

## 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	-14.77 %	11.46 %	1.88 %	-1.30	-0.40	0.94	-1.44 %	-17.83 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	-14.75 %	11.51 %	1.47 %	-1.29	-0.49	0.95	-1.30 %	-17.82 %	3.00
MO75 Customised	-14.18 %	12.00 %	-	-1.20	-	-	-	-16.69 %	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 75 II	1.34 %	11.55 %	1.75 %	0.10	-0.43	0.92	-0.52 %	-17.83 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	1.35 %	11.57 %	1.62 %	0.10	-0.46	0.92	-0.51 %	-17.82 %	3.00
MO75 Customised	2.00 %	12.43 %	-	0.14	-	-	-	-16.69 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	1.61 %	11.40 %	1.76 %	0.12	-0.33	0.92	-0.33 %	-17.83 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	1.62 %	11.42 %	1.63 %	0.12	-0.35	0.92	-0.33 %	-17.82 %	3.00
MO75 Customised	2.09 %	12.26 %	-	0.15	-	-	-	-16.69 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 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