



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 | 8.65 % | 3.61 % | 1.21 % | 2.00 | -1.74 | 0.82 | -0.62 % | -1.91 % | 1.00 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 8.72 % | 3.61 % | 1.21 % | 2.02 | -1.69 | 0.82 | -0.56 % | -1.90 % | 1.00 |
| MO30 Customised | 10.92 % | 4.20 % | - | 2.30 | - | - | - | -2.44 % | 1.00 |

Période d'observation: 01.10.2023 au 30.09.2024 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 | 0.27 % | 5.66 % | 1.95 % | -0.24 | 0.22 | 0.77 | 0.10 % | -12.36 % | 24.00 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 0.32 % | 5.66 % | 1.95 % | -0.24 | 0.24 | 0.77 | 0.15 % | -12.34 % | 24.00 |
| MO30 Customised | -0.27 % | 7.22 % | - | -0.27 | - | - | - | -16.11 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.10.2021 au 30.09.2024 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 | 2.10 % | 6.51 % | 1.73 % | 0.07 | -0.01 | 0.85 | 0.13 % | -12.51 % | 24.00 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 2.12 % | 6.51 % | 1.73 % | 0.07 | 0.01 | 0.85 | 0.16 % | -12.49 % | 24.00 |
| MO30 Customised | 2.02 % | 7.52 % | - | 0.05 | - | - | - | -16.11 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.10.2019 au 30.09.2024 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 | 2.98 % | 5.65 % | 1.51 % | 0.23 | -0.38 | 0.88 | -0.31 % | -12.51 % | 24.00 |
| MIXTA OPTIMA 30 II | 2.99 % | 5.65 % | 1.51 % | 0.23 | -0.37 | 0.88 | -0.29 % | -12.49 % | 24.00 |
| MO30 Customised | 3.51 % | 6.27 % | - | 0.29 | - | - | - | -16.11 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.10.2014 au 30.09.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.65 % (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 | Déviation 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) 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 | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$ | 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 |