

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	4.36 %	4.25 %	0.74 %	0.72	-0.66	0.99	-0.47 %	-1.41 %	-
MIXTA OPTIMA 35 II	4.43 %	4.25 %	0.74 %	0.73	-0.57	0.99	-0.41 %	-1.40 %	-
MIXTA OPTIMA 35 III	4.48 %	4.25 %	0.74 %	0.75	-0.51	0.99	-0.36 %	-1.40 %	-
MO35 Customised	4.87 %	4.51 %	-	0.80	-	-	-	-1.69 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	1.50 %	6.16 %	0.97 %	0.03	-0.69	0.94	-0.60 %	-9.35 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 II	1.56 %	6.16 %	0.97 %	0.04	-0.63	0.94	-0.54 %	-9.33 %	18.00
MIXTA OPTIMA 35 III	1.61 %	6.16 %	0.97 %	0.05	-0.58	0.94	-0.49 %	-9.30 %	18.00
MO35 Customised	2.16 %	6.50 %	-	0.13	-	-	-	-9.22 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	4.10 %	5.91 %	0.99 %	0.47	-0.22	0.94	-0.02 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	4.17 %	5.92 %	0.99 %	0.48	-0.15	0.94	0.05 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	4.22 %	5.92 %	0.99 %	0.49	-0.10	0.94	0.10 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	4.30 %	6.21 %	-	0.48	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.14 %	5.79 %	1.09 %	0.32	-0.27	0.99	-0.27 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.24 %	5.79 %	1.10 %	0.33	-0.18	0.99	-0.17 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.29 %	5.79 %	1.10 %	0.34	-0.14	0.99	-0.12 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.44 %	5.77 %	-	0.37	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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