



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	3.93 %	5.13 %	0.42 %	0.60	0.94	0.99	0.42 %	-2.65 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.99 %	5.13 %	0.42 %	0.62	1.09	0.99	0.49 %	-2.64 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.05 %	5.13 %	0.42 %	0.63	1.21	0.99	0.54 %	-2.63 %	2.00
MO35 Customised	3.53 %	5.54 %	-	0.50	-	-	-	-2.75 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.87 %	5.59 %	0.95 %	0.57	-0.72	0.93	-0.41 %	-5.58 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.93 %	5.59 %	0.95 %	0.58	-0.66	0.93	-0.35 %	-5.57 %	15.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.98 %	5.59 %	0.95 %	0.59	-0.60	0.93	-0.30 %	-5.56 %	15.00
MO35 Customised	4.56 %	5.94 %	-	0.65	-	-	-	-5.96 %	10.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.97 %	5.81 %	0.95 %	0.40	-0.11	0.95	0.03 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.04 %	5.81 %	0.96 %	0.41	-0.04	0.95	0.10 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.09 %	5.81 %	0.96 %	0.42	0.01	0.95	0.15 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.06 %	6.04 %	-	0.40	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.36 %	5.77 %	1.08 %	0.47	-0.29	0.99	-0.27 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.46 %	5.77 %	1.08 %	0.48	-0.20	0.99	-0.18 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.51 %	5.77 %	1.08 %	0.49	-0.15	0.99	-0.12 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.67 %	5.74 %	-	0.52	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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