

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.92 %	3.24 %	0.63 %	1.34	-1.78	1.02	-1.32 %	-1.08 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.99 %	3.24 %	0.63 %	1.36	-1.68	1.02	-1.25 %	-1.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	6.04 %	3.24 %	0.63 %	1.37	-1.60	1.02	-1.20 %	-1.07 %	2.00
MO25 Customised	7.12 %	3.42 %	-	1.61	-	-	-	-0.81 %	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 25 I	-0.22 %	5.23 %	0.95 %	-0.34	-0.51	0.92	-0.57 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.16 %	5.23 %	0.95 %	-0.33	-0.45	0.92	-0.51 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.11 %	5.23 %	0.95 %	-0.32	-0.39	0.92	-0.46 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	0.24 %	5.64 %	-	-0.23	-	-	-	-11.81 %	24.00

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 25 I	1.57 %	5.70 %	1.09 %	0.00	-0.41	0.98	-0.44 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.64 %	5.70 %	1.09 %	0.01	-0.34	0.98	-0.37 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.69 %	5.70 %	1.09 %	0.02	-0.30	0.98	-0.32 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.02 %	5.70 %	-	0.08	-	-	-	-11.81 %	24.00

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 25 I	2.88 %	4.91 %	1.24 %	0.27	-0.06	1.01	-0.08 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.98 %	4.92 %	1.25 %	0.29	0.02	1.01	0.02 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.03 %	4.92 %	1.25 %	0.30	0.06	1.01	0.07 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.95 %	4.73 %	-	0.30	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.92 %	3.24 %	1.49 %	1.34	-1.55	0.84	-1.38 %	-1.08 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.99 %	3.24 %	1.49 %	1.36	-1.51	0.84	-1.31 %	-1.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	6.04 %	3.24 %	1.50 %	1.37	-1.48	0.84	-1.26 %	-1.07 %	2.00
BVG 25 (2000)	8.41 %	3.79 %	-	1.79	-	-	-	-0.65 %	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 25 I	-0.22 %	5.23 %	2.24 %	-0.34	-0.04	0.76	-0.41 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.16 %	5.23 %	2.24 %	-0.33	-0.01	0.76	-0.35 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.11 %	5.23 %	2.24 %	-0.32	0.01	0.76	-0.30 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	-0.23 %	6.55 %	-	-0.27	-	-	-	-14.73 %	27.00

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 25 I	1.57 %	5.70 %	2.04 %	0.00	0.22	0.85	0.44 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.64 %	5.70 %	2.04 %	0.01	0.26	0.85	0.51 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.69 %	5.70 %	2.04 %	0.02	0.28	0.85	0.56 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.05 %	6.35 %	-	-0.08	-	-	-	-15.55 %	27.00

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 25 I	2.88 %	4.91 %	1.82 %	0.27	0.43	0.89	0.88 %	-11.19 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.98 %	4.92 %	1.82 %	0.29	0.48	0.89	0.98 %	-11.15 %	27.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.03 %	4.92 %	1.82 %	0.30	0.51	0.89	1.04 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.05 %	5.18 %	-	0.10	-	-	-	-15.55 %	27.00

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