

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	9.04 %	4.18 %	0.86 %	1.85	-1.04	1.08	-1.67 %	-2.01 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 II	9.10 %	4.18 %	0.86 %	1.86	-0.97	1.08	-1.60 %	-2.00 %	1.00
MIXTA OPTIMA 35 III	9.16 %	4.18 %	0.87 %	1.88	-0.91	1.08	-1.55 %	-2.00 %	1.00
MO35 Customised	10.04 %	4.33 %	-	2.01	-	-	-	-1.72 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	0.35 %	6.24 %	1.13 %	-0.21	-0.50	0.94	-0.59 %	-12.97 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 II	0.41 %	6.24 %	1.13 %	-0.20	-0.44	0.94	-0.53 %	-12.93 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 III	0.46 %	6.24 %	1.13 %	-0.19	-0.40	0.94	-0.48 %	-12.90 %	24.00
MO35 Customised	0.89 %	6.56 %	-	-0.12	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.12 %	6.76 %	1.18 %	0.07	-0.40	0.98	-0.46 %	-12.97 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.19 %	6.76 %	1.18 %	0.08	-0.34	0.98	-0.39 %	-12.93 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.24 %	6.76 %	1.18 %	0.09	-0.30	0.98	-0.33 %	-12.90 %	24.00
MO35 Customised	2.59 %	6.78 %	-	0.14	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.33 %	5.87 %	1.13 %	0.28	-0.38	0.99	-0.41 %	-12.97 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.43 %	5.87 %	1.14 %	0.30	-0.29	0.99	-0.31 %	-12.93 %	24.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.48 %	5.87 %	1.14 %	0.31	-0.25	0.99	-0.26 %	-12.90 %	24.00
MO35 Customised	3.77 %	5.84 %	-	0.36	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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