



MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

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 35 I | 3.50 % | 4.67 % | 0.76 % | 0.75 | -0.64 | 1.07 | -0.81 % | -2.93 % | - |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 3.56 % | 4.67 % | 0.76 % | 0.77 | -0.56 | 1.07 | -0.75 % | -2.92 % | - |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 3.62 % | 4.67 % | 0.76 % | 0.78 | -0.50 | 1.07 | -0.70 % | -2.92 % | - |
| MO35 Customised | 4.02 % | 5.09 % | - | 0.79 | - | - | - | -2.44 % | - |

Période d'observation: 01.04.2025 au 31.03.2026 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 35 I | 4.44 % | 4.33 % | 0.73 % | 1.03 | -1.20 | 1.05 | -1.19 % | -3.59 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 4.50 % | 4.33 % | 0.73 % | 1.05 | -1.12 | 1.05 | -1.13 % | -3.57 % | 2.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 4.56 % | 4.33 % | 0.73 % | 1.06 | -1.05 | 1.05 | -1.07 % | -3.56 % | 2.00 |
| MO35 Customised | 5.37 % | 4.07 % | - | 1.32 | - | - | - | -3.00 % | 2.00 |

Période d'observation: 01.04.2023 au 31.03.2026 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 35 I | 1.84 % | 5.59 % | 0.97 % | 0.34 | -0.40 | 0.96 | -0.28 % | -12.97 % | 28.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 1.91 % | 5.59 % | 0.97 % | 0.35 | -0.34 | 0.96 | -0.22 % | -12.93 % | 28.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 1.96 % | 5.59 % | 0.97 % | 0.36 | -0.28 | 0.96 | -0.17 % | -12.90 % | 28.00 |
| MO35 Customised | 2.22 % | 5.76 % | - | 0.39 | - | - | - | -13.35 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.04.2021 au 31.03.2026 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 35 I | 3.53 % | 5.61 % | 1.04 % | 0.63 | -0.37 | 0.99 | -0.36 % | -12.97 % | 28.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 II | 3.63 % | 5.61 % | 1.04 % | 0.65 | -0.28 | 0.99 | -0.26 % | -12.93 % | 28.00 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 3.68 % | 5.61 % | 1.04 % | 0.66 | -0.23 | 0.99 | -0.21 % | -12.90 % | 28.00 |
| MO35 Customised | 3.93 % | 5.56 % | - | 0.71 | - | - | - | -13.35 % | 24.00 |

Période d'observation: 01.04.2016 au 31.03.2026 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (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 | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$ | 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 |