



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	4.58 %	2.99 %	0.75 %	0.89	-1.52	1.07	-1.48 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.64 %	2.99 %	0.75 %	0.91	-1.44	1.07	-1.42 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.70 %	2.99 %	0.75 %	0.93	-1.37	1.07	-1.37 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	5.79 %	3.20 %	-	1.21	-	-	-	-2.26 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-0.49 %	5.30 %	1.07 %	-0.45	-0.41	0.92	-0.58 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.43 %	5.30 %	1.07 %	-0.44	-0.36	0.92	-0.52 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.38 %	5.30 %	1.07 %	-0.43	-0.31	0.92	-0.47 %	-11.11 %	21.00
MO25 Customised	-0.07 %	5.67 %	-	-0.35	-	-	-	-11.81 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.68 %	5.66 %	1.21 %	-0.04	-0.28	0.97	-0.33 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.76 %	5.66 %	1.21 %	-0.03	-0.22	0.97	-0.26 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.81 %	5.66 %	1.21 %	-0.02	-0.18	0.97	-0.21 %	-11.11 %	21.00
MO25 Customised	2.02 %	5.68 %	-	0.02	-	-	-	-11.81 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	2.98 %	4.89 %	1.26 %	0.22	-0.14	1.00	-0.19 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.09 %	4.90 %	1.26 %	0.24	-0.06	1.00	-0.08 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.14 %	4.90 %	1.27 %	0.25	-0.02	1.00	-0.03 %	-11.11 %	21.00
MO25 Customised	3.17 %	4.72 %	-	0.27	-	-	-	-11.81 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (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	4.58 %	2.99 %	1.67 %	0.89	-1.54	0.98	-2.67 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.64 %	2.99 %	1.67 %	0.91	-1.51	0.98	-2.61 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.70 %	2.99 %	1.67 %	0.93	-1.48	0.98	-2.55 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	7.34 %	3.71 %	-	1.46	-	-	-	-1.65 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-0.49 %	5.30 %	2.42 %	-0.45	0.24	0.76	-0.06 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.43 %	5.30 %	2.42 %	-0.44	0.26	0.76	0.00 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.38 %	5.30 %	2.42 %	-0.43	0.28	0.76	0.05 %	-11.11 %	21.00
BVG 25 (2000)	-1.15 %	6.51 %	-	-0.47	-	-	-	-15.55 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.68 %	5.66 %	2.16 %	-0.04	0.38	0.84	0.71 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.76 %	5.66 %	2.16 %	-0.03	0.41	0.84	0.79 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.81 %	5.66 %	2.16 %	-0.02	0.44	0.84	0.84 %	-11.11 %	21.00
BVG 25 (2000)	0.79 %	6.35 %	-	-0.17	-	-	-	-15.55 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	2.98 %	4.89 %	1.82 %	0.22	0.40	0.89	0.81 %	-11.19 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.09 %	4.90 %	1.82 %	0.24	0.46	0.89	0.92 %	-11.15 %	21.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.14 %	4.90 %	1.82 %	0.25	0.49	0.89	0.97 %	-11.11 %	21.00
BVG 25 (2000)	2.20 %	5.16 %	-	0.06	-	-	-	-15.55 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (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