

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 | 1.23 % | 4.69 % | 1.18 % | 0.43 | 0.56 | 0.98 | 0.69 % | -4.14 % | 1.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 1.30 % | 4.69 % | 1.18 % | 0.44 | 0.62 | 0.98 | 0.76 % | -4.13 % | 1.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 1.36 % | 4.69 % | 1.18 % | 0.45 | 0.67 | 0.98 | 0.82 % | -4.13 % | 1.00 |
| MO35 Customised | 0.56 % | 4.72 % | - | 0.29 | - | - | - | -4.55 % | - |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 3 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I | 3.90 % | 6.65 % | 1.31 % | 0.70 | -0.29 | 1.02 | -0.48 % | -9.65 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 4.00 % | 6.65 % | 1.31 % | 0.71 | -0.22 | 1.02 | -0.39 % | -9.63 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 4.05 % | 6.65 % | 1.31 % | 0.72 | -0.18 | 1.02 | -0.34 % | -9.63 % | 9.00 |
| MO35 Customised | 4.30 % | 6.42 % | - | 0.79 | - | - | - | -8.21 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 5 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I | 3.99 % | 5.86 % | 1.18 % | 0.81 | -0.38 | 1.02 | -0.60 % | -9.65 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 4.10 % | 5.87 % | 1.18 % | 0.83 | -0.29 | 1.02 | -0.49 % | -9.63 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 4.16 % | 5.87 % | 1.18 % | 0.84 | -0.24 | 1.02 | -0.43 % | -9.63 % | 9.00 |
| MO35 Customised | 4.46 % | 5.61 % | - | 0.93 | - | - | - | -8.21 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 10 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I | 4.90 % | 5.23 % | 1.11 % | 1.08 | -0.34 | 1.00 | -0.43 % | -9.65 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 5.03 % | 5.23 % | 1.11 % | 1.11 | -0.24 | 1.01 | -0.31 % | -9.63 % | 9.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 5.08 % | 5.23 % | 1.11 % | 1.12 | -0.19 | 1.01 | -0.26 % | -9.63 % | 9.00 |
| MO35 Customised | 5.30 % | 5.09 % | - | 1.19 | - | - | - | -8.21 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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 |