

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	5.55 %	4.35 %	0.57 %	1.27	-0.08	0.95	0.26 %	-2.65 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.61 %	4.35 %	0.57 %	1.29	0.02	0.95	0.32 %	-2.64 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.66 %	4.35 %	0.57 %	1.30	0.11	0.95	0.37 %	-2.63 %	4.00
MO35 Customised	5.59 %	4.83 %	-	1.16	-	-	-	-2.75 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.61 %	4.14 %	0.71 %	1.36	-1.23	0.99	-0.88 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.68 %	4.14 %	0.71 %	1.37	-1.15	0.99	-0.81 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.73 %	4.14 %	0.71 %	1.38	-1.08	0.99	-0.76 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	6.55 %	4.12 %	-	1.59	-	-	-	-3.00 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.63 %	5.48 %	0.96 %	0.49	-0.28	0.94	-0.10 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.70 %	5.48 %	0.96 %	0.50	-0.22	0.94	-0.03 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.75 %	5.48 %	0.96 %	0.51	-0.17	0.94	0.02 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	2.89 %	5.73 %	-	0.51	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.55 %	5.53 %	1.07 %	0.65	-0.27	0.99	-0.25 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.64 %	5.53 %	1.07 %	0.66	-0.19	0.99	-0.15 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.69 %	5.53 %	1.07 %	0.67	-0.14	0.99	-0.10 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.84 %	5.50 %	-	0.70	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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