

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-7.49 %	4.45 %	1.06 %	-1.51	0.75	0.99	0.64 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-7.44 %	4.45 %	1.06 %	-1.50	0.81	0.99	0.70 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-7.39 %	4.45 %	1.06 %	-1.49	0.86	0.99	0.75 %	-8.89 %	-
MO25 Customised	-8.24 %	4.57 %	-	-1.63	-	-	-	-9.78 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.67 %	5.96 %	1.29 %	0.23	0.11	1.02	0.11 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	0.76 %	5.96 %	1.29 %	0.25	0.18	1.02	0.19 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	0.81 %	5.96 %	1.29 %	0.25	0.22	1.03	0.24 %	-8.89 %	-
MO25 Customised	0.54 %	5.68 %	-	0.22	-	-	-	-9.78 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.96 %	5.23 %	1.20 %	0.51	-0.17	1.05	-0.36 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	2.06 %	5.23 %	1.20 %	0.53	-0.09	1.05	-0.25 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	2.11 %	5.23 %	1.20 %	0.54	-0.04	1.05	-0.20 %	-8.89 %	-
MO25 Customised	2.18 %	4.87 %	-	0.59	-	-	-	-9.78 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2017 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.73 %	4.56 %	1.26 %	0.97	0.23	1.04	0.13 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.85 %	4.56 %	1.26 %	1.00	0.33	1.04	0.26 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.90 %	4.56 %	1.26 %	1.01	0.37	1.04	0.31 %	-8.89 %	-
MO25 Customised	3.43 %	4.23 %	-	0.98	-	-	-	-9.78 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2012 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.71 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-7.49 %	4.45 %	2.30 %	-1.51	2.10	0.88	2.93 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-7.44 %	4.45 %	2.29 %	-1.50	2.13	0.88	2.99 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-7.39 %	4.45 %	2.29 %	-1.49	2.15	0.88	3.04 %	-8.89 %	-
BVG 25 (2000)	-11.81 %	5.26 %	-	-2.09	-	-	-	-12.89 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.67 %	5.96 %	1.98 %	0.23	1.21	0.92	2.30 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	0.76 %	5.96 %	1.98 %	0.25	1.25	0.92	2.38 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	0.81 %	5.96 %	1.98 %	0.25	1.28	0.92	2.44 %	-8.89 %	-
BVG 25 (2000)	-1.71 %	6.13 %	-	-0.16	-	-	-	-12.89 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.96 %	5.23 %	1.78 %	0.51	0.73	0.95	1.39 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	2.06 %	5.23 %	1.78 %	0.53	0.79	0.95	1.49 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	2.11 %	5.23 %	1.78 %	0.54	0.82	0.95	1.54 %	-8.89 %	-
BVG 25 (2000)	0.64 %	5.20 %	-	0.26	-	-	-	-12.89 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2017 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.73 %	4.56 %	1.52 %	0.97	0.74	0.96	1.28 %	-8.94 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.85 %	4.56 %	1.52 %	1.00	0.82	0.96	1.41 %	-8.92 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.90 %	4.56 %	1.52 %	1.01	0.85	0.96	1.46 %	-8.89 %	-
BVG 25 (2000)	2.57 %	4.48 %	-	0.73	-	-	-	-12.89 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2012 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.71 % (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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	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