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	7.58 %	3.00 %	0.58 %	2.52	-0.65	1.10	-1.19 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	7.65 %	3.00 %	0.58 %	2.55	-0.54	1.10	-1.13 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	7.70 %	3.00 %	0.58 %	2.56	-0.46	1.10	-1.08 %	-2.33 %	2.00
MO25 Customised	*7.99 %*	*3.21 %*	-	*2.49*	-	-	-	*-1.96 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.23 %	3.68 %	0.63 %	1.43	-0.79	1.06	-0.87 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.30 %	3.68 %	0.63 %	1.45	-0.70	1.06	-0.81 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.35 %	3.68 %	0.63 %	1.47	-0.62	1.06	-0.76 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	*5.76 %*	*3.43 %*	-	*1.69*	-	-	-	*-2.26 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.89 %	4.70 %	0.90 %	0.41	-0.38	0.95	-0.21 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.95 %	4.70 %	0.90 %	0.43	-0.31	0.95	-0.14 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.00 %	4.70 %	0.90 %	0.44	-0.25	0.95	-0.09 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	*2.22 %*	*4.89 %*	-	*0.46*	-	-	-	*-11.81 %*	*24.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	4.72 %	1.04 %	0.71	-0.15	1.00	-0.17 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.72 %	1.04 %	0.73	-0.06	1.00	-0.08 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.44 %	4.72 %	1.04 %	0.74	-0.02	1.00	-0.03 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	*3.46 %*	*4.59 %*	-	*0.76*	-	-	-	*-11.81 %*	*24.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (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	7.58 %	3.00 %	1.07 %	2.52	0.92	1.09	0.42 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	7.65 %	3.00 %	1.07 %	2.55	0.98	1.09	0.49 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	7.70 %	3.00 %	1.07 %	2.56	1.02	1.09	0.54 %	-2.33 %	2.00
BVG 25 (2000)	*6.55 %*	*3.39 %*	-	*1.94*	-	-	-	*-1.87 %*	*2.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	5.23 %	3.68 %	1.41 %	1.43	-0.21	0.98	-0.20 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.30 %	3.68 %	1.41 %	1.45	-0.17	0.98	-0.13 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.35 %	3.68 %	1.41 %	1.47	-0.13	0.98	-0.08 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	*5.54 %*	*3.47 %*	-	*1.61*	-	-	-	*-1.97 %*	*5.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.89 %	4.70 %	2.00 %	0.41	0.34	0.80	0.99 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.95 %	4.70 %	2.00 %	0.43	0.38	0.80	1.05 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.00 %	4.70 %	2.00 %	0.44	0.40	0.80	1.11 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	*1.13 %*	*5.47 %*	-	*0.22*	-	-	-	*-15.55 %*	*36.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	4.72 %	1.76 %	0.71	0.50	0.88	1.21 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.39 %	4.72 %	1.76 %	0.73	0.55	0.88	1.30 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.44 %	4.72 %	1.76 %	0.74	0.58	0.88	1.35 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	*2.37 %*	*5.00 %*	-	*0.48*	-	-	-	*-15.55 %*	*36.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus