

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	5.14 %	3.60 %	0.75 %	0.90	-2.04	1.07	-1.96 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.20 %	3.60 %	0.75 %	0.91	-1.96	1.07	-1.90 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.25 %	3.60 %	0.75 %	0.93	-1.89	1.07	-1.85 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	6.77 %	3.81 %	-	1.27	-	-	-	-3.00 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	-0.53 %	6.34 %	1.11 %	-0.38	-0.64	0.94	-0.79 %	-12.97 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 II	-0.47 %	6.34 %	1.11 %	-0.37	-0.58	0.94	-0.73 %	-12.93 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 III	-0.42 %	6.34 %	1.11 %	-0.36	-0.54	0.94	-0.68 %	-12.90 %	21.00
MO35 Customised	0.15 %	6.68 %	-	-0.26	-	-	-	-13.35 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.02 %	6.74 %	1.23 %	0.02	-0.52	0.98	-0.62 %	-12.97 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.10 %	6.74 %	1.23 %	0.03	-0.45	0.98	-0.55 %	-12.93 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.15 %	6.75 %	1.23 %	0.04	-0.41	0.98	-0.50 %	-12.90 %	21.00
MO35 Customised	2.66 %	6.78 %	-	0.11	-	-	-	-13.35 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.25 %	5.87 %	1.15 %	0.23	-0.50	0.98	-0.56 %	-12.97 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.36 %	5.87 %	1.15 %	0.25	-0.41	0.98	-0.45 %	-12.93 %	21.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.41 %	5.87 %	1.15 %	0.26	-0.37	0.98	-0.40 %	-12.90 %	21.00
MO35 Customised	3.84 %	5.85 %	-	0.33	-	-	-	-13.35 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (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