

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.14 %	3.66 %	0.69 %	0.86	-0.63	1.09	-0.78 %	-2.34 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.20 %	3.66 %	0.69 %	0.88	-0.54	1.09	-0.72 %	-2.33 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.25 %	3.66 %	0.69 %	0.89	-0.47	1.09	-0.66 %	-2.33 %	-
MO25 Customised	3.59 %	3.92 %	-	0.92	-	-	-	-1.96 %	-

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 25 I	3.93 %	3.53 %	0.70 %	1.12	-1.15	1.06	-1.12 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.99 %	3.53 %	0.70 %	1.14	-1.06	1.06	-1.06 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.05 %	3.53 %	0.70 %	1.15	-0.99	1.06	-1.01 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	4.77 %	3.27 %	-	1.46	-	-	-	-2.26 %	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 25 I	1.59 %	4.64 %	0.93 %	0.35	-0.27	0.94	-0.13 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.65 %	4.64 %	0.93 %	0.36	-0.20	0.94	-0.07 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.70 %	4.64 %	0.93 %	0.37	-0.15	0.94	-0.02 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	1.83 %	4.83 %	-	0.38	-	-	-	-11.81 %	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 25 I	3.07 %	4.70 %	1.04 %	0.66	-0.17	1.00	-0.19 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.16 %	4.70 %	1.04 %	0.68	-0.08	1.00	-0.10 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.21 %	4.70 %	1.04 %	0.69	-0.03	1.00	-0.04 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.25 %	4.57 %	-	0.72	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2016 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.14 %	3.66 %	1.22 %	0.86	0.44	1.07	0.36 %	-2.34 %	-
MIXTA OPTIMA 25 II	3.20 %	3.66 %	1.22 %	0.88	0.49	1.07	0.43 %	-2.33 %	-
MIXTA OPTIMA 25 III	3.25 %	3.66 %	1.22 %	0.89	0.53	1.07	0.48 %	-2.33 %	-
BVG 25 (2000)	2.60 %	3.99 %	-	0.65	-	-	-	-1.87 %	-

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 25 I	3.93 %	3.53 %	1.50 %	1.12	-0.56	0.95	-0.65 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.99 %	3.53 %	1.50 %	1.14	-0.52	0.95	-0.59 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.05 %	3.53 %	1.50 %	1.15	-0.49	0.95	-0.54 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	4.81 %	3.35 %	-	1.44	-	-	-	-1.97 %	5.00

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 25 I	1.59 %	4.64 %	2.02 %	0.35	0.42	0.80	1.07 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.65 %	4.64 %	2.02 %	0.36	0.46	0.80	1.13 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.70 %	4.64 %	2.02 %	0.37	0.48	0.80	1.18 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	0.66 %	5.42 %	-	0.13	-	-	-	-15.55 %	36.00

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 25 I	3.07 %	4.70 %	1.77 %	0.66	0.47	0.88	1.14 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.16 %	4.70 %	1.77 %	0.68	0.52	0.88	1.23 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.21 %	4.70 %	1.77 %	0.69	0.55	0.88	1.28 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.19 %	4.98 %	-	0.45	-	-	-	-15.55 %	36.00

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