



## 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   | 4.01 % | 4.56 %     | 1.19 %         | 0.55         | -0.81             | 0.86             | -0.45 %         | -2.15 %            | 1.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 4.07 % | 4.56 %     | 1.19 %         | 0.56         | -0.76             | 0.86             | -0.39 %         | -2.14 %            | 1.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 4.13 % | 4.56 %     | 1.19 %         | 0.57         | -0.72             | 0.86             | -0.34 %         | -2.14 %            | 1.00                  |
| MO35 Customised     | 4.97 % | 4.94 %     | -              | 0.70         | -                 | -                | -               | -2.95 %            | 1.00                  |

Période d'observation: 01.10.2022 au 30.09.2023 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   | 0.83 % | 6.58 %     | 1.12 %         | -0.10        | 0.11              | 0.93             | 0.10 %          | -12.97 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 0.90 % | 6.58 %     | 1.12 %         | -0.09        | 0.17              | 0.93             | 0.17 %          | -12.93 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 0.95 % | 6.58 %     | 1.12 %         | -0.08        | 0.22              | 0.93             | 0.22 %          | -12.90 %           | 12.00                 |
| MO35 Customised     | 0.67 % | 6.96 %     | -              | -0.12        | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 12.00                 |

Période d'observation: 01.10.2020 au 30.09.2023 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   | 1.63 % | 6.85 %     | 1.22 %         | 0.02         | -0.47             | 0.98             | -0.56 %         | -12.97 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 1.72 % | 6.85 %     | 1.21 %         | 0.03         | -0.40             | 0.98             | -0.47 %         | -12.93 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 1.77 % | 6.86 %     | 1.22 %         | 0.04         | -0.36             | 0.98             | -0.42 %         | -12.90 %           | 12.00                 |
| MO35 Customised     | 2.20 % | 6.90 %     | -              | 0.10         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 12.00                 |

Période d'observation: 01.10.2018 au 30.09.2023 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   | 3.23 % | 5.74 %     | 1.16 %         | 0.30         | -0.45             | 0.98             | -0.49 %         | -12.97 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 3.34 % | 5.74 %     | 1.16 %         | 0.32         | -0.36             | 0.98             | -0.38 %         | -12.93 %           | 12.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 3.39 % | 5.74 %     | 1.16 %         | 0.33         | -0.31             | 0.98             | -0.33 %         | -12.90 %           | 12.00                 |
| MO35 Customised     | 3.76 % | 5.73 %     | -              | 0.39         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 12.00                 |

Période d'observation: 01.10.2013 au 30.09.2023 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.49 % (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                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$ | 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   |