

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	4.49 %	3.41 %	0.55 %	1.32	-0.14	0.99	-0.02 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.56 %	3.41 %	0.55 %	1.34	-0.03	0.99	0.05 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.61 %	3.41 %	0.55 %	1.35	0.06	0.99	0.10 %	-2.05 %	4.00
MO25 Customised	4.57 %	3.72 %	-	1.23	-	-	-	-1.87 %	4.00

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 25 I	4.81 %	3.42 %	0.69 %	1.41	-1.22	0.99	-0.84 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.87 %	3.42 %	0.69 %	1.43	-1.13	0.99	-0.78 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.92 %	3.42 %	0.69 %	1.44	-1.06	0.99	-0.73 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	5.69 %	3.37 %	-	1.69	-	-	-	-2.26 %	2.00

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 25 I	2.14 %	4.53 %	0.95 %	0.48	-0.15	0.93	0.04 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.20 %	4.53 %	0.95 %	0.49	-0.09	0.93	0.10 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.25 %	4.53 %	0.95 %	0.50	-0.03	0.93	0.15 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.27 %	4.80 %	-	0.48	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.11 %	4.63 %	1.08 %	0.68	-0.09	1.00	-0.09 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.21 %	4.63 %	1.08 %	0.70	0.00	1.00	0.00 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.26 %	4.63 %	1.08 %	0.71	0.05	1.00	0.05 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.21 %	4.51 %	-	0.72	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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	4.49 %	3.41 %	1.25 %	1.32	1.47	0.88	2.21 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.56 %	3.41 %	1.25 %	1.34	1.52	0.88	2.27 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.61 %	3.41 %	1.25 %	1.35	1.56	0.88	2.33 %	-2.05 %	4.00
BVG 25 (2000)	2.60 %	3.82 %	-	0.69	-	-	-	-1.97 %	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 25 I	4.81 %	3.42 %	1.56 %	1.41	-0.67	0.85	-0.17 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.87 %	3.42 %	1.56 %	1.43	-0.63	0.85	-0.11 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.92 %	3.42 %	1.56 %	1.44	-0.60	0.85	-0.05 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	5.88 %	3.65 %	-	1.61	-	-	-	-1.97 %	5.00

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 25 I	2.14 %	4.53 %	2.02 %	0.48	0.50	0.78	1.32 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.20 %	4.53 %	2.02 %	0.49	0.53	0.78	1.38 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.25 %	4.53 %	2.02 %	0.50	0.55	0.78	1.43 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.06 %	5.41 %	-	0.20	-	-	-	-15.55 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.11 %	4.63 %	1.82 %	0.68	0.44	0.87	1.14 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.21 %	4.63 %	1.82 %	0.70	0.49	0.87	1.24 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.26 %	4.63 %	1.82 %	0.71	0.52	0.87	1.29 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.26 %	4.93 %	-	0.47	-	-	-	-15.55 %	36.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 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