

## 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	-5.00 %	5.96 %	1.32 %	-0.96	0.04	0.90	-0.44 %	-9.35 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 II	-4.94 %	5.96 %	1.32 %	-0.95	0.08	0.90	-0.39 %	-9.33 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 III	-4.89 %	5.96 %	1.32 %	-0.94	0.12	0.90	-0.34 %	-9.30 %	6.00
MO35 Customised	-5.12 %	6.45 %	-	-0.91	-	-	-	-9.22 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.55 %	6.83 %	1.11 %	0.41	0.30	0.92	0.56 %	-12.97 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.63 %	6.83 %	1.11 %	0.42	0.37	0.92	0.64 %	-12.93 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.68 %	6.83 %	1.11 %	0.42	0.41	0.92	0.69 %	-12.90 %	6.00
MO35 Customised	3.17 %	7.31 %	-	0.33	-	-	-	-13.35 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2023 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 %	6.91 %	1.24 %	0.18	-0.45	0.98	-0.53 %	-12.97 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.14 %	6.91 %	1.24 %	0.20	-0.38	0.98	-0.44 %	-12.93 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.19 %	6.91 %	1.24 %	0.20	-0.34	0.98	-0.38 %	-12.90 %	6.00
MO35 Customised	2.60 %	6.93 %	-	0.26	-	-	-	-13.35 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2018 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.38 %	5.83 %	1.15 %	0.44	-0.35	0.98	-0.35 %	-12.97 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.49 %	5.83 %	1.15 %	0.46	-0.25	0.98	-0.24 %	-12.93 %	6.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.54 %	5.83 %	1.15 %	0.47	-0.21	0.98	-0.19 %	-12.90 %	6.00
MO35 Customised	3.79 %	5.83 %	-	0.51	-	-	-	-13.35 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2013 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.77 % (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