



MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Indicateurs de risque

| 1 année | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 5.92 % | 3.24 % | 0.63 % | 1.34 | -1.78 | 1.02 | -1.32 % | -1.08 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 5.99 % | 3.24 % | 0.63 % | 1.36 | -1.68 | 1.02 | -1.25 % | -1.07 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 6.04 % | 3.24 % | 0.63 % | 1.37 | -1.60 | 1.02 | -1.20 % | -1.07 % | 2.00 |
| MO25 Customised | 7.12 % | 3.42 % | - | 1.61 | - | - | - | -0.81 % | 1.00 |

Période d'observation: 01.01.2024 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 3 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|---------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | -0.22 % | 5.23 % | 0.95 % | -0.34 | -0.51 | 0.92 | -0.57 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | -0.16 % | 5.23 % | 0.95 % | -0.33 | -0.45 | 0.92 | -0.51 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | -0.11 % | 5.23 % | 0.95 % | -0.32 | -0.39 | 0.92 | -0.46 % | -11.11 % | 26.00 |
| MO25 Customised | 0.24 % | 5.64 % | - | -0.23 | - | - | - | -11.81 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.01.2022 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 5 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 1.57 % | 5.70 % | 1.09 % | 0.00 | -0.41 | 0.98 | -0.44 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 1.64 % | 5.70 % | 1.09 % | 0.01 | -0.34 | 0.98 | -0.37 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 1.69 % | 5.70 % | 1.09 % | 0.02 | -0.30 | 0.98 | -0.32 % | -11.11 % | 26.00 |
| MO25 Customised | 2.02 % | 5.70 % | - | 0.08 | - | - | - | -11.81 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.01.2020 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 10 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 2.88 % | 4.91 % | 1.24 % | 0.27 | -0.06 | 1.01 | -0.08 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 2.98 % | 4.92 % | 1.25 % | 0.29 | 0.02 | 1.01 | 0.02 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 3.03 % | 4.92 % | 1.25 % | 0.30 | 0.06 | 1.01 | 0.07 % | -11.11 % | 26.00 |
| MO25 Customised | 2.95 % | 4.73 % | - | 0.30 | - | - | - | -11.81 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.01.2015 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.55 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Indicateurs de risque

| 1 année | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 5.92 % | 3.24 % | 1.49 % | 1.34 | -1.55 | 0.84 | -1.38 % | -1.08 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 5.99 % | 3.24 % | 1.49 % | 1.36 | -1.51 | 0.84 | -1.31 % | -1.07 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 6.04 % | 3.24 % | 1.50 % | 1.37 | -1.48 | 0.84 | -1.26 % | -1.07 % | 2.00 |
| LPP 25 (2000) | 8.41 % | 3.79 % | - | 1.79 | - | - | - | -0.65 % | 2.00 |

Période d'observation: 01.01.2024 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 3 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|---------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | -0.22 % | 5.23 % | 2.24 % | -0.34 | -0.04 | 0.76 | -0.41 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | -0.16 % | 5.23 % | 2.24 % | -0.33 | -0.01 | 0.76 | -0.35 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | -0.11 % | 5.23 % | 2.24 % | -0.32 | 0.01 | 0.76 | -0.30 % | -11.11 % | 26.00 |
| LPP 25 (2000) | -0.23 % | 6.55 % | - | -0.27 | - | - | - | -14.73 % | 27.00 |

Période d'observation: 01.01.2022 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 5 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 1.57 % | 5.70 % | 2.04 % | 0.00 | 0.22 | 0.85 | 0.44 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 1.64 % | 5.70 % | 2.04 % | 0.01 | 0.26 | 0.85 | 0.51 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 1.69 % | 5.70 % | 2.04 % | 0.02 | 0.28 | 0.85 | 0.56 % | -11.11 % | 26.00 |
| LPP 25 (2000) | 1.05 % | 6.35 % | - | -0.08 | - | - | - | -15.55 % | 27.00 |

Période d'observation: 01.01.2020 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

| 10 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 25 I | 2.88 % | 4.91 % | 1.82 % | 0.27 | 0.43 | 0.89 | 0.88 % | -11.19 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 II | 2.98 % | 4.92 % | 1.82 % | 0.29 | 0.48 | 0.89 | 0.98 % | -11.15 % | 27.00 |
| MIXTA OPTIMA 25 III | 3.03 % | 4.92 % | 1.82 % | 0.30 | 0.51 | 0.89 | 1.04 % | -11.11 % | 26.00 |
| LPP 25 (2000) | 2.05 % | 5.18 % | - | 0.10 | - | - | - | -15.55 % | 27.00 |

Période d'observation: 01.01.2015 au 31.12.2024 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.55 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

| Chiffre-clé | Calcul | Description |
|-----------------------------------|---|--|
| Volatilité | $\sqrt{\text{Variance}}$ | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne |
| Ratio de Sharpe | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$ | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru |
| Tracking error | Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark) | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif) Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$ | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru |
| Coefficient bêta | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$ | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché |
| Alpha de Jensen | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$ | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période |
| Délai de récupération | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée |
| Duration modifiée | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$ | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt |