

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	7.35 %	2.46 %	0.86 %	2.39	-0.42	1.09	-0.94 %	-0.91 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	7.40 %	2.46 %	0.86 %	2.41	-0.36	1.09	-0.89 %	-0.90 %	1.00
MO15 Customised	7.75 %	2.75 %	-	2.29	-	-	-	-0.61 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	-0.15 %	4.46 %	1.07 %	-0.40	-0.20	0.89	-0.36 %	-10.70 %	24.00
MIXTA OPTIMA 15 III	-0.12 %	4.47 %	1.06 %	-0.40	-0.17	0.89	-0.33 %	-10.70 %	24.00
MO15 Customised	0.04 %	4.88 %	-	-0.33	-	-	-	-11.08 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	1.03 %	4.57 %	1.04 %	-0.14	-0.04	0.94	-0.06 %	-10.95 %	24.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.05 %	4.57 %	1.04 %	-0.13	-0.02	0.94	-0.04 %	-10.95 %	24.00
MO15 Customised	1.06 %	4.74 %	-	-0.13	-	-	-	-11.43 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 15 II	2.10 %	3.71 %	1.14 %	0.12	-0.32	0.92	-0.30 %	-10.95 %	24.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.11 %	3.71 %	1.14 %	0.12	-0.31	0.92	-0.29 %	-10.95 %	24.00
MO15 Customised	2.46 %	3.86 %	-	0.21	-	-	-	-11.43 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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