

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	-9.84 %	5.03 %	1.22 %	-1.99	0.81	0.89	-0.31 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-9.78 %	5.04 %	1.22 %	-1.98	0.86	0.89	-0.25 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-9.74 %	5.03 %	1.22 %	-1.97	0.90	0.89	-0.21 %	-11.11 %	3.00
MO25 Customised	-10.78 %	5.53 %	-	-1.98	-	-	-	-11.81 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-0.63 %	6.68 %	1.26 %	-0.12	0.06	0.99	0.06 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.56 %	6.68 %	1.26 %	-0.11	0.12	0.99	0.14 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.51 %	6.68 %	1.26 %	-0.11	0.16	0.99	0.19 %	-11.11 %	3.00
MO25 Customised	-0.71 %	6.66 %	-	-0.14	-	-	-	-11.81 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.02 %	5.72 %	1.26 %	0.14	-0.17	1.00	-0.21 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.12 %	5.72 %	1.26 %	0.16	-0.09	1.00	-0.11 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.17 %	5.72 %	1.26 %	0.17	-0.05	1.00	-0.06 %	-11.11 %	3.00
MO25 Customised	1.24 %	5.59 %	-	0.18	-	-	-	-11.81 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2018 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.20 %	4.83 %	1.29 %	0.62	0.14	1.01	0.17 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.32 %	4.84 %	1.29 %	0.64	0.23	1.01	0.28 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.37 %	4.84 %	1.29 %	0.65	0.27	1.01	0.34 %	-11.11 %	3.00
MO25 Customised	3.02 %	4.63 %	-	0.60	-	-	-	-11.81 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2013 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.20 % (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	-9.84 %	5.03 %	2.80 %	-1.99	1.71	0.75	0.68 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-9.78 %	5.04 %	2.80 %	-1.98	1.73	0.75	0.73 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-9.74 %	5.03 %	2.80 %	-1.97	1.75	0.75	0.78 %	-11.11 %	3.00
BVG 25 (2000)	-14.16 %	6.87 %	-	-2.08	-	-	-	-14.73 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	-0.63 %	6.68 %	2.14 %	-0.12	1.13	0.87	2.01 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	-0.56 %	6.68 %	2.14 %	-0.11	1.17	0.87	2.08 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	-0.51 %	6.68 %	2.14 %	-0.11	1.19	0.87	2.13 %	-11.11 %	3.00
BVG 25 (2000)	-3.06 %	7.35 %	-	-0.44	-	-	-	-15.55 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.02 %	5.72 %	2.00 %	0.14	0.80	0.88	1.55 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.12 %	5.72 %	2.00 %	0.16	0.85	0.88	1.64 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.17 %	5.72 %	2.00 %	0.17	0.88	0.88	1.69 %	-11.11 %	3.00
BVG 25 (2000)	-0.62 %	6.11 %	-	-0.13	-	-	-	-15.55 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2018 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.20 %	4.83 %	1.67 %	0.62	0.73	0.91	1.43 %	-11.19 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.32 %	4.84 %	1.67 %	0.64	0.80	0.91	1.55 %	-11.15 %	3.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.37 %	4.84 %	1.67 %	0.65	0.83	0.91	1.60 %	-11.11 %	3.00
BVG 25 (2000)	1.93 %	5.03 %	-	0.34	-	-	-	-15.55 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2013 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.20 % (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