

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	10.61 %	4.02 %	0.70 %	2.82	1.68	0.95	1.78 %	-2.11 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	10.71 %	4.02 %	0.70 %	2.84	1.81	0.95	1.87 %	-2.10 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	10.76 %	4.02 %	0.70 %	2.85	1.88	0.95	1.93 %	-2.10 %	-
MO35 Customised	9.32 %	4.15 %	-	2.42	-	-	-	-2.09 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.37 %	6.88 %	1.20 %	0.89	-0.58	1.03	-0.96 %	-9.65 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.48 %	6.88 %	1.20 %	0.91	-0.49	1.03	-0.85 %	-9.63 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.54 %	6.88 %	1.20 %	0.92	-0.45	1.03	-0.80 %	-9.63 %	9.00
MO35 Customised	6.12 %	6.58 %	-	1.05	-	-	-	-8.21 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.02 %	5.72 %	1.12 %	1.02	-0.32	1.02	-0.54 %	-9.65 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.14 %	5.72 %	1.12 %	1.04	-0.22	1.03	-0.42 %	-9.63 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.19 %	5.72 %	1.12 %	1.05	-0.18	1.03	-0.37 %	-9.63 %	9.00
MO35 Customised	5.41 %	5.47 %	-	1.13	-	-	-	-8.21 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.74 %	5.13 %	1.08 %	1.27	-0.42	1.01	-0.54 %	-9.65 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.87 %	5.13 %	1.08 %	1.30	-0.31	1.01	-0.41 %	-9.63 %	9.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.92 %	5.13 %	1.08 %	1.31	-0.27	1.01	-0.36 %	-9.63 %	9.00
MO35 Customised	6.23 %	4.97 %	-	1.41	-	-	-	-8.21 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2011 bis 30.09.2021 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.80 % (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