

MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	5.17 %	2.36 %	0.70 %	1.52	-1.56	0.98	-1.07 %	-0.84 %	2.00
MIXTA OPTIMA 15 III	5.22 %	2.35 %	0.70 %	1.54	-1.49	0.98	-1.02 %	-0.84 %	2.00
MO15 Customised	6.33 %	2.71 %	-	1.75	-	-	-	-0.55 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2024 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	-0.32 %	4.53 %	0.97 %	-0.41	-0.43	0.90	-0.54 %	-10.70 %	27.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.28 %	4.53 %	0.97 %	-0.40	-0.39	0.90	-0.50 %	-10.70 %	27.00
MO15 Customised	0.08 %	4.95 %	-	-0.30	-	-	-	-11.08 %	26.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	1.03 %	4.60 %	0.98 %	-0.11	-0.26	0.95	-0.26 %	-10.95 %	27.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.06 %	4.60 %	0.98 %	-0.11	-0.24	0.95	-0.24 %	-10.95 %	27.00
MO15 Customised	1.28 %	4.76 %	-	-0.06	-	-	-	-11.43 %	26.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	1.96 %	3.73 %	1.09 %	0.11	-0.26	0.93	-0.23 %	-10.95 %	27.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.97 %	3.73 %	1.09 %	0.11	-0.25	0.93	-0.22 %	-10.95 %	27.00
MO15 Customised	2.23 %	3.85 %	-	0.18	-	-	-	-11.43 %	26.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (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