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	9.20 %	3.78 %	0.71 %	2.43	-0.96	1.09	-1.71 %	-2.93 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	9.27 %	3.78 %	0.71 %	2.45	-0.88	1.09	-1.65 %	-2.92 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	9.32 %	3.78 %	0.71 %	2.47	-0.81	1.09	-1.59 %	-2.92 %	2.00
MO35 Customised	*9.97 %*	*4.02 %*	-	*2.48*	-	-	-	*-2.44 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	6.07 %	4.54 %	0.68 %	1.35	-0.93	1.05	-0.98 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	6.13 %	4.54 %	0.68 %	1.36	-0.84	1.05	-0.92 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	6.18 %	4.54 %	0.68 %	1.37	-0.76	1.05	-0.87 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	*6.74 %*	*4.30 %*	-	*1.58*	-	-	-	*-3.00 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.24 %	5.67 %	0.94 %	0.40	-0.53	0.96	-0.38 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.30 %	5.67 %	0.94 %	0.42	-0.46	0.96	-0.31 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.35 %	5.67 %	0.94 %	0.42	-0.41	0.96	-0.26 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	*2.73 %*	*5.83 %*	-	*0.48*	-	-	-	*-13.35 %*	*24.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.88 %	5.64 %	1.04 %	0.70	-0.36	0.99	-0.35 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.97 %	5.64 %	1.04 %	0.71	-0.27	0.99	-0.25 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.02 %	5.64 %	1.04 %	0.72	-0.22	0.99	-0.20 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	*4.26 %*	*5.59 %*	-	*0.77*	-	-	-	*-13.35 %*	*24.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus