

MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(nach BVV2 – Aktien- und Gesellschaftsbeteiligungs-Quote überschritten)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	5.68 %	8.66 %	1.22 %	0.65	-0.77	1.04	-1.28 %	-5.11 %	-
MIXTA OPTIMA 75 III	5.73 %	8.66 %	1.22 %	0.66	-0.73	1.04	-1.23 %	-5.10 %	-
MO75 Customised	6.70 %	9.37 %	-	0.71	-	-	-	-4.33 %	-

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 75 II	6.40 %	7.25 %	1.05 %	0.88	-1.29	1.02	-1.58 %	-6.34 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	6.45 %	7.25 %	1.05 %	0.89	-1.24	1.02	-1.53 %	-6.33 %	3.00
MO75 Customised	7.85 %	7.06 %	-	1.11	-	-	-	-5.61 %	3.00

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 75 II	3.45 %	8.85 %	1.29 %	0.39	-0.97	0.97	-1.14 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	3.48 %	8.87 %	1.19 %	0.40	-1.02	0.97	-1.12 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	4.72 %	9.02 %	-	0.53	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.52 %	9.49 %	1.44 %	0.48	-0.66	0.94	-0.62 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.55 %	9.51 %	1.36 %	0.48	-0.67	0.94	-0.60 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.45 %	9.98 %	-	0.55	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 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