

## MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(nach BVV2 – Aktien- und Gesellschaftsbeteiligungs-Quote überschritten)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	-6.02 %	10.28 %	1.76 %	-0.66	-0.16	0.95	-0.53 %	-13.37 %	6.00
MIXTA OPTIMA 75 III	-5.99 %	10.33 %	1.35 %	-0.65	-0.18	0.96	-0.45 %	-13.37 %	6.00
MO75 Customised	-5.83 %	10.77 %	-	-0.61	-	-	-	-12.61 %	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 75 II	7.09 %	10.57 %	1.67 %	0.59	-0.66	0.93	-0.54 %	-17.83 %	6.00
MIXTA OPTIMA 75 III	7.11 %	10.59 %	1.54 %	0.59	-0.70	0.93	-0.55 %	-17.82 %	6.00
MO75 Customised	8.18 %	11.32 %	-	0.65	-	-	-	-16.52 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	2.86 %	11.22 %	1.67 %	0.19	-0.36	0.93	-0.32 %	-17.83 %	6.00
MIXTA OPTIMA 75 III	2.88 %	11.23 %	1.56 %	0.19	-0.37	0.93	-0.32 %	-17.82 %	6.00
MO75 Customised	3.38 %	12.01 %	-	0.22	-	-	-	-16.52 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 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