

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	2.55 %	4.86 %	1.39 %	0.27	-0.62	0.87	-0.53 %	-5.58 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.61 %	4.86 %	1.39 %	0.28	-0.58	0.87	-0.47 %	-5.57 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.66 %	4.86 %	1.39 %	0.29	-0.54	0.87	-0.42 %	-5.56 %	9.00
MO35 Customised	3.35 %	5.37 %	-	0.39	-	-	-	-5.96 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.94 %	6.55 %	1.10 %	0.11	0.20	0.93	0.29 %	-12.97 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.01 %	6.55 %	1.10 %	0.12	0.26	0.93	0.36 %	-12.93 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.06 %	6.56 %	1.10 %	0.13	0.31	0.93	0.41 %	-12.90 %	9.00
MO35 Customised	1.68 %	6.95 %	-	0.06	-	-	-	-13.35 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.04 %	6.86 %	1.23 %	0.12	-0.47	0.98	-0.56 %	-12.97 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.13 %	6.86 %	1.23 %	0.13	-0.40	0.98	-0.47 %	-12.93 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.18 %	6.87 %	1.23 %	0.14	-0.36	0.98	-0.42 %	-12.90 %	9.00
MO35 Customised	2.63 %	6.90 %	-	0.20	-	-	-	-13.35 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.59 %	5.75 %	1.16 %	0.41	-0.41	0.98	-0.43 %	-12.97 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.70 %	5.75 %	1.16 %	0.43	-0.32	0.98	-0.32 %	-12.93 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.75 %	5.75 %	1.16 %	0.44	-0.27	0.98	-0.27 %	-12.90 %	9.00
MO35 Customised	4.08 %	5.74 %	-	0.49	-	-	-	-13.35 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (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