relative CO₂-Intensität basiert auf der Differenz zwischen der CO₂-Intensität des Portfolios (ausgedrückt in tCO₂/M€ Erträge) und derjenigen der Benchmark. Eine CO₂-Intensität im grünen Bereich bedeutet, dass die CO₂-Intensität geringer ist als die der Benchmark. Orange bedeutet, dass die CO₂-Intensität des Portfolios höher ist als die der Benchmark. Gelb bedeutet, dass die CO₂-Intensität des Portfolios ähnlich ist wie die der Benchmark. ESG Indikatoren dienen lediglich der Information.

Das Portfolio verfolgt keine regulatorischen oder vertraglichen Ziele in Bezug auf ESG-Indikatoren.

Wichtige Hinweise

Diese Marketing-Kommunikation stellt keine Aufforderung oder Anlage-, Rechts- oder Steuerberatung von AXA Investment Managers dar. Diese Materialien enthalten keine ausreichenden Informationen, um als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen zu werden. Die hier enthaltenen Informationen sind ausschließlich für die natürlichen und/oder juristischen Personen bestimmt, denen sie ausgehändigt wurden, sofern nicht gemäß geltenden Vereinbarungen etwas anderes zulässig ist.

Wie der Besitz, der Erwerb oder die Veräußerung von Aktien oder Anteilen eines Fonds steuerlich behandelt werden, hängt von dem jeweiligen Steuerstatus bzw. der jeweiligen steuerlichen Behandlung des betreffenden Anlegers ab und kann Änderungen unterworfen sein. Potenziellen Anlegern wird dringend empfohlen, die Meinung ihres eigenen Steuerberaters einzuholen.

Aufgrund der vereinfachten Darstellung ist dieses Dokument unvollständig. Meinungen, Schätzungen und Prognosen in diesem Dokument sind subjektiv und können sich jederzeit ändern. Es gibt keine Garantie, dass sich Prognosen erfüllen werden. Daten, Zahlen, Aussagen, Analysen, Prognosen und sonstige Informationen in diesem Dokument entsprechen unserem Wissensstand zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokuments. Trotz der Sorgfalt bei der Abfassung wird keine ausdrückliche oder implizite Zusicherung oder Gewährleistung (einschließlich Haftung gegenüber Dritten) für die Richtigkeit, Verlässlichkeit oder Vollständigkeit der in diesem Dokument enthaltenen Informationen abgegeben. Diese Materialien enthalten keine ausreichenden Informationen, um als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen zu werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für aktuelle oder zukünftige Erträge. In den Angaben zur Wertentwicklung bzw. zu den Erträgen sind Provisionen und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen, nicht berücksichtigt. Der Wert von Kapitalanlagen und die damit erzielten Erträge können sowohl steigen als auch fallen, und unter Umständen erhalten Anleger den ursprünglich investierten Betrag nicht wieder vollständig zurück. Wechselkursschwankungen können den Wert von Anlagen ebenfalls beeinflussen. Deshalb und aufgrund des gewöhnlich erhobenen Ausgabeaufschlags eignet sich eine Anlage in der Regel nicht als kurzfristige Position. Provisionen und Kosten können die Performance des Fonds beeinträchtigen.

Die Fondsmerkmale bieten Anlegern keinen Schutz vor den potenziellen Auswirkungen der Inflation im Laufe der Zeit. Die Anlagen und/oder gegebenenfalls in einem bestimmten Zeitraum generierte Erträge werden nicht an die Inflationsrate im entsprechenden Zeitraum angepasst. Somit kann der inflationsbereinigte Fondsertrag negativ ausfallen. Infolgedessen besteht die Gefahr, dass die Inflation die Wertentwicklung und/oder den Wert Ihrer Anlage beeinträchtigt.

Der in diesem Dokument erwähnte Fonds wurde nicht gemäß dem United States Investment Company Act of 1940 in der derzeit geltenden Fassung noch gemäß dem United States Securities Act of 1933 in seiner geltenden Fassung registriert. Keiner der Anteile darf direkt oder indirekt in den USA oder US-Personen angeboten oder verkauft werden, sofern die Wertpapiere nicht gemäß dem Gesetz registriert sind oder eine Ausnahme von der Registrierungspflicht im Rahmen des Gesetzes vorliegt. Eine US-Person ist definiert als (a) eine Person, die für die Zwecke der US-Bundeseinkommensteuer Staatsbürger oder Einwohner der Vereinigten Staaten ist, (b) ein Unternehmen, eine Partnerschaft oder eine andere Organisation, die gemäß den Gesetzen der USA errichtet ist oder besteht, (c) ein Nachlass oder Trust, dessen Erträge der US-Bundesertragssteuer unterliegen, unabhängig davon, ob diese Erträge effektiv mit einem Gewerbe oder Geschäft in den Vereinigten Staaten zusammenhängen. In den USA dürfen diese Materialien nur einer Person ausgehändigt werden, die eine „Vertriebsstelle“ oder keine „US-Person“ gemäß der Definition in Regulation S des U.S. Securities Act von 1933 (in der geltenden Fassung) ist.

Für die bessere Darstellung der Länder- und Sektorallokation sowie der wichtigsten Engagements und aktiven Positionen, werden Aktien und aktienähnliche Vehikel ein und desselben Unternehmens (ADR, GDR, RSP, Rechte usw.) zusammengefasst, um ein einziges Engagement in diesem Unternehmen zu bilden.

Die aufgeführten Unternehmen dienen ausschließlich zur Veranschaulichung zum Zeitpunkt dieses Berichts und sind später möglicherweise nicht mehr im Portfolio enthalten. Es stellt kein Investmentresearch und keine Finanzanalyse bezüglich Transaktionen mit Finanzinstrumenten dar. Ferner stellt es kein Angebot zum Kauf oder Verkauf von Anlagen, Produkten oder Dienstleistungen dar und sollte nicht als Aufforderung oder Anlage-, Rechts- oder Steuerberatung, Empfehlung für eine Anlagestrategie oder individuelle Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren angesehen werden.

Weiteren Informationen über nachhaltigkeitsbezogene Aspekte sind zu finden unter <https://www.axa-im.com/what-is-sfdr>.

Abhängig von der jeweiligen Gerichtsbarkeit oder Region des Empfängers gilt Folgendes Zusätzliche Angaben können gelten:

Weitere Informationen (Fortsetzung)

Für den AXA Swiss Institutional Fund, einen vertraglichen offenen Dachfonds unter Schweizer Recht (Kategorie: Übrige Fonds für traditionelle Anlagen) für professionelle Anleger, erhalten Sie den Fondsvertrag samt Anhang und die Jahresberichte kostenlos bei der Fondsleitung: AXA Investment Managers Schweiz AG, Ernst-Nobs-Platz 7, P.O. Box 1078, CH-8021 Zürich. Die Depotbank ist State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, CH-8002 Zürich. Erfüllungsort und Gerichtsstand für die in der Schweiz vertriebenen Anteile ist Zürich, Schweiz.

Haftungsausschluss der Anbieter externer Finanzdaten

FTSE

FTSE International Limited («FTSE») © FTSE. [2024] FTSE® ist ein Markenname der London Stock Exchange Plc und der The Financial Times Limited und wird von FTSE aufgrund einer Lizenz verwendet. Alle Rechte der FTSE Indexe liegen bei FTSE und/oder ihren Lizenzgebern. Weder die FTSE noch ihre Lizenzgeber akzeptieren irgendeine Haftung für irgendwelche Fehler oder Auslassungen bei den FTSE-Indizes oder den ihnen zugrunde liegenden Daten. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von FTSE ist keinerlei weitere Verbreitung von FTSE-Daten erlaubt.

MSCI

Weder MSCI noch irgendeine andere Partei, die an der Aufbereitung, der Berechnung oder der Erstellung von MSCI-Daten beteiligt war oder damit in Verbindung stand, räumt irgendwelche ausdrücklichen oder impliziten Garantien oder Sicherheiten hinsichtlich dieser Daten (oder hinsichtlich der durch ihre Verwendung erzielten Ergebnisse) ein, und alle vorbenannten Parteien schliessen hiermit ausdrücklich alle Garantien auf die Echtheit, die Richtigkeit, die Vollständigkeit, die Verkäuflichkeit oder die Eignung irgendwelcher dieser Daten für einen bestimmten Zweck ein. Ohne irgendeine Einschränkung der vorstehenden Klausel und unter keinen Umständen werden MSCI oder irgendeines der ihr angeschlossenen Unternehmen oder eine andere dritte Partei, die an der Aufbereitung, Berechnung oder Erstellung der Daten beteiligt ist oder damit in Verbindung steht, für irgendwelche direkten, indirekten, besonderen, strafweise verhängten, Folge- oder anderen Schäden (einschliesslich entgangener Gewinne) haften, selbst wenn auf die Möglichkeit solcher Schäden hingewiesen wurde. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von MSCI ist keine weitere Verbreitung oder Weitergabe der MSCI-Dateien erlaubt.

GICS

Der Global Industry Classification Standard ("GICS") ist ausschliessliches Eigentum und die Dienstleistungsmarke der MSCI Inc. ("MSCI") und der Standard & Poor's, einer Abteilung der The McGraw-Hill Companies, Inc. ("S&P"), und der Gebrauch ist Gegenstand einer Lizenzvergabe an AXA Investment Managers Paris. Weder MSCI, noch S&P, noch irgendeine dritte Partei, die an der Erstellung oder Aufbereitung des GICS beteiligt sind, räumen irgendwelche ausdrücklichen oder impliziten Garantien oder Sicherheiten ein und haften in keiner Weise für den GICS oder die Ergebnisse, die durch dessen Verwendung erzielt werden.

Glossar

Volatilität (%): ist ein indikatives Maß für die Schwankungsbreite der Preisänderungen eines Vermögenswerts im Zeitverlauf.

Relatives Risiko/Tracking Error (%): Misst die Schwankung (Standardabweichung) der Renditen eines Portfolios im Verhältnis zur Schwankung der Renditen eines Referenzindex. Der Tracking Error lässt Rückschlüsse darauf zu, wie aktiv ein Fonds verwaltet wird. Je niedriger die Zahl ist, desto enger folgt die historische Performance des Fonds seiner Benchmark.

Sharpe Ratio: ist das Maß für die risikobereinigte Überrendite im Vergleich zum risikofreien Zinssatz eines Finanzportfolios und wird verwendet, um die Überrendite einer Anlage mit ihrem Risiko zu vergleichen. Je höher die Sharpe Ratio, desto besser ist die Rendite im Vergleich zum eingegangenen Risiko.

Information Ratio (IR): ist ein Maß für die Portfoliorenditen, die über den Renditen einer Benchmark liegen, und der Volatilität dieser Überrenditen. Die IR wird verwendet, um die Überrendite gegenüber einer Benchmark mit dem über die Benchmark hinausgehenden Risiko zu vergleichen. Beispiel: Ein Manager, der eine Benchmark um 2 % p. a. übertrifft, hat einen höheren IR als ein Manager mit der gleichen Outperformance, der ein höheres Risiko eingegangen ist.