

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	-9.26 %	5.19 %	1.85 %	-1.64	1.50	0.80	0.31 %	-10.29 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	-9.26 %	5.19 %	1.86 %	-1.64	1.50	0.80	0.31 %	-10.29 %	-
MO30 Customised	-11.81 %	6.59 %	-	-1.67	-	-	-	-13.38 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	0.67 %	7.15 %	1.73 %	0.19	0.17	0.89	0.46 %	-10.29 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	0.68 %	7.15 %	1.73 %	0.19	0.17	0.89	0.47 %	-10.29 %	-
MO30 Customised	0.32 %	7.83 %	-	0.13	-	-	-	-13.38 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.64 %	6.25 %	1.50 %	0.37	-0.38	0.90	-0.26 %	-10.29 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	1.64 %	6.25 %	1.50 %	0.38	-0.38	0.90	-0.26 %	-10.29 %	-
MO30 Customised	2.19 %	6.77 %	-	0.43	-	-	-	-13.38 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2017 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.59 %	5.37 %	1.30 %	0.80	-0.30	0.92	-0.01 %	-10.29 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	3.59 %	5.37 %	1.30 %	0.80	-0.30	0.92	-0.01 %	-10.29 %	-
MO30 Customised	3.97 %	5.67 %	-	0.82	-	-	-	-13.38 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2012 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.71 % (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