

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	-9.49 %	4.62 %	1.32 %	-1.98	0.47	0.92	-0.21 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-9.43 %	4.62 %	1.32 %	-1.96	0.51	0.92	-0.16 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-9.39 %	4.62 %	1.32 %	-1.95	0.55	0.92	-0.11 %	-11.11 %	-
MO25 Customised	-10.08 %	4.97 %	-	-1.95	-	-	-	-11.81 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 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 %	6.48 %	1.27 %	-0.06	0.16	1.00	0.20 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.59 %	6.48 %	1.27 %	-0.05	0.23	1.00	0.28 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.54 %	6.48 %	1.27 %	-0.04	0.26	1.00	0.33 %	-11.11 %	-
MO25 Customised	-0.87 %	6.33 %	-	-0.09	-	-	-	-11.81 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.09 %	5.58 %	1.21 %	0.25	-0.22	1.02	-0.30 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	1.19 %	5.59 %	1.21 %	0.26	-0.13	1.02	-0.20 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	1.24 %	5.59 %	1.21 %	0.27	-0.09	1.02	-0.15 %	-11.11 %	-
MO25 Customised	1.36 %	5.37 %	-	0.31	-	-	-	-11.81 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.19 %	4.75 %	1.28 %	0.73	0.19	1.02	0.19 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.31 %	4.75 %	1.28 %	0.76	0.29	1.02	0.31 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.36 %	4.75 %	1.28 %	0.77	0.32	1.02	0.36 %	-11.11 %	-
MO25 Customised	2.94 %	4.49 %	-	0.72	-	-	-	-11.81 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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	-9.49 %	4.62 %	2.83 %	-1.98	1.79	0.78	1.47 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-9.43 %	4.62 %	2.83 %	-1.96	1.82	0.78	1.53 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-9.39 %	4.62 %	2.83 %	-1.95	1.83	0.78	1.58 %	-11.11 %	-
BVG 25 (2000)	-14.01 %	5.99 %	-	-2.27	-	-	-	-14.73 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 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 %	6.48 %	2.05 %	-0.06	1.29	0.89	2.30 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.59 %	6.48 %	2.05 %	-0.05	1.33	0.89	2.38 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.54 %	6.48 %	2.05 %	-0.04	1.36	0.89	2.43 %	-11.11 %	-
BVG 25 (2000)	-3.29 %	6.93 %	-	-0.43	-	-	-	-15.55 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.09 %	5.58 %	1.89 %	0.25	0.76	0.91	1.45 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	1.19 %	5.59 %	1.89 %	0.26	0.81	0.91	1.55 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	1.24 %	5.59 %	1.89 %	0.27	0.84	0.91	1.60 %	-11.11 %	-
BVG 25 (2000)	-0.37 %	5.82 %	-	-0.01	-	-	-	-15.55 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.19 %	4.75 %	1.60 %	0.73	0.75	0.93	1.41 %	-11.19 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.31 %	4.75 %	1.60 %	0.76	0.83	0.93	1.53 %	-11.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.36 %	4.75 %	1.60 %	0.77	0.86	0.93	1.58 %	-11.11 %	-
BVG 25 (2000)	1.95 %	4.83 %	-	0.46	-	-	-	-15.55 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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