



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	5.06 %	3.91 %	0.73 %	1.29	0.08	0.93	0.42 %	-2.26 %	4.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.13 %	3.91 %	0.73 %	1.31	0.17	0.93	0.48 %	-2.25 %	4.00
MO30 Customised	4.99 %	4.27 %	-	1.17	-	-	-	-2.39 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	5.59 %	3.63 %	1.01 %	1.54	-0.79	0.84	0.24 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.66 %	3.63 %	1.01 %	1.56	-0.73	0.84	0.30 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	6.40 %	4.25 %	-	1.51	-	-	-	-3.62 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.46 %	4.99 %	1.64 %	0.50	0.15	0.79	0.80 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.50 %	4.99 %	1.64 %	0.51	0.18	0.79	0.84 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	2.12 %	6.22 %	-	0.35	-	-	-	-16.11 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.18 %	5.34 %	1.47 %	0.60	-0.24	0.87	0.16 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.20 %	5.34 %	1.47 %	0.60	-0.22	0.87	0.18 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	3.49 %	6.00 %	-	0.59	-	-	-	-16.11 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 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