

MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	4.32 %	2.64 %	0.84 %	1.00	-1.18	0.98	-0.98 %	-1.78 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	4.38 %	2.64 %	0.84 %	1.02	-1.12	0.98	-0.93 %	-1.77 %	1.00
MO15 Customised	5.36 %	3.03 %	-	1.21	-	-	-	-1.32 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	-0.90 %	4.40 %	1.08 %	-0.59	0.06	0.88	-0.22 %	-10.95 %	15.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.88 %	4.40 %	1.08 %	-0.58	0.08	0.88	-0.20 %	-10.95 %	15.00
MO15 Customised	-0.99 %	4.87 %	-	-0.55	-	-	-	-11.43 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	1.46 %	4.62 %	1.12 %	-0.05	-0.09	0.93	-0.09 %	-10.95 %	15.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.47 %	4.62 %	1.12 %	-0.05	-0.08	0.93	-0.08 %	-10.95 %	15.00
MO15 Customised	1.54 %	4.82 %	-	-0.03	-	-	-	-11.43 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2019 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	2.19 %	3.68 %	1.15 %	0.14	-0.40	0.91	-0.37 %	-10.95 %	15.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.20 %	3.69 %	1.15 %	0.14	-0.39	0.91	-0.36 %	-10.95 %	15.00
MO15 Customised	2.65 %	3.86 %	-	0.25	-	-	-	-11.43 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2014 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.68 % (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