

## 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	-8.71 %	5.75 %	1.13 %	-1.38	0.24	0.99	0.21 %	-10.37 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	-8.66 %	5.75 %	1.13 %	-1.37	0.30	0.99	0.27 %	-10.35 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	-8.61 %	5.75 %	1.13 %	-1.36	0.34	1.00	0.32 %	-10.32 %	-
MO35 Customised	-8.97 %	5.88 %	-	-1.39	-	-	-	-10.97 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	0.83 %	7.12 %	1.31 %	0.22	-0.20	1.02	-0.31 %	-10.37 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	0.91 %	7.12 %	1.31 %	0.23	-0.13	1.02	-0.22 %	-10.35 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	0.97 %	7.12 %	1.31 %	0.23	-0.09	1.02	-0.17 %	-10.32 %	-
MO35 Customised	1.10 %	6.88 %	-	0.26	-	-	-	-10.97 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.19 %	6.24 %	1.16 %	0.46	-0.51	1.02	-0.68 %	-10.37 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	2.30 %	6.24 %	1.16 %	0.48	-0.42	1.02	-0.58 %	-10.35 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	2.35 %	6.24 %	1.16 %	0.49	-0.38	1.02	-0.53 %	-10.32 %	-
MO35 Customised	2.81 %	6.01 %	-	0.58	-	-	-	-10.97 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2017 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	4.12 %	5.47 %	1.11 %	0.88	-0.33	1.00	-0.40 %	-10.37 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	4.24 %	5.47 %	1.11 %	0.90	-0.23	1.00	-0.28 %	-10.35 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	4.29 %	5.47 %	1.11 %	0.91	-0.18	1.00	-0.23 %	-10.32 %	-
MO35 Customised	4.50 %	5.34 %	-	0.97	-	-	-	-10.97 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2012 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.71 % (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