



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	2.84 %	2.47 %	0.66 %	0.99	-0.49	0.94	-0.15 %	-1.20 %	4.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.89 %	2.47 %	0.66 %	1.01	-0.41	0.94	-0.10 %	-1.19 %	4.00
MO15 Customised	3.17 %	2.85 %	-	0.97	-	-	-	-0.99 %	4.00

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 15 II	4.31 %	3.06 %	0.88 %	1.28	-0.56	0.89	-0.02 %	-1.78 %	1.00
MIXTA OPTIMA 15 III	4.36 %	3.06 %	0.88 %	1.30	-0.51	0.89	0.03 %	-1.77 %	1.00
MO15 Customised	4.81 %	3.31 %	-	1.33	-	-	-	-2.41 %	1.00

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 15 II	1.45 %	3.84 %	0.95 %	0.28	-0.04	0.90	0.09 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	1.48 %	3.84 %	0.94 %	0.28	0.00	0.90	0.12 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	1.46 %	4.17 %	-	0.26	-	-	-	-11.43 %	26.00

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 15 II	2.25 %	3.63 %	1.06 %	0.51	-0.13	0.92	0.02 %	-10.95 %	29.00
MIXTA OPTIMA 15 III	2.26 %	3.63 %	1.06 %	0.52	-0.12	0.92	0.04 %	-10.95 %	29.00
MO15 Customised	2.38 %	3.78 %	-	0.53	-	-	-	-11.43 %	26.00

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