



MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Indicateurs de risque

| 1 année | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|---------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | -1.49 % | 2.44 % | 1.02 % | -0.28 | 1.08 | 0.86 | 0.85 % | -4.11 % | - |
| MO15 Customised | -2.58 % | 2.53 % | - | -0.70 | - | - | - | -4.93 % | - |

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2022 Période de base: mensuel

| 3 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 1.89 % | 4.25 % | 1.16 % | 0.63 | 0.12 | 0.95 | 0.27 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 1.74 % | 4.30 % | - | 0.59 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Période d'observation: 01.04.2019 au 31.03.2022 Période de base: mensuel

| 5 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.19 % | 3.61 % | 1.17 % | 0.82 | -0.08 | 0.95 | 0.05 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 2.28 % | 3.58 % | - | 0.85 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Période d'observation: 01.04.2017 au 31.03.2022 Période de base: mensuel

| 10 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.99 % | 3.17 % | 1.13 % | 1.19 | -0.25 | 0.91 | 0.08 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 3.28 % | 3.28 % | - | 1.23 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Période d'observation: 01.04.2012 au 31.03.2022 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.79 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

| Chiffre-clé | Calcul | Description |
|-----------------------------------|---|--|
| Volatilité | $\sqrt{\text{Variance}}$ | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne |
| Ratio de Sharpe | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$ | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru |
| Tracking error | Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark) | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif) Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$ | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru |
| Coefficient bêta | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$ | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché |
| Alpha de Jensen | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$ | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période |
| Délai de récupération | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée |
| Duration modifiée | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$ | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt |