

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	-10.84 %	5.32 %	2.66 %	-1.97	1.36	0.74	-0.25 %	-12.36 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	-10.82 %	5.32 %	2.66 %	-1.96	1.37	0.74	-0.24 %	-12.34 %	-
MO30 Customised	-14.16 %	7.16 %	-	-1.92	-	-	-	-16.11 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	-0.64 %	7.60 %	1.94 %	-0.04	0.38	0.86	0.67 %	-12.51 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	-0.63 %	7.60 %	1.94 %	-0.04	0.38	0.86	0.67 %	-12.49 %	-
MO30 Customised	-1.47 %	8.65 %	-	-0.13	-	-	-	-16.11 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	0.83 %	6.57 %	1.75 %	0.17	-0.27	0.87	-0.20 %	-12.51 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	0.84 %	6.57 %	1.75 %	0.17	-0.26	0.87	-0.19 %	-12.49 %	-
MO30 Customised	1.23 %	7.37 %	-	0.21	-	-	-	-16.11 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	3.05 %	5.53 %	1.45 %	0.60	-0.23	0.89	0.09 %	-12.51 %	-
MIXTA OPTIMA 30 II	3.05 %	5.53 %	1.45 %	0.60	-0.22	0.89	0.09 %	-12.49 %	-
MO30 Customised	3.35 %	6.00 %	-	0.61	-	-	-	-16.11 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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