

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	4.45 %	3.91 %	0.85 %	0.71	-1.50	1.00	-1.36 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	4.51 %	3.91 %	0.85 %	0.72	-1.44	1.00	-1.30 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.56 %	3.91 %	0.85 %	0.74	-1.38	1.00	-1.24 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	5.80 %	4.12 %	-	0.99	-	-	-	-3.00 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	0.32 %	6.41 %	1.13 %	-0.21	0.00	0.94	-0.06 %	-12.97 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 II	0.38 %	6.41 %	1.13 %	-0.20	0.06	0.94	0.01 %	-12.93 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 III	0.44 %	6.41 %	1.13 %	-0.20	0.10	0.94	0.06 %	-12.90 %	15.00
MO35 Customised	0.29 %	6.74 %	-	-0.21	-	-	-	-13.35 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.88 %	6.91 %	1.23 %	0.17	-0.37	0.98	-0.43 %	-12.97 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.96 %	6.91 %	1.23 %	0.18	-0.30	0.98	-0.35 %	-12.93 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.02 %	6.91 %	1.23 %	0.19	-0.26	0.98	-0.29 %	-12.90 %	15.00
MO35 Customised	3.34 %	6.93 %	-	0.24	-	-	-	-13.35 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2019 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.33 %	5.83 %	1.15 %	0.28	-0.43	0.98	-0.48 %	-12.97 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.44 %	5.83 %	1.15 %	0.30	-0.34	0.98	-0.37 %	-12.93 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.50 %	5.83 %	1.15 %	0.31	-0.30	0.98	-0.31 %	-12.90 %	15.00
MO35 Customised	3.84 %	5.81 %	-	0.37	-	-	-	-13.35 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2014 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.68 % (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