

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	4.29 %	2.45 %	0.81 %	0.97	-1.01	1.08	-1.11 %	-1.78 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	4.34 %	2.45 %	0.81 %	0.99	-0.95	1.08	-1.06 %	-1.77 %	1.00
MO15 Customised	5.15 %	2.74 %	-	1.18	-	-	-	-1.32 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 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 %	4.47 %	1.05 %	-0.62	-0.27	0.89	-0.53 %	-10.95 %	21.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.87 %	4.47 %	1.05 %	-0.62	-0.24	0.89	-0.50 %	-10.95 %	21.00
MO15 Customised	-0.64 %	4.91 %	-	-0.52	-	-	-	-11.43 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	0.88 %	4.55 %	1.13 %	-0.22	-0.19	0.92	-0.26 %	-10.95 %	21.00
MIXTA OPTIMA 15 III	0.90 %	4.55 %	1.13 %	-0.22	-0.17	0.92	-0.24 %	-10.95 %	21.00
MO15 Customised	1.08 %	4.79 %	-	-0.17	-	-	-	-11.43 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	2.03 %	3.70 %	1.14 %	0.04	-0.41	0.91	-0.42 %	-10.95 %	21.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.04 %	3.70 %	1.14 %	0.04	-0.41	0.91	-0.41 %	-10.95 %	21.00
MO15 Customised	2.51 %	3.87 %	-	0.16	-	-	-	-11.43 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (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