

MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	-10.88 %	5.64 %	2.70 %	-1.96	1.68	0.75	0.32 %	-12.36 %	3.00
MIXTA OPTIMA 30 II	-10.85 %	5.64 %	2.70 %	-1.95	1.69	0.75	0.36 %	-12.34 %	3.00
MO30 Customised	-14.96 %	7.88 %	-	-1.92	-	-	-	-16.11 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	-0.82 %	7.75 %	2.01 %	-0.13	0.28	0.85	0.43 %	-12.51 %	3.00
MIXTA OPTIMA 30 II	-0.81 %	7.75 %	2.01 %	-0.13	0.29	0.85	0.44 %	-12.49 %	3.00
MO30 Customised	-1.50 %	8.90 %	-	-0.19	-	-	-	-16.11 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	0.77 %	6.67 %	1.81 %	0.08	-0.20	0.86	-0.17 %	-12.51 %	3.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.78 %	6.67 %	1.81 %	0.09	-0.20	0.86	-0.16 %	-12.49 %	3.00
MO30 Customised	1.06 %	7.54 %	-	0.11	-	-	-	-16.11 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2018 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.09 %	5.60 %	1.48 %	0.51	-0.23	0.89	0.05 %	-12.51 %	3.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.10 %	5.60 %	1.49 %	0.52	-0.23	0.89	0.05 %	-12.49 %	3.00
MO30 Customised	3.40 %	6.11 %	-	0.52	-	-	-	-16.11 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2013 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.20 % (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