

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	4.73 %	9.66 %	0.94 %	0.38	0.86	0.95	1.03 %	-4.61 %	2.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.79 %	9.66 %	0.94 %	0.38	0.91	0.95	1.08 %	-4.60 %	2.00
MO75 Customised	3.88 %	10.29 %	-	0.27	-	-	-	-5.17 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	6.22 %	8.59 %	1.19 %	0.65	-0.51	0.94	-0.24 %	-7.37 %	4.00
MIXTA OPTIMA 75 III	6.28 %	8.59 %	1.19 %	0.65	-0.47	0.94	-0.19 %	-7.36 %	4.00
MO75 Customised	6.83 %	9.06 %	-	0.68	-	-	-	-7.90 %	7.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	5.32 %	9.18 %	1.43 %	0.51	-0.61	0.94	-0.53 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.35 %	9.19 %	1.33 %	0.51	-0.63	0.94	-0.52 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	6.18 %	9.66 %	-	0.57	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.20 %	9.74 %	1.47 %	0.36	-0.54	0.93	-0.46 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.23 %	9.75 %	1.38 %	0.37	-0.55	0.94	-0.45 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	4.95 %	10.33 %	-	0.41	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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