

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	6.51 %	3.95 %	0.61 %	1.64	-1.19	1.10	-1.53 %	-2.93 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	6.56 %	3.95 %	0.62 %	1.66	-1.11	1.10	-1.48 %	-2.92 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	6.61 %	3.95 %	0.62 %	1.67	-1.03	1.10	-1.43 %	-2.92 %	2.00
MO35 Customised	7.31 %	4.13 %	-	1.77	-	-	-	-2.44 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2025 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	6.42 %	4.47 %	0.67 %	1.44	-0.97	1.05	-1.05 %	-2.93 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 II	6.48 %	4.47 %	0.68 %	1.45	-0.89	1.05	-0.99 %	-2.92 %	2.00
MIXTA OPTIMA 35 III	6.53 %	4.47 %	0.68 %	1.46	-0.81	1.05	-0.94 %	-2.92 %	2.00
MO35 Customised	7.13 %	4.22 %	-	1.69	-	-	-	-2.75 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	2.24 %	5.57 %	0.94 %	0.41	-0.58	0.96	-0.43 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	2.29 %	5.57 %	0.94 %	0.42	-0.52	0.96	-0.38 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	2.34 %	5.57 %	0.94 %	0.43	-0.47	0.96	-0.32 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	2.79 %	5.73 %	-	0.49	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 35 I	3.62 %	5.63 %	1.03 %	0.65	-0.44	0.99	-0.43 %	-12.97 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 II	3.71 %	5.63 %	1.03 %	0.66	-0.36	0.99	-0.34 %	-12.93 %	28.00
MIXTA OPTIMA 35 III	3.76 %	5.64 %	1.03 %	0.67	-0.31	0.99	-0.29 %	-12.90 %	28.00
MO35 Customised	4.09 %	5.59 %	-	0.74	-	-	-	-13.35 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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