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	8.44 %	3.01 %	0.90 %	2.80	-0.62	1.12	-1.75 %	-2.76 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	8.51 %	3.01 %	0.90 %	2.83	-0.55	1.12	-1.68 %	-2.75 %	2.00
MO30 Customised	*9.06 %*	*3.58 %*	-	*2.53*	-	-	-	*-2.17 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	5.98 %	4.06 %	1.03 %	1.48	-0.68	0.90	-0.08 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	6.05 %	4.06 %	1.03 %	1.50	-0.62	0.90	-0.01 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	*6.70 %*	*4.37 %*	-	*1.54*	-	-	-	*-3.62 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.06 %	5.11 %	1.59 %	0.41	0.12	0.81	0.63 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.11 %	5.11 %	1.59 %	0.42	0.15	0.81	0.68 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	*1.78 %*	*6.17 %*	-	*0.30*	-	-	-	*-16.11 %*	*36.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.52 %	5.44 %	1.46 %	0.66	-0.19	0.87	0.26 %	-12.51 %	28.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.55 %	5.44 %	1.46 %	0.66	-0.17	0.87	0.28 %	-12.49 %	26.00
MO30 Customised	*3.75 %*	*6.07 %*	-	*0.63*	-	-	-	*-16.11 %*	*36.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus