

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	1.85 %	3.97 %	1.33 %	0.15	-0.74	0.86	-0.72 %	-4.84 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.91 %	3.97 %	1.33 %	0.17	-0.69	0.86	-0.65 %	-4.83 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.97 %	3.97 %	1.33 %	0.18	-0.66	0.86	-0.60 %	-4.82 %	9.00
MO25 Customised	2.79 %	4.56 %	-	0.34	-	-	-	-5.22 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.41 %	5.37 %	1.09 %	0.03	0.37	0.91	0.42 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.48 %	5.37 %	1.09 %	0.04	0.44	0.91	0.49 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.53 %	5.37 %	1.09 %	0.05	0.48	0.91	0.54 %	-11.11 %	9.00
MO25 Customised	0.97 %	5.81 %	-	-0.05	-	-	-	-11.81 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.72 %	5.76 %	1.25 %	0.08	-0.24	0.99	-0.29 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.81 %	5.76 %	1.25 %	0.10	-0.17	0.99	-0.20 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.86 %	5.76 %	1.25 %	0.11	-0.13	0.99	-0.15 %	-11.11 %	9.00
MO25 Customised	2.03 %	5.71 %	-	0.14	-	-	-	-11.81 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	4.80 %	1.29 %	0.43	0.03	1.00	0.05 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.41 %	4.80 %	1.29 %	0.45	0.11	1.00	0.16 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.46 %	4.80 %	1.29 %	0.46	0.15	1.00	0.21 %	-11.11 %	9.00
MO25 Customised	3.26 %	4.64 %	-	0.43	-	-	-	-11.81 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (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	1.85 %	3.97 %	2.82 %	0.15	-0.13	0.71	0.05 %	-4.84 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.91 %	3.97 %	2.82 %	0.17	-0.11	0.71	0.12 %	-4.83 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.97 %	3.97 %	2.82 %	0.18	-0.09	0.71	0.17 %	-4.82 %	9.00
BVG 25 (2000)	2.03 %	6.07 %	-	0.13	-	-	-	-6.44 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.41 %	5.37 %	2.22 %	0.03	1.08	0.78	1.96 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.48 %	5.37 %	2.22 %	0.04	1.11	0.79	2.04 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.53 %	5.37 %	2.22 %	0.05	1.13	0.79	2.09 %	-11.11 %	9.00
BVG 25 (2000)	-1.05 %	6.47 %	-	-0.35	-	-	-	-15.55 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.72 %	5.76 %	2.08 %	0.08	0.62	0.86	1.24 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.81 %	5.76 %	2.08 %	0.10	0.67	0.86	1.33 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.86 %	5.76 %	2.08 %	0.11	0.69	0.86	1.38 %	-11.11 %	9.00
BVG 25 (2000)	0.37 %	6.31 %	-	-0.14	-	-	-	-15.55 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	4.80 %	1.74 %	0.43	0.61	0.89	1.22 %	-11.19 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.41 %	4.80 %	1.74 %	0.45	0.68	0.89	1.34 %	-11.15 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.46 %	4.80 %	1.74 %	0.46	0.71	0.89	1.39 %	-11.11 %	9.00
BVG 25 (2000)	2.18 %	5.07 %	-	0.19	-	-	-	-15.55 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (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