

## MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	-11.24 %	6.36 %	1.26 %	-1.79	0.66	0.91	-0.33 %	-12.97 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 II	-11.18 %	6.36 %	1.27 %	-1.78	0.71	0.91	-0.27 %	-12.93 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 III	-11.14 %	6.36 %	1.26 %	-1.78	0.75	0.91	-0.23 %	-12.90 %	3.00
MO35 Customised	-12.04 %	6.77 %	-	-1.80	-	-	-	-13.35 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	-0.60 %	7.97 %	1.29 %	-0.10	-0.14	0.99	-0.18 %	-12.97 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 II	-0.52 %	7.98 %	1.29 %	-0.09	-0.08	0.99	-0.11 %	-12.93 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 III	-0.47 %	7.98 %	1.29 %	-0.08	-0.04	0.99	-0.06 %	-12.90 %	3.00
MO35 Customised	-0.43 %	7.99 %	-	-0.08	-	-	-	-13.35 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.15 %	6.81 %	1.24 %	0.14	-0.40	0.98	-0.47 %	-12.97 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 II	1.25 %	6.81 %	1.24 %	0.15	-0.32	0.98	-0.38 %	-12.93 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 III	1.30 %	6.81 %	1.24 %	0.16	-0.28	0.98	-0.33 %	-12.90 %	3.00
MO35 Customised	1.65 %	6.80 %	-	0.21	-	-	-	-13.35 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2018 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.54 %	5.79 %	1.15 %	0.58	-0.32	0.98	-0.32 %	-12.97 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.66 %	5.79 %	1.15 %	0.60	-0.22	0.98	-0.20 %	-12.93 %	3.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.71 %	5.79 %	1.15 %	0.60	-0.18	0.98	-0.15 %	-12.90 %	3.00
MO35 Customised	3.92 %	5.76 %	-	0.64	-	-	-	-13.35 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2013 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.20 % (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