

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	2.50 %	4.18 %	2.45 %	0.30	0.14	0.74	0.73 %	-4.86 %	9.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.56 %	4.18 %	2.45 %	0.31	0.16	0.74	0.79 %	-4.85 %	9.00
MO30 Customised	1.96 %	6.40 %	-	0.11	-	-	-	-6.81 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.73 %	6.11 %	1.93 %	0.08	0.49	0.79	0.95 %	-12.51 %	9.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.75 %	6.11 %	1.93 %	0.08	0.50	0.79	0.98 %	-12.49 %	9.00
MO30 Customised	0.65 %	7.60 %	-	-0.08	-	-	-	-16.11 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.79 %	6.68 %	1.79 %	0.08	-0.15	0.86	-0.09 %	-12.51 %	9.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.80 %	6.68 %	1.79 %	0.08	-0.14	0.86	-0.08 %	-12.49 %	9.00
MO30 Customised	1.98 %	7.59 %	-	0.10	-	-	-	-16.11 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.21 %	5.53 %	1.48 %	0.36	-0.29	0.88	-0.12 %	-12.51 %	9.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.22 %	5.53 %	1.48 %	0.36	-0.29	0.88	-0.12 %	-12.49 %	9.00
MO30 Customised	3.62 %	6.09 %	-	0.39	-	-	-	-16.11 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (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