

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	0.70 %	3.63 %	1.14 %	0.41	0.94	0.96	1.09 %	-3.60 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	0.77 %	3.63 %	1.14 %	0.43	1.00	0.96	1.16 %	-3.59 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	0.82 %	3.63 %	1.14 %	0.44	1.05	0.96	1.21 %	-3.57 %	-
MO25 Customised	-0.37 %	3.58 %	-	0.12	-	-	-	-4.29 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.25 %	5.57 %	1.28 %	0.72	0.02	1.03	-0.10 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.34 %	5.57 %	1.28 %	0.74	0.09	1.03	-0.01 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.39 %	5.57 %	1.28 %	0.75	0.13	1.03	0.04 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	3.23 %	5.27 %	-	0.76	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.45 %	4.93 %	1.22 %	0.86	-0.06	1.06	-0.33 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.56 %	4.93 %	1.22 %	0.88	0.03	1.06	-0.22 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.61 %	4.93 %	1.22 %	0.89	0.07	1.06	-0.17 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	3.54 %	4.53 %	-	0.95	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.41 %	4.36 %	1.27 %	1.19	0.20	1.04	0.04 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.53 %	4.36 %	1.27 %	1.22	0.30	1.04	0.17 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.59 %	4.36 %	1.27 %	1.23	0.34	1.04	0.22 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	4.15 %	4.00 %	-	1.23	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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	0.70 %	3.63 %	2.13 %	0.41	2.25	0.85	4.18 %	-3.60 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	0.77 %	3.63 %	2.13 %	0.43	2.29	0.85	4.25 %	-3.59 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	0.82 %	3.63 %	2.13 %	0.44	2.31	0.85	4.30 %	-3.57 %	-
BVG 25 (2000)	-3.96 %	3.67 %	-	-0.86	-	-	-	-6.61 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.25 %	5.57 %	1.90 %	0.72	1.01	0.92	2.12 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.34 %	5.57 %	1.90 %	0.74	1.06	0.93	2.21 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.39 %	5.57 %	1.90 %	0.75	1.09	0.93	2.27 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	1.28 %	5.68 %	-	0.36	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.45 %	4.93 %	1.73 %	0.86	0.75	0.96	1.44 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.56 %	4.93 %	1.73 %	0.88	0.81	0.96	1.55 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.61 %	4.93 %	1.73 %	0.89	0.84	0.96	1.60 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	2.12 %	4.80 %	-	0.60	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.41 %	4.36 %	1.49 %	1.19	0.68	0.97	1.16 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.53 %	4.36 %	1.49 %	1.22	0.76	0.97	1.29 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.59 %	4.36 %	1.49 %	1.23	0.80	0.97	1.34 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	3.36 %	4.21 %	-	0.98	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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