

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	7.95 %	3.31 %	0.79 %	1.99	-0.99	1.09	-1.50 %	-1.57 %	1.00
MIXTA OPTIMA 25 II	8.02 %	3.31 %	0.79 %	2.00	-0.91	1.09	-1.43 %	-1.56 %	1.00
MIXTA OPTIMA 25 III	8.07 %	3.31 %	0.79 %	2.02	-0.85	1.09	-1.38 %	-1.56 %	1.00
MO25 Customised	8.81 %	3.46 %	-	2.14	-	-	-	-1.25 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.28 %	5.22 %	1.09 %	-0.26	-0.35	0.92	-0.45 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.34 %	5.22 %	1.09 %	-0.25	-0.30	0.92	-0.38 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.39 %	5.22 %	1.09 %	-0.24	-0.25	0.92	-0.33 %	-11.11 %	24.00
MO25 Customised	0.65 %	5.59 %	-	-0.18	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.77 %	5.67 %	1.16 %	0.02	-0.20	0.98	-0.22 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.85 %	5.67 %	1.16 %	0.03	-0.14	0.98	-0.15 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.90 %	5.67 %	1.16 %	0.04	-0.09	0.98	-0.10 %	-11.11 %	24.00
MO25 Customised	2.00 %	5.67 %	-	0.06	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.06 %	4.90 %	1.25 %	0.29	-0.06	1.00	-0.09 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.17 %	4.90 %	1.26 %	0.31	0.02	1.00	0.02 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.22 %	4.90 %	1.26 %	0.32	0.06	1.00	0.07 %	-11.11 %	24.00
MO25 Customised	3.15 %	4.71 %	-	0.31	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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	7.95 %	3.31 %	1.64 %	1.99	-1.17	1.00	-2.09 %	-1.57 %	1.00
MIXTA OPTIMA 25 II	8.02 %	3.31 %	1.64 %	2.00	-1.13	1.00	-2.02 %	-1.56 %	1.00
MIXTA OPTIMA 25 III	8.07 %	3.31 %	1.64 %	2.02	-1.10	1.00	-1.97 %	-1.56 %	1.00
BVG 25 (2000)	10.04 %	3.81 %	-	2.27	-	-	-	-0.82 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.28 %	5.22 %	2.42 %	-0.26	0.24	0.76	0.18 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.34 %	5.22 %	2.42 %	-0.25	0.27	0.76	0.24 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.39 %	5.22 %	2.42 %	-0.24	0.29	0.76	0.29 %	-11.11 %	24.00
BVG 25 (2000)	-0.40 %	6.46 %	-	-0.32	-	-	-	-14.73 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.77 %	5.67 %	2.08 %	0.02	0.45	0.85	0.86 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.85 %	5.67 %	2.09 %	0.03	0.48	0.85	0.94 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.90 %	5.67 %	2.09 %	0.04	0.50	0.85	0.99 %	-11.11 %	24.00
BVG 25 (2000)	0.78 %	6.33 %	-	-0.14	-	-	-	-15.55 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.06 %	4.90 %	1.81 %	0.29	0.47	0.89	0.96 %	-11.19 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.17 %	4.90 %	1.81 %	0.31	0.53	0.89	1.06 %	-11.15 %	24.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.22 %	4.90 %	1.81 %	0.32	0.55	0.89	1.11 %	-11.11 %	24.00
BVG 25 (2000)	2.16 %	5.16 %	-	0.10	-	-	-	-15.55 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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