



# MIXTA OPTIMA 75 (MO75)

(Quote-part en actions et participations à des sociétés dépassée selon l'OPP 2)

## Indicateurs de risque

| 1 année             | Rdmt    | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|---------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 75 II  | 10.28 % | 8.24 %     | 1.04 %         | 1.24         | -0.52             | 0.91             | 0.47 %          | -4.61 %            | 4.00                  |
| MIXTA OPTIMA 75 III | 10.33 % | 8.24 %     | 1.04 %         | 1.25         | -0.47             | 0.91             | 0.52 %          | -4.60 %            | 4.00                  |
| MO75 Customised     | 10.83 % | 9.02 %     | -              | 1.20         | -                 | -                | -               | -5.17 %            | 5.00                  |

Période d'observation: 01.01.2025 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| 3 années            | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 75 II  | 8.63 % | 6.71 %     | 1.00 %         | 1.29         | -1.25             | 0.97             | -1.10 %         | -6.34 %            | 3.00                  |
| MIXTA OPTIMA 75 III | 8.68 % | 6.71 %     | 1.00 %         | 1.29         | -1.21             | 0.97             | -1.04 %         | -6.33 %            | 3.00                  |
| MO75 Customised     | 9.99 % | 6.81 %     | -              | 1.46         | -                 | -                | -               | -5.61 %            | 3.00                  |

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| 5 années            | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 75 II  | 4.96 % | 8.63 %     | 1.32 %         | 0.58         | -0.91             | 0.95             | -0.93 %         | -17.83 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 75 III | 4.99 % | 8.65 %     | 1.22 %         | 0.58         | -0.96             | 0.96             | -0.92 %         | -17.82 %           | 28.00                 |
| MO75 Customised     | 6.19 % | 8.97 %     | -              | 0.69         | -                 | -                | -               | -16.69 %           | 20.00                 |

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

| Depuis le lancement | Rdmt   | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---------------------|--------|------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| MIXTA OPTIMA 75 II  | 5.01 % | 9.36 %     | 1.43 %         | 0.54         | -0.64             | 0.93             | -0.50 %         | -17.83 %           | 28.00                 |
| MIXTA OPTIMA 75 III | 5.04 % | 9.37 %     | 1.35 %         | 0.54         | -0.65             | 0.94             | -0.48 %         | -17.82 %           | 28.00                 |
| MO75 Customised     | 5.91 % | 9.94 %     | -              | 0.60         | -                 | -                | -               | -16.69 %           | 20.00                 |

Période d'observation: 01.12.2019 au 31.12.2025 Période de base: mensuel

Taux sans risque: -0.04 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves



| Chiffre-clé                       | Calcul                                                                                                                                                                                                                          | Description                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Volatilité                        | $\sqrt{\text{Variance}}$                                                                                                                                                                                                        | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne                                                                                                                                                              |
| Ratio de Sharpe                   | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$                                                                                   | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru                                                                                                                                                                     |
| Tracking error                    | Déviati on standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark)                                                                                                                                          | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif)<br>Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information               | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$                                                                                                             | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru                                                                                                                                                                             |
| Coefficient bêta                  | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$                                                                                                  | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché                                                                                                                                                                         |
| Alpha de Jensen                   | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}) - \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{1}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque                                                                                                                                                                      |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$                                                | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période                                                                                                              |
| Délai de récupération             | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale                            | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée                                                                                                                                                                |
| Duration modifiée                 | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$                                                                                             | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt                                                                                                                                                                             |