

MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(nach BVV2 – Aktien- und Gesellschaftsbeteiligungs-Quote überschritten)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	9.73 %	7.36 %	1.01 %	1.10	-1.87	1.01	-2.22 %	-1.95 %	1.00
MIXTA OPTIMA 75 III	9.79 %	7.36 %	1.01 %	1.11	-1.82	1.01	-2.17 %	-1.94 %	1.00
MO75 Customised	11.83 %	7.64 %	-	1.33	-	-	-	-1.55 %	1.00

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 75 II	-0.31 %	9.46 %	1.33 %	-0.20	-1.00	0.97	-1.33 %	-17.83 %	27.00
MIXTA OPTIMA 75 III	-0.27 %	9.49 %	1.15 %	-0.19	-1.11	0.97	-1.28 %	-17.82 %	27.00
MO75 Customised	1.00 %	9.72 %	-	-0.06	-	-	-	-16.69 %	20.00

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 75 II	3.88 %	9.93 %	1.49 %	0.23	-0.74	0.94	-0.86 %	-17.83 %	27.00
MIXTA OPTIMA 75 III	3.91 %	9.94 %	1.40 %	0.24	-0.77	0.94	-0.84 %	-17.82 %	27.00
MO75 Customised	4.96 %	10.52 %	-	0.32	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.01 %	9.85 %	1.50 %	0.25	-0.66	0.94	-0.74 %	-17.83 %	27.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.03 %	9.86 %	1.41 %	0.25	-0.68	0.94	-0.72 %	-17.82 %	27.00
MO75 Customised	4.97 %	10.43 %	-	0.33	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 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