



MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Risikokennzahlen

| 1 Jahr | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---------------------|--------|-------------|----------------|--------------|-------------------|------|--------------|--------------------------|----------------|
| MIXTA OPTIMA 15 II | 2.47 % | 2.55 % | 0.89 % | 0.97 | -0.37 | 1.14 | -0.75 % | -1.99 % | - |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 2.52 % | 2.55 % | 0.89 % | 0.99 | -0.31 | 1.14 | -0.69 % | -1.99 % | - |
| MO15 Customised | 2.81 % | 2.79 % | - | 1.01 | - | - | - | -1.37 % | - |

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 15 II | 3.47 % | 2.78 % | 0.79 % | 1.25 | -0.80 | 1.06 | -0.92 % | -1.99 % | - |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 3.52 % | 2.78 % | 0.79 % | 1.27 | -0.73 | 1.06 | -0.87 % | -1.99 % | - |
| MO15 Customised | 4.13 % | 2.51 % | - | 1.65 | - | - | - | -1.37 % | - |

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 15 II | 0.88 % | 3.85 % | 0.94 % | 0.24 | -0.18 | 0.91 | -0.07 % | -10.95 % | 29.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 0.91 % | 3.85 % | 0.94 % | 0.25 | -0.14 | 0.92 | -0.03 % | -10.95 % | 29.00 |
| MO15 Customised | 1.03 % | 4.10 % | - | 0.26 | - | - | - | -11.43 % | 26.00 |

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 15 II | 2.09 % | 3.64 % | 1.03 % | 0.58 | -0.15 | 0.94 | 0.00 % | -10.95 % | 29.00 |
| MIXTA OPTIMA 15 III | 2.11 % | 3.64 % | 1.03 % | 0.59 | -0.13 | 0.94 | 0.01 % | -10.95 % | 29.00 |
| MO15 Customised | 2.24 % | 3.74 % | - | 0.61 | - | - | - | -11.43 % | 26.00 |

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 |