



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 | 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 % | - |

Période d'observation: 01.04.2024 au 31.03.2025 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 | 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 |

Période d'observation: 01.04.2022 au 31.03.2025 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 | 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 |

Période d'observation: 01.04.2020 au 31.03.2025 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 | 2.83 % | 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 |

Période d'observation: 01.04.2015 au 31.03.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.29 % (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 | 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 % | - |
| LPP 25 (2000) | 3.97 % | 3.87 % | - | 0.69 | - | - | - | -1.49 % | - |

Période d'observation: 01.04.2024 au 31.03.2025 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 | 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 |
| LPP 25 (2000) | 1.61 % | 6.30 % | - | 0.05 | - | - | - | -9.57 % | 18.00 |

Période d'observation: 01.04.2022 au 31.03.2025 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 | 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 |
| LPP 25 (2000) | 2.33 % | 5.70 % | - | 0.18 | - | - | - | -15.55 % | 30.00 |

Période d'observation: 01.04.2020 au 31.03.2025 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 | 2.83 % | 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 |
| LPP 25 (2000) | 1.97 % | 5.11 % | - | 0.13 | - | - | - | -15.55 % | 30.00 |

Période d'observation: 01.04.2015 au 31.03.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.29 % (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 |