

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	3.78 %	4.50 %	0.58 %	0.75	-0.45	0.97	-0.16 %	-2.65 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.84 %	4.50 %	0.58 %	0.76	-0.34	0.97	-0.09 %	-2.64 %	4.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.89 %	4.50 %	0.58 %	0.77	-0.26	0.97	-0.04 %	-2.63 %	4.00
MO35 Customised	4.04 %	4.97 %	-	0.73	-	-	-	-2.75 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	5.58 %	4.62 %	0.88 %	1.12	-0.83	0.94	-0.41 %	-3.59 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	5.65 %	4.62 %	0.89 %	1.14	-0.76	0.94	-0.35 %	-3.57 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	5.70 %	4.62 %	0.88 %	1.15	-0.70	0.94	-0.30 %	-3.56 %	2.00
MO35 Customised	6.34 %	4.82 %	-	1.23	-	-	-	-3.00 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.01 %	5.81 %	0.97 %	0.45	-0.18	0.95	-0.02 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.08 %	5.81 %	0.98 %	0.46	-0.11	0.95	0.05 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.13 %	5.81 %	0.97 %	0.47	-0.06	0.95	0.10 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.17 %	6.04 %	-	0.46	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.64 %	5.65 %	1.07 %	0.57	-0.24	0.99	-0.21 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.74 %	5.65 %	1.07 %	0.59	-0.15	0.99	-0.11 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.79 %	5.65 %	1.07 %	0.60	-0.10	0.99	-0.06 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	3.90 %	5.62 %	-	0.62	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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