

MIXTA OPTIMA 15 (MO15)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	-9.72 %	3.97 %	1.25 %	-2.49	0.68	0.87	-0.63 %	-10.70 %	3.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-9.70 %	3.97 %	1.25 %	-2.48	0.69	0.87	-0.62 %	-10.70 %	3.00
MO15 Customised	-10.53 %	4.62 %	-	-2.31	-	-	-	-11.08 %	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 15 II	-1.37 %	5.31 %	1.08 %	-0.29	0.25	0.95	0.19 %	-10.95 %	3.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-1.36 %	5.31 %	1.08 %	-0.29	0.26	0.95	0.19 %	-10.95 %	3.00
MO15 Customised	-1.65 %	5.50 %	-	-0.34	-	-	-	-11.43 %	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 15 II	0.19 %	4.40 %	1.21 %	0.00	-0.16	0.93	-0.16 %	-10.95 %	3.00
MIXTA OPTIMA 15 III	0.19 %	4.40 %	1.21 %	0.00	-0.15	0.93	-0.16 %	-10.95 %	3.00
MO15 Customised	0.37 %	4.58 %	-	0.04	-	-	-	-11.43 %	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 15 II	1.98 %	3.64 %	1.16 %	0.49	-0.23	0.91	-0.06 %	-10.95 %	3.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.98 %	3.64 %	1.16 %	0.49	-0.22	0.91	-0.06 %	-10.95 %	3.00
MO15 Customised	2.24 %	3.83 %	-	0.53	-	-	-	-11.43 %	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