

MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	6.98 %	3.60 %	0.75 %	1.49	-1.53	0.90	-0.53 %	-1.08 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	7.04 %	3.60 %	0.75 %	1.51	-1.45	0.90	-0.46 %	-1.08 %	2.00
MO30 Customised	8.19 %	3.97 %	-	1.66	-	-	-	-0.96 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2024 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	-0.04 %	5.65 %	1.93 %	-0.28	0.34	0.77	0.23 %	-12.36 %	26.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.01 %	5.65 %	1.93 %	-0.27	0.37	0.77	0.28 %	-12.34 %	26.00
MO30 Customised	-0.82 %	7.23 %	-	-0.33	-	-	-	-16.11 %	27.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.80 %	6.51 %	1.71 %	0.04	-0.09	0.85	-0.02 %	-12.51 %	27.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.83 %	6.51 %	1.72 %	0.04	-0.07	0.85	0.02 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	1.86 %	7.54 %	-	0.04	-	-	-	-16.11 %	27.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.81 %	5.66 %	1.50 %	0.22	-0.30	0.88	-0.21 %	-12.51 %	27.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.83 %	5.66 %	1.50 %	0.22	-0.29	0.88	-0.19 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.23 %	6.28 %	-	0.27	-	-	-	-16.11 %	27.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (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