

## 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	3.98 %	3.35 %	0.67 %	0.80	-0.67	1.00	-0.47 %	-1.16 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	4.04 %	3.35 %	0.67 %	0.82	-0.58	1.00	-0.41 %	-1.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	4.10 %	3.35 %	0.67 %	0.83	-0.51	1.00	-0.36 %	-1.15 %	-
MO25 Customised	4.45 %	3.56 %	-	0.89	-	-	-	-1.34 %	-

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 25 I	1.37 %	5.16 %	0.93 %	0.01	-0.63	0.92	-0.53 %	-7.87 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.43 %	5.16 %	0.93 %	0.03	-0.57	0.92	-0.46 %	-7.84 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.48 %	5.16 %	0.93 %	0.04	-0.52	0.92	-0.41 %	-7.82 %	18.00
MO25 Customised	1.95 %	5.51 %	-	0.12	-	-	-	-7.85 %	18.00

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 25 I	3.42 %	4.87 %	0.95 %	0.43	0.01	0.93	0.18 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.49 %	4.87 %	0.95 %	0.45	0.08	0.93	0.25 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.54 %	4.87 %	0.95 %	0.46	0.13	0.93	0.30 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.39 %	5.16 %	-	0.40	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	2.83 %	4.84 %	1.16 %	0.32	0.01	0.99	0.02 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.93 %	4.84 %	1.16 %	0.34	0.09	0.99	0.12 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.99 %	4.84 %	1.16 %	0.35	0.14	0.99	0.17 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.82 %	4.73 %	-	0.32	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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	3.98 %	3.35 %	1.73 %	0.80	0.00	0.86	0.39 %	-1.16 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	4.04 %	3.35 %	1.73 %	0.82	0.03	0.86	0.45 %	-1.15 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	4.10 %	3.35 %	1.73 %	0.83	0.06	0.86	0.50 %	-1.15 %	-
BVG 25 (2000)	3.97 %	3.87 %	-	0.69	-	-	-	-1.49 %	-

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 25 I	1.37 %	5.16 %	2.11 %	0.01	-0.15	0.78	-0.16 %	-7.87 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.43 %	5.16 %	2.11 %	0.03	-0.12	0.78	-0.10 %	-7.84 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.48 %	5.16 %	2.11 %	0.04	-0.10	0.78	-0.05 %	-7.82 %	18.00
BVG 25 (2000)	1.61 %	6.30 %	-	0.05	-	-	-	-9.57 %	18.00

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 25 I	3.42 %	4.87 %	2.02 %	0.43	0.50	0.80	1.29 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.49 %	4.87 %	2.02 %	0.45	0.53	0.80	1.36 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.54 %	4.87 %	2.02 %	0.46	0.55	0.80	1.42 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.33 %	5.70 %	-	0.18	-	-	-	-15.55 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	2.83 %	4.84 %	1.83 %	0.32	0.45	0.88	0.95 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.93 %	4.84 %	1.83 %	0.34	0.50	0.89	1.05 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.99 %	4.84 %	1.83 %	0.35	0.53	0.89	1.10 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.97 %	5.11 %	-	0.13	-	-	-	-15.55 %	30.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 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