



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	3.58 %	4.00 %	0.48 %	0.71	0.18	1.02	0.02 %	-2.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.64 %	4.00 %	0.48 %	0.72	0.31	1.02	0.08 %	-2.06 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.69 %	4.00 %	0.48 %	0.74	0.42	1.02	0.14 %	-2.05 %	2.00
MO25 Customised	3.49 %	4.25 %	-	0.67	-	-	-	-1.87 %	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 25 I	3.33 %	4.67 %	0.92 %	0.57	-0.76	0.92	-0.43 %	-4.84 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.68 %	0.92 %	0.58	-0.70	0.92	-0.37 %	-4.83 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.45 %	4.68 %	0.92 %	0.60	-0.64	0.92	-0.32 %	-4.82 %	15.00
MO25 Customised	4.04 %	5.01 %	-	0.67	-	-	-	-5.22 %	15.00

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 25 I	2.47 %	4.76 %	0.95 %	0.38	0.02	0.93	0.16 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.53 %	4.76 %	0.95 %	0.39	0.09	0.93	0.22 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.59 %	4.76 %	0.95 %	0.40	0.14	0.93	0.27 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.43 %	5.01 %	-	0.35	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.04 %	4.82 %	1.13 %	0.49	0.00	1.00	0.01 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.14 %	4.82 %	1.13 %	0.51	0.09	1.00	0.10 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.19 %	4.82 %	1.13 %	0.52	0.13	1.00	0.16 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.03 %	4.69 %	-	0.51	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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	3.58 %	4.00 %	1.29 %	0.71	0.58	0.92	0.96 %	-2.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.64 %	4.00 %	1.29 %	0.72	0.62	0.92	1.02 %	-2.06 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.69 %	4.00 %	1.29 %	0.74	0.66	0.92	1.07 %	-2.05 %	2.00
BVG 25 (2000)	2.80 %	4.40 %	-	0.50	-	-	-	-1.97 %	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 25 I	3.33 %	4.67 %	2.02 %	0.57	-0.37	0.77	0.07 %	-4.84 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.68 %	2.02 %	0.58	-0.34	0.77	0.14 %	-4.83 %	15.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.45 %	4.68 %	2.02 %	0.60	-0.31	0.77	0.19 %	-4.82 %	15.00
BVG 25 (2000)	4.03 %	5.72 %	-	0.59	-	-	-	-6.44 %	15.00

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 25 I	2.47 %	4.76 %	2.02 %	0.38	0.52	0.80	1.26 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.53 %	4.76 %	2.02 %	0.39	0.55	0.80	1.33 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.59 %	4.76 %	2.02 %	0.40	0.58	0.80	1.38 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.34 %	5.54 %	-	0.12	-	-	-	-15.55 %	33.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.04 %	4.82 %	1.83 %	0.49	0.44	0.88	1.03 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.14 %	4.82 %	1.83 %	0.51	0.49	0.88	1.13 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.19 %	4.82 %	1.83 %	0.52	0.52	0.88	1.18 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.18 %	5.09 %	-	0.30	-	-	-	-15.55 %	33.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 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