

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 | 2.80 % | 3.16 % | 1.15 % | 0.41 | -0.63 | 0.80 | -0.30 % | -1.62 % | 1.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 2.85 % | 3.16 % | 1.15 % | 0.43 | -0.58 | 0.80 | -0.25 % | -1.61 % | 1.00 |
| MO15 Customised | 3.51 % | 3.74 % | - | 0.53 | - | - | - | -2.41 % | 1.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2023 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 % | 4.33 % | 1.07 % | -0.55 | 0.19 | 0.88 | -0.10 % | -10.95 % | 12.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | -0.88 % | 4.33 % | 1.06 % | -0.55 | 0.20 | 0.88 | -0.08 % | -10.95 % | 12.00 |
| MO15 Customised | -1.12 % | 4.84 % | - | -0.54 | - | - | - | -11.43 % | 12.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

| 5 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 0.68 % | 4.50 % | 1.12 % | -0.18 | -0.24 | 0.92 | -0.30 % | -10.95 % | 12.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 0.69 % | 4.50 % | 1.12 % | -0.18 | -0.23 | 0.92 | -0.29 % | -10.95 % | 12.00 |
| MO15 Customised | 0.94 % | 4.73 % | - | -0.12 | - | - | - | -11.43 % | 12.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.10.2018 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

| 10 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.00 % | 3.61 % | 1.16 % | 0.14 | -0.39 | 0.90 | -0.36 % | -10.95 % | 12.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 2.01 % | 3.61 % | 1.16 % | 0.14 | -0.39 | 0.90 | -0.35 % | -10.95 % | 12.00 |
| MO15 Customised | 2.45 % | 3.82 % | - | 0.25 | - | - | - | -11.43 % | 12.00 |

Beobachtungszeitraum: 01.10.2013 bis 30.09.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.49 % (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 |