



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 | -1.49 % | 2.44 % | 1.02 % | -0.28 | 1.08 | 0.86 | 0.85 % | -4.11 % | - |
| MO15 Customised | -2.58 % | 2.53 % | - | -0.70 | - | - | - | -4.93 % | - |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 3 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|--------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 1.89 % | 4.25 % | 1.16 % | 0.63 | 0.12 | 0.95 | 0.27 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 1.74 % | 4.30 % | - | 0.59 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 5 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|--------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.19 % | 3.61 % | 1.17 % | 0.82 | -0.08 | 0.95 | 0.05 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 2.28 % | 3.58 % | - | 0.85 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

| 10 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|--------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.99 % | 3.17 % | 1.13 % | 1.19 | -0.25 | 0.91 | 0.08 % | -5.94 % | 8.00 |
| MO15 Customised | 3.28 % | 3.28 % | - | 1.23 | - | - | - | -5.05 % | 8.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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 |