

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	8.54 %	3.04 %	0.79 %	3.05	1.67	0.93	2.00 %	-1.77 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	8.63 %	3.04 %	0.79 %	3.08	1.78	0.93	2.09 %	-1.77 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	8.68 %	3.04 %	0.79 %	3.10	1.84	0.93	2.15 %	-1.76 %	-
MO25 Customised	7.12 %	3.15 %	-	2.50	-	-	-	-1.73 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.79 %	5.77 %	1.24 %	0.96	-0.25	1.07	-0.75 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.90 %	5.77 %	1.24 %	0.98	-0.17	1.07	-0.65 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.95 %	5.77 %	1.24 %	0.99	-0.13	1.07	-0.59 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	5.14 %	5.29 %	-	1.12	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.30 %	4.83 %	1.15 %	1.05	-0.06	1.07	-0.45 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.42 %	4.83 %	1.15 %	1.08	0.04	1.07	-0.33 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.47 %	4.83 %	1.15 %	1.09	0.08	1.07	-0.28 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	4.39 %	4.39 %	-	1.18	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.13 %	4.27 %	1.25 %	1.39	0.18	1.05	-0.07 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.26 %	4.27 %	1.25 %	1.42	0.28	1.05	0.07 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.32 %	4.27 %	1.25 %	1.43	0.32	1.05	0.12 %	-8.28 %	9.00
MO25 Customised	4.91 %	3.89 %	-	1.47	-	-	-	-6.74 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2011 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.80 % (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	8.54 %	3.04 %	0.95 %	3.05	3.35	1.00	3.37 %	-1.77 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	8.63 %	3.04 %	0.95 %	3.08	3.45	1.00	3.46 %	-1.77 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	8.68 %	3.04 %	0.95 %	3.10	3.50	1.00	3.51 %	-1.76 %	-
BVG 25 (2000)	5.20 %	3.14 %	-	1.90	-	-	-	-1.80 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.79 %	5.77 %	1.59 %	0.96	0.47	1.00	0.78 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.90 %	5.77 %	1.59 %	0.98	0.54	1.00	0.89 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.95 %	5.77 %	1.59 %	0.99	0.57	1.00	0.94 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	4.01 %	5.54 %	-	0.86	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	4.30 %	4.83 %	1.48 %	1.05	0.67	1.00	1.02 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.42 %	4.83 %	1.48 %	1.08	0.75	1.00	1.14 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.47 %	4.83 %	1.48 %	1.09	0.78	1.00	1.19 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	3.28 %	4.59 %	-	0.89	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.13 %	4.27 %	1.33 %	1.39	0.50	1.00	0.72 %	-8.30 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.26 %	4.27 %	1.33 %	1.42	0.60	1.00	0.85 %	-8.29 %	9.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.32 %	4.27 %	1.33 %	1.43	0.64	1.00	0.91 %	-8.28 %	9.00
BVG 25 (2000)	4.44 %	4.07 %	-	1.28	-	-	-	-7.40 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2011 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.80 % (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