

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	4.76 %	3.44 %	1.43 %	0.89	-0.90	0.79	-0.38 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	4.82 %	3.44 %	1.43 %	0.91	-0.86	0.79	-0.32 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	6.05 %	4.77 %	-	0.91	-	-	-	-3.62 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	0.15 %	5.90 %	2.03 %	-0.26	0.39	0.77	0.35 %	-12.51 %	15.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.18 %	5.90 %	2.03 %	-0.26	0.40	0.77	0.38 %	-12.49 %	15.00
MO30 Customised	-0.76 %	7.51 %	-	-0.32	-	-	-	-16.11 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.83 %	6.71 %	1.86 %	0.17	-0.13	0.84	0.04 %	-12.51 %	15.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.85 %	6.71 %	1.86 %	0.17	-0.12	0.84	0.06 %	-12.49 %	15.00
MO30 Customised	2.99 %	7.77 %	-	0.17	-	-	-	-16.11 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2019 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.04 %	5.61 %	1.52 %	0.24	-0.37	0.87	-0.29 %	-12.51 %	15.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.05 %	5.61 %	1.52 %	0.24	-0.36	0.87	-0.28 %	-12.49 %	15.00
MO30 Customised	3.57 %	6.24 %	-	0.30	-	-	-	-16.11 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2014 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.68 % (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