

## 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	4.08 %	3.92 %	1.43 %	0.66	-0.10	0.79	0.48 %	-1.68 %	1.00
MIXTA OPTIMA 30 II	4.14 %	3.92 %	1.43 %	0.67	-0.06	0.79	0.54 %	-1.68 %	1.00
MO30 Customised	4.18 %	5.76 %	-	0.46	-	-	-	-2.60 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	0.82 %	6.12 %	1.94 %	-0.11	0.57	0.79	0.82 %	-12.51 %	12.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.85 %	6.12 %	1.94 %	-0.11	0.58	0.79	0.85 %	-12.49 %	12.00
MO30 Customised	-0.39 %	7.60 %	-	-0.25	-	-	-	-16.11 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	1.59 %	6.65 %	1.80 %	0.01	-0.12	0.86	-0.10 %	-12.51 %	12.00
MIXTA OPTIMA 30 II	1.61 %	6.65 %	1.80 %	0.02	-0.11	0.86	-0.08 %	-12.49 %	12.00
MO30 Customised	1.72 %	7.58 %	-	0.03	-	-	-	-16.11 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.91 %	5.52 %	1.49 %	0.25	-0.32	0.88	-0.22 %	-12.51 %	12.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.91 %	5.52 %	1.49 %	0.26	-0.31	0.88	-0.21 %	-12.49 %	12.00
MO30 Customised	3.35 %	6.09 %	-	0.30	-	-	-	-16.11 %	12.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2013 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.49 % (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