

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	-10.91 %	5.90 %	1.36 %	-1.79	0.13	0.94	-0.47 %	-12.97 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	-10.86 %	5.89 %	1.36 %	-1.78	0.17	0.94	-0.41 %	-12.93 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	-10.81 %	5.89 %	1.36 %	-1.77	0.21	0.94	-0.37 %	-12.90 %	-
MO35 Customised	-11.10 %	6.23 %	-	-1.72	-	-	-	-13.35 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	-0.70 %	7.71 %	1.28 %	-0.05	-0.13	1.00	-0.17 %	-12.97 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	-0.62 %	7.71 %	1.28 %	-0.04	-0.07	1.00	-0.09 %	-12.93 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	-0.57 %	7.71 %	1.28 %	-0.03	-0.03	1.00	-0.04 %	-12.90 %	-
MO35 Customised	-0.53 %	7.61 %	-	-0.03	-	-	-	-13.35 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.18 %	6.64 %	1.18 %	0.22	-0.51	1.00	-0.61 %	-12.97 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	1.29 %	6.64 %	1.18 %	0.24	-0.42	1.00	-0.51 %	-12.93 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	1.34 %	6.64 %	1.18 %	0.24	-0.38	1.00	-0.46 %	-12.90 %	-
MO35 Customised	1.79 %	6.54 %	-	0.32	-	-	-	-13.35 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.49 %	5.68 %	1.13 %	0.66	-0.35	0.99	-0.38 %	-12.97 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	3.61 %	5.68 %	1.13 %	0.69	-0.25	0.99	-0.26 %	-12.93 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	3.66 %	5.68 %	1.13 %	0.69	-0.20	0.99	-0.21 %	-12.90 %	-
MO35 Customised	3.90 %	5.60 %	-	0.75	-	-	-	-13.35 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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