



# MIXTA OPTIMA 35 (MO35)

## Indicateurs de risque

| 1 année             | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I   | 5.55 % | 4.35 %     | 0.57 %         | 1.27         | -0.08             | 0.95             | 0.26 %          | -2.65 %            | 4.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 5.61 % | 4.35 %     | 0.57 %         | 1.29         | 0.02              | 0.95             | 0.32 %          | -2.64 %            | 4.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 5.66 % | 4.35 %     | 0.57 %         | 1.30         | 0.11              | 0.95             | 0.37 %          | -2.63 %            | 4.00                  |
| MO35 Customised     | 5.59 % | 4.83 %     | -              | 1.16         | -                 | -                | -               | -2.75 %            | 5.00                  |

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| 3 années            | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I   | 5.61 % | 4.14 %     | 0.71 %         | 1.36         | -1.23             | 0.99             | -0.88 %         | -3.59 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 5.68 % | 4.14 %     | 0.71 %         | 1.37         | -1.15             | 0.99             | -0.81 %         | -3.57 %            | 2.00                  |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 5.73 % | 4.14 %     | 0.71 %         | 1.38         | -1.08             | 0.99             | -0.76 %         | -3.56 %            | 2.00                  |
| MO35 Customised     | 6.55 % | 4.12 %     | -              | 1.59         | -                 | -                | -               | -3.00 %            | 2.00                  |

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| 5 années            | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I   | 2.63 % | 5.48 %     | 0.96 %         | 0.49         | -0.28             | 0.94             | -0.10 %         | -12.97 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 2.70 % | 5.48 %     | 0.96 %         | 0.50         | -0.22             | 0.94             | -0.03 %         | -12.93 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 2.75 % | 5.48 %     | 0.96 %         | 0.51         | -0.17             | 0.94             | 0.02 %          | -12.90 %           | 28.00                 |
| MO35 Customised     | 2.89 % | 5.73 %     | -              | 0.51         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 24.00                 |

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| 10 années           | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 35 I   | 3.55 % | 5.53 %     | 1.07 %         | 0.65         | -0.27             | 0.99             | -0.25 %         | -12.97 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 II  | 3.64 % | 5.53 %     | 1.07 %         | 0.66         | -0.19             | 0.99             | -0.15 %         | -12.93 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 35 III | 3.69 % | 5.53 %     | 1.07 %         | 0.67         | -0.14             | 0.99             | -0.10 %         | -12.90 %           | 28.00                 |
| MO35 Customised     | 3.84 % | 5.50 %     | -              | 0.70         | -                 | -                | -               | -13.35 %           | 24.00                 |

Période d'observation: 01.01.2016 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



| Chiffre-clé                       | Calcul                                                                                                                                                                                                                          | Description                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Volatilité                        | $\sqrt{\text{Variance}}$                                                                                                                                                                                                        | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne                                                                                                                                                              |
| Ratio de Sharpe                   | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$                                                                                   | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru                                                                                                                                                                     |
| Tracking error                    | Déviati on standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark)                                                                                                                                          | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif)<br>Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information               | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$                                                                                                             | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru                                                                                                                                                                             |
| Coefficient bêta                  | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$                                                                                                  | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché                                                                                                                                                                         |
| Alpha de Jensen                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque                                                                                                                                                                      |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$                                                | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période                                                                                                              |
| Délai de récupération             | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale                            | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée                                                                                                                                                                |
| Duration modifiée                 | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$                                                                                             | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt                                                                                                                                                                             |