



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	5.08 %	3.17 %	0.54 %	1.60	-0.75	1.11	-1.05 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.13 %	3.17 %	0.55 %	1.62	-0.66	1.11	-1.01 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.18 %	3.17 %	0.55 %	1.63	-0.57	1.11	-0.96 %	-2.33 %	2.00
MO25 Customised	5.53 %	3.32 %	-	1.66	-	-	-	-1.96 %	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 25 I	5.43 %	3.64 %	0.62 %	1.49	-0.86	1.07	-0.97 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.49 %	3.64 %	0.62 %	1.51	-0.77	1.07	-0.91 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.54 %	3.64 %	0.62 %	1.52	-0.69	1.07	-0.86 %	-2.33 %	2.00
MO25 Customised	6.00 %	3.37 %	-	1.78	-	-	-	-1.96 %	2.00

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 25 I	1.83 %	4.62 %	0.90 %	0.40	-0.44	0.94	-0.26 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.89 %	4.62 %	0.90 %	0.41	-0.37	0.94	-0.21 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.94 %	4.62 %	0.90 %	0.43	-0.32	0.94	-0.15 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	2.22 %	4.81 %	-	0.47	-	-	-	-11.81 %	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 25 I	3.06 %	4.72 %	1.03 %	0.65	-0.23	1.00	-0.25 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.15 %	4.72 %	1.03 %	0.67	-0.14	1.00	-0.16 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.20 %	4.72 %	1.03 %	0.68	-0.10	1.00	-0.11 %	-11.11 %	26.00
MO25 Customised	3.30 %	4.59 %	-	0.72	-	-	-	-11.81 %	24.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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	5.08 %	3.17 %	1.09 %	1.60	1.03	1.09	0.79 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.13 %	3.17 %	1.10 %	1.62	1.07	1.09	0.83 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.18 %	3.17 %	1.10 %	1.63	1.11	1.09	0.88 %	-2.33 %	2.00
BVG 25 (2000)	3.93 %	3.57 %	-	1.10	-	-	-	-1.87 %	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 25 I	5.43 %	3.64 %	1.39 %	1.49	-0.15	0.97	-0.07 %	-2.34 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	5.49 %	3.64 %	1.39 %	1.51	-0.11	0.97	-0.01 %	-2.33 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	5.54 %	3.64 %	1.39 %	1.52	-0.07	0.97	0.04 %	-2.33 %	2.00
BVG 25 (2000)	5.64 %	3.45 %	-	1.64	-	-	-	-1.97 %	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 25 I	1.83 %	4.62 %	2.01 %	0.40	0.30	0.79	0.92 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	1.89 %	4.62 %	2.01 %	0.41	0.33	0.80	0.98 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	1.94 %	4.62 %	2.01 %	0.43	0.36	0.80	1.03 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	1.15 %	5.41 %	-	0.22	-	-	-	-14.73 %	28.00

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 25 I	3.06 %	4.72 %	1.76 %	0.65	0.46	0.88	1.11 %	-11.19 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.15 %	4.72 %	1.76 %	0.67	0.51	0.88	1.20 %	-11.15 %	28.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.20 %	4.72 %	1.76 %	0.68	0.53	0.88	1.25 %	-11.11 %	26.00
BVG 25 (2000)	2.21 %	5.01 %	-	0.45	-	-	-	-15.55 %	36.00

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