

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	10.28 %	8.24 %	1.04 %	1.24	-0.52	0.91	0.47 %	-4.61 %	4.00
MIXTA OPTIMA 75 III	10.33 %	8.24 %	1.04 %	1.25	-0.47	0.91	0.52 %	-4.60 %	4.00
MO75 Customised	10.83 %	9.02 %	-	1.20	-	-	-	-5.17 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	8.63 %	6.71 %	1.00 %	1.29	-1.25	0.97	-1.10 %	-6.34 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	8.68 %	6.71 %	1.00 %	1.29	-1.21	0.97	-1.04 %	-6.33 %	3.00
MO75 Customised	9.99 %	6.81 %	-	1.46	-	-	-	-5.61 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.96 %	8.63 %	1.32 %	0.58	-0.91	0.95	-0.93 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.99 %	8.65 %	1.22 %	0.58	-0.96	0.96	-0.92 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	6.19 %	8.97 %	-	0.69	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	5.01 %	9.36 %	1.43 %	0.54	-0.64	0.93	-0.50 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.04 %	9.37 %	1.35 %	0.54	-0.65	0.94	-0.48 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.91 %	9.94 %	-	0.60	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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