

## 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	5.69 %	7.77 %	1.08 %	0.56	-0.80	0.97	-0.74 %	-2.44 %	-
MIXTA OPTIMA 75 III	5.74 %	7.77 %	1.08 %	0.57	-0.76	0.97	-0.68 %	-2.43 %	-
MO75 Customised	6.59 %	8.09 %	-	0.65	-	-	-	-2.78 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	2.31 %	9.44 %	1.35 %	0.11	-0.81	0.95	-0.98 %	-13.37 %	18.00
MIXTA OPTIMA 75 III	2.36 %	9.46 %	1.18 %	0.11	-0.88	0.96	-0.95 %	-13.37 %	18.00
MO75 Customised	3.39 %	9.79 %	-	0.21	-	-	-	-12.78 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	6.96 %	9.29 %	1.46 %	0.61	-0.86	0.93	-0.83 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	6.99 %	9.30 %	1.37 %	0.61	-0.89	0.94	-0.82 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	8.25 %	9.83 %	-	0.70	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.31 %	9.84 %	1.48 %	0.31	-0.63	0.93	-0.64 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.33 %	9.85 %	1.40 %	0.31	-0.65	0.94	-0.63 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.21 %	10.44 %	-	0.37	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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