

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	4.01 %	4.56 %	1.19 %	0.55	-0.81	0.86	-0.45 %	-2.15 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 II	4.07 %	4.56 %	1.19 %	0.56	-0.76	0.86	-0.39 %	-2.14 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.13 %	4.56 %	1.19 %	0.57	-0.72	0.86	-0.34 %	-2.14 %	1.00
MO35 Customised	4.97 %	4.94 %	-	0.70	-	-	-	-2.95 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	0.83 %	6.58 %	1.12 %	-0.10	0.11	0.93	0.10 %	-12.97 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 II	0.90 %	6.58 %	1.12 %	-0.09	0.17	0.93	0.17 %	-12.93 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 III	0.95 %	6.58 %	1.12 %	-0.08	0.22	0.93	0.22 %	-12.90 %	12.00
MO35 Customised	0.67 %	6.96 %	-	-0.12	-	-	-	-13.35 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.63 %	6.85 %	1.22 %	0.02	-0.47	0.98	-0.56 %	-12.97 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 II	1.72 %	6.85 %	1.21 %	0.03	-0.40	0.98	-0.47 %	-12.93 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 III	1.77 %	6.86 %	1.22 %	0.04	-0.36	0.98	-0.42 %	-12.90 %	12.00
MO35 Customised	2.20 %	6.90 %	-	0.10	-	-	-	-13.35 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.23 %	5.74 %	1.16 %	0.30	-0.45	0.98	-0.49 %	-12.97 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.34 %	5.74 %	1.16 %	0.32	-0.36	0.98	-0.38 %	-12.93 %	12.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.39 %	5.74 %	1.16 %	0.33	-0.31	0.98	-0.33 %	-12.90 %	12.00
MO35 Customised	3.76 %	5.73 %	-	0.39	-	-	-	-13.35 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2013 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.49 % (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