



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	-5.13 %	5.22 %	2.70 %	-1.12	1.08	0.76	0.76 %	-8.83 %	6.00
MIXTA OPTIMA 30 II	-5.08 %	5.22 %	2.69 %	-1.11	1.10	0.76	0.81 %	-8.81 %	6.00
MO30 Customised	-8.03 %	7.78 %	-	-1.12	-	-	-	-11.46 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.17 %	6.44 %	1.95 %	0.37	0.47	0.80	1.34 %	-12.51 %	6.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.19 %	6.44 %	1.95 %	0.37	0.48	0.80	1.35 %	-12.49 %	6.00
MO30 Customised	2.11 %	7.95 %	-	0.17	-	-	-	-16.11 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.69 %	6.73 %	1.81 %	0.13	-0.21	0.86	-0.13 %	-12.51 %	6.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.70 %	6.73 %	1.81 %	0.14	-0.20	0.86	-0.12 %	-12.49 %	6.00
MO30 Customised	1.99 %	7.62 %	-	0.16	-	-	-	-16.11 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2018 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.96 %	5.63 %	1.48 %	0.39	-0.27	0.89	-0.08 %	-12.51 %	6.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.96 %	5.63 %	1.48 %	0.39	-0.27	0.89	-0.07 %	-12.49 %	6.00
MO30 Customised	3.32 %	6.18 %	-	0.41	-	-	-	-16.11 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2013 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.77 % (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