

MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
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 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2025 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
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

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
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

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
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

Beobachtungszeitraum: 01.04.2016 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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