



# MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

## Indicateurs de risque

| 1 année            | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 30 I  | 8.44 % | 3.01 %     | 0.90 %         | 2.80         | -0.69             | 1.12             | -1.75 %         | -2.76 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 8.51 % | 3.01 %     | 0.90 %         | 2.83         | -0.62             | 1.12             | -1.68 %         | -2.75 %            | 2.00                  |
| MO30 Customised    | 9.06 % | 3.58 %     | -              | 2.53         | -                 | -                | -               | -2.17 %            | 2.00                  |

Période d'observation: 01.07.2025 au 30.06.2026 Période de base: mensuel

| 3 années           | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 30 I  | 5.98 % | 4.06 %     | 1.03 %         | 1.48         | -0.70             | 0.90             | -0.08 %         | -3.07 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 6.05 % | 4.06 %     | 1.03 %         | 1.50         | -0.64             | 0.90             | -0.01 %         | -3.05 %            | 2.00                  |
| MO30 Customised    | 6.70 % | 4.37 %     | -              | 1.54         | -                 | -                | -               | -3.62 %            | 2.00                  |

Période d'observation: 01.07.2023 au 30.06.2026 Période de base: mensuel

| 5 années           | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 30 I  | 2.06 % | 5.11 %     | 1.59 %         | 0.41         | 0.17              | 0.81             | 0.63 %          | -12.51 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 2.11 % | 5.11 %     | 1.59 %         | 0.42         | 0.20              | 0.81             | 0.68 %          | -12.49 %           | 26.00                 |
| MO30 Customised    | 1.78 % | 6.17 %     | -              | 0.30         | -                 | -                | -               | -16.11 %           | 36.00                 |

Période d'observation: 01.07.2021 au 30.06.2026 Période de base: mensuel

| 10 années          | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|--------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 30 I  | 3.52 % | 5.44 %     | 1.46 %         | 0.66         | -0.16             | 0.87             | 0.26 %          | -12.51 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 3.55 % | 5.44 %     | 1.46 %         | 0.66         | -0.14             | 0.87             | 0.28 %          | -12.49 %           | 26.00                 |
| MO30 Customised    | 3.75 % | 6.07 %     | -              | 0.63         | -                 | -                | -               | -16.11 %           | 36.00                 |

Période d'observation: 01.07.2016 au 30.06.2026 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.06 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



| Chiffre-clé                       | Calcul                                                                                                                                                                                                                          | Description                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Volatilité                        | $\sqrt{\text{Variance}}$                                                                                                                                                                                                        | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne                                                                                                                                                              |
| Ratio de Sharpe                   | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$                                                                                   | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru                                                                                                                                                                     |
| Tracking error                    | Déviati on standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark)                                                                                                                                          | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif)<br>Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information               | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$                                                                                                             | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru                                                                                                                                                                             |
| Coefficient bêta                  | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$                                                                                                  | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché                                                                                                                                                                         |
| Alpha de Jensen                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque                                                                                                                                                                      |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$                                                | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période                                                                                                              |
| Délai de récupération             | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale                            | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée                                                                                                                                                                |
| Duration modifiée                 | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$                                                                                             | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt                                                                                                                                                                             |