

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	3.56 %	0.57 %	0.81	-0.56	1.00	-0.33 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.36 %	3.56 %	0.56 %	0.83	-0.45	1.00	-0.27 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.41 %	3.56 %	0.56 %	0.84	-0.36	1.00	-0.22 %	-2.05 %	4.00
MO25 Customised	3.62 %	3.86 %	-	0.83	-	-	-	-1.87 %	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 25 I	4.80 %	3.81 %	0.83 %	1.16	-0.87	0.94	-0.42 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.86 %	3.81 %	0.83 %	1.17	-0.80	0.94	-0.35 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.91 %	3.81 %	0.83 %	1.19	-0.74	0.94	-0.30 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	5.55 %	3.98 %	-	1.29	-	-	-	-2.55 %	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 25 I	2.49 %	4.76 %	0.96 %	0.44	-0.05	0.93	0.11 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.55 %	4.76 %	0.96 %	0.45	0.02	0.93	0.18 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.61 %	4.76 %	0.96 %	0.47	0.07	0.93	0.23 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.52 %	5.02 %	-	0.43	-	-	-	-11.81 %	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 25 I	3.24 %	4.73 %	1.12 %	0.60	0.03	0.99	0.05 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.34 %	4.73 %	1.12 %	0.62	0.11	0.99	0.14 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.39 %	4.73 %	1.12 %	0.63	0.15	0.99	0.20 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.21 %	4.62 %	-	0.61	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

MIXTA OPTIMA 25 (MO25)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.30 %	3.56 %	1.35 %	0.81	0.14	0.90	0.49 %	-2.07 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.36 %	3.56 %	1.35 %	0.83	0.19	0.90	0.55 %	-2.06 %	4.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.41 %	3.56 %	1.35 %	0.84	0.22	0.90	0.60 %	-2.05 %	4.00
BVG 25 (2000)	3.09 %	4.02 %	-	0.67	-	-	-	-1.97 %	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 25 I	4.80 %	3.81 %	1.78 %	1.16	-0.56	0.79	0.14 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.86 %	3.81 %	1.78 %	1.17	-0.53	0.79	0.20 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.91 %	3.81 %	1.78 %	1.19	-0.50	0.79	0.25 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	5.81 %	4.44 %	-	1.22	-	-	-	-3.32 %	5.00

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 25 I	2.49 %	4.76 %	2.02 %	0.44	0.50	0.80	1.29 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.55 %	4.76 %	2.02 %	0.45	0.54	0.80	1.36 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.61 %	4.76 %	2.02 %	0.47	0.56	0.80	1.41 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.39 %	5.55 %	-	0.18	-	-	-	-15.55 %	36.00

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 25 I	3.24 %	4.73 %	1.83 %	0.60	0.46	0.88	1.14 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.34 %	4.73 %	1.83 %	0.62	0.51	0.88	1.23 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.39 %	4.73 %	1.83 %	0.63	0.54	0.88	1.28 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.35 %	5.03 %	-	0.39	-	-	-	-15.55 %	36.00

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