



## MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

### 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 35 I   | 5.14 % | 3.60 %     | 0.75 %         | 0.90         | -2.04             | 1.07             | -1.96 %         | -3.59 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 5.20 % | 3.60 %     | 0.75 %         | 0.91         | -1.96             | 1.07             | -1.90 %         | -3.57 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 5.25 % | 3.60 %     | 0.75 %         | 0.93         | -1.89             | 1.07             | -1.85 %         | -3.56 %            | 2.00                  |
| MO35 Customised     | 6.77 % | 3.81 %     | -              | 1.27         | -                 | -                | -               | -3.00 %            | 2.00                  |

Période d'observation: 01.07.2023 au 30.06.2024 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 35 I   | -0.53 % | 6.34 %     | 1.11 %         | -0.38        | -0.64             | 0.94             | -0.79 %         | -12.97 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | -0.47 % | 6.34 %     | 1.11 %         | -0.37        | -0.58             | 0.94             | -0.73 %         | -12.93 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | -0.42 % | 6.34 %     | 1.11 %         | -0.36        | -0.54             | 0.94             | -0.68 %         | -12.90 %           | 21.00                 |
| MO35 Customised     | 0.15 %  | 6.68 %     | -              | -0.26        | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 21.00                 |

Période d'observation: 01.07.2021 au 30.06.2024 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 35 I   | 2.02 % | 6.74 %     | 1.23 %         | 0.02         | -0.52             | 0.98             | -0.62 %         | -12.97 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 2.10 % | 6.74 %     | 1.23 %         | 0.03         | -0.45             | 0.98             | -0.55 %         | -12.93 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 2.15 % | 6.75 %     | 1.23 %         | 0.04         | -0.41             | 0.98             | -0.50 %         | -12.90 %           | 21.00                 |
| MO35 Customised     | 2.66 % | 6.78 %     | -              | 0.11         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 21.00                 |

Période d'observation: 01.07.2019 au 30.06.2024 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 35 I   | 3.25 % | 5.87 %     | 1.15 %         | 0.23         | -0.50             | 0.98             | -0.56 %         | -12.97 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 3.36 % | 5.87 %     | 1.15 %         | 0.25         | -0.41             | 0.98             | -0.45 %         | -12.93 %           | 21.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 3.41 % | 5.87 %     | 1.15 %         | 0.26         | -0.37             | 0.98             | -0.40 %         | -12.90 %           | 21.00                 |
| MO35 Customised     | 3.84 % | 5.85 %     | -              | 0.33         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 21.00                 |

Période d'observation: 01.07.2014 au 30.06.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.89 % (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)<br>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                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | 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   |