

MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	6.86 %	4.10 %	0.69 %	1.28	-1.90	1.03	-1.59 %	-1.32 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 II	6.92 %	4.10 %	0.69 %	1.30	-1.81	1.03	-1.52 %	-1.31 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 III	6.98 %	4.10 %	0.69 %	1.31	-1.73	1.03	-1.47 %	-1.31 %	1.00
MO35 Customised	8.27 %	4.31 %	-	1.54	-	-	-	-1.01 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2024 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	-0.31 %	6.22 %	0.98 %	-0.30	-0.60	0.93	-0.65 %	-12.97 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 II	-0.25 %	6.22 %	0.98 %	-0.29	-0.54	0.93	-0.59 %	-12.93 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 III	-0.20 %	6.22 %	0.98 %	-0.28	-0.49	0.93	-0.54 %	-12.90 %	27.00
MO35 Customised	0.25 %	6.60 %	-	-0.20	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.85 %	6.80 %	1.11 %	0.04	-0.56	0.99	-0.62 %	-12.97 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 II	1.93 %	6.80 %	1.11 %	0.05	-0.50	0.99	-0.55 %	-12.93 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 III	1.98 %	6.80 %	1.11 %	0.06	-0.46	0.99	-0.50 %	-12.90 %	27.00
MO35 Customised	2.49 %	6.80 %	-	0.14	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.15 %	5.89 %	1.09 %	0.27	-0.30	0.99	-0.32 %	-12.97 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.25 %	5.89 %	1.09 %	0.29	-0.21	0.99	-0.22 %	-12.93 %	27.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.30 %	5.89 %	1.09 %	0.30	-0.17	0.99	-0.16 %	-12.90 %	27.00
MO35 Customised	3.49 %	5.85 %	-	0.33	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (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