



MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(nach BVV2 – Aktien- und Gesellschaftsbeteiligungs-Quote überschritten)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	5.43 %	8.43 %	1.04 %	0.59	-0.41	0.94	-0.09 %	-4.61 %	4.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.48 %	8.43 %	1.04 %	0.60	-0.36	0.94	-0.04 %	-4.60 %	4.00
MO75 Customised	5.85 %	9.16 %	-	0.59	-	-	-	-5.17 %	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 75 II	8.47 %	7.40 %	1.19 %	1.09	-0.71	0.95	-0.41 %	-6.34 %	3.00
MIXTA OPTIMA 75 III	8.52 %	7.40 %	1.19 %	1.10	-0.67	0.95	-0.36 %	-6.33 %	3.00
MO75 Customised	9.35 %	7.72 %	-	1.16	-	-	-	-5.61 %	3.00

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 75 II	5.30 %	9.16 %	1.43 %	0.53	-0.70	0.94	-0.66 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	5.33 %	9.17 %	1.34 %	0.54	-0.72	0.94	-0.64 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	6.30 %	9.62 %	-	0.61	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 75 II	4.50 %	9.54 %	1.45 %	0.43	-0.58	0.93	-0.49 %	-17.83 %	28.00
MIXTA OPTIMA 75 III	4.53 %	9.55 %	1.37 %	0.43	-0.60	0.94	-0.48 %	-17.82 %	28.00
MO75 Customised	5.32 %	10.12 %	-	0.49	-	-	-	-16.69 %	20.00

Beobachtungszeitraum: 01.12.2019 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