

MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.47 %	3.42 %	0.77 %	1.09	-1.99	1.07	-2.04 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.53 %	3.42 %	0.76 %	1.11	-1.92	1.07	-1.98 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.58 %	3.42 %	0.76 %	1.13	-1.85	1.07	-1.93 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	7.11 %	3.63 %	-	1.48	-	-	-	-3.00 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	0.48 %	6.37 %	1.11 %	-0.19	-0.25	0.94	-0.31 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	0.54 %	6.37 %	1.11 %	-0.18	-0.19	0.94	-0.25 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	0.59 %	6.37 %	1.11 %	-0.18	-0.15	0.94	-0.20 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	0.73 %	6.70 %	-	-0.15	-	-	-	-13.35 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.36 %	6.76 %	1.21 %	0.09	-0.43	0.98	-0.50 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.44 %	6.76 %	1.21 %	0.11	-0.36	0.98	-0.42 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.49 %	6.76 %	1.21 %	0.11	-0.32	0.98	-0.37 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	2.89 %	6.82 %	-	0.17	-	-	-	-13.35 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.48 %	5.86 %	1.14 %	0.30	-0.44	0.98	-0.48 %	-12.97 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.58 %	5.86 %	1.14 %	0.32	-0.35	0.98	-0.37 %	-12.93 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.64 %	5.86 %	1.14 %	0.33	-0.31	0.98	-0.32 %	-12.90 %	18.00
MO35 Customised	3.99 %	5.84 %	-	0.39	-	-	-	-13.35 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2014 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.71 % (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