

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	1.20 %	3.43 %	1.34 %	-0.01	-0.70	0.85	-0.77 %	-4.55 %	9.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.24 %	3.43 %	1.34 %	0.00	-0.67	0.85	-0.73 %	-4.55 %	9.00
MO15 Customised	2.10 %	4.14 %	-	0.21	-	-	-	-4.73 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	-0.13 %	4.35 %	1.07 %	-0.31	0.27	0.88	0.11 %	-10.95 %	9.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.11 %	4.35 %	1.06 %	-0.31	0.29	0.88	0.13 %	-10.95 %	9.00
MO15 Customised	-0.45 %	4.86 %	-	-0.34	-	-	-	-11.43 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	0.84 %	4.50 %	1.18 %	-0.09	-0.21	0.92	-0.25 %	-10.95 %	9.00
MIXTA OPTIMA 15 III	0.84 %	4.50 %	1.18 %	-0.09	-0.20	0.92	-0.24 %	-10.95 %	9.00
MO15 Customised	1.07 %	4.72 %	-	-0.04	-	-	-	-11.43 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2018 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	2.22 %	3.61 %	1.17 %	0.27	-0.36	0.90	-0.28 %	-10.95 %	9.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.22 %	3.61 %	1.17 %	0.27	-0.35	0.90	-0.27 %	-10.95 %	9.00
MO15 Customised	2.63 %	3.82 %	-	0.36	-	-	-	-11.43 %	9.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2013 bis 30.06.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.23 % (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