

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	4.68 %	2.80 %	0.79 %	1.05	-1.72	1.08	-1.80 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.75 %	2.81 %	0.79 %	1.07	-1.65	1.08	-1.74 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.80 %	2.80 %	0.79 %	1.09	-1.58	1.08	-1.69 %	-2.79 %	2.00
MO25 Customised	6.13 %	3.02 %	-	1.45	-	-	-	-2.26 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.29 %	5.32 %	1.09 %	-0.27	-0.06	0.92	-0.15 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.36 %	5.32 %	1.09 %	-0.26	0.00	0.92	-0.09 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.41 %	5.32 %	1.09 %	-0.25	0.04	0.92	-0.04 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	0.34 %	5.68 %	-	-0.24	-	-	-	-11.81 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.97 %	5.67 %	1.19 %	0.04	-0.20	0.97	-0.22 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.05 %	5.67 %	1.19 %	0.06	-0.13	0.97	-0.14 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.10 %	5.67 %	1.19 %	0.07	-0.09	0.97	-0.09 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	2.21 %	5.69 %	-	0.08	-	-	-	-11.81 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.18 %	4.89 %	1.25 %	0.30	-0.09	1.00	-0.12 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.29 %	4.89 %	1.25 %	0.32	-0.01	1.00	-0.01 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.34 %	4.89 %	1.26 %	0.33	0.03	1.00	0.04 %	-11.11 %	18.00
MO25 Customised	3.29 %	4.72 %	-	0.33	-	-	-	-11.81 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2014 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.71 % (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	4.68 %	2.80 %	1.43 %	1.05	-2.10	1.02	-3.35 %	-2.82 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 II	4.75 %	2.81 %	1.43 %	1.07	-2.06	1.02	-3.29 %	-2.80 %	2.00
MIXTA OPTIMA 25 III	4.80 %	2.80 %	1.43 %	1.09	-2.03	1.02	-3.23 %	-2.79 %	2.00
BVG 25 (2000)	7.92 %	3.69 %	-	1.67	-	-	-	-1.65 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	0.29 %	5.32 %	2.34 %	-0.27	0.54	0.77	0.71 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	0.36 %	5.32 %	2.34 %	-0.26	0.57	0.77	0.77 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	0.41 %	5.32 %	2.34 %	-0.25	0.59	0.77	0.82 %	-11.11 %	18.00
BVG 25 (2000)	-1.05 %	6.49 %	-	-0.43	-	-	-	-15.55 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	1.97 %	5.67 %	2.08 %	0.04	0.46	0.84	0.91 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	2.05 %	5.67 %	2.08 %	0.06	0.50	0.84	0.99 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	2.10 %	5.67 %	2.08 %	0.07	0.52	0.84	1.04 %	-11.11 %	18.00
BVG 25 (2000)	0.95 %	6.36 %	-	-0.12	-	-	-	-15.55 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 25 I	3.18 %	4.89 %	1.78 %	0.30	0.45	0.89	0.92 %	-11.19 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 II	3.29 %	4.89 %	1.78 %	0.32	0.51	0.89	1.03 %	-11.15 %	18.00
MIXTA OPTIMA 25 III	3.34 %	4.89 %	1.78 %	0.33	0.54	0.89	1.08 %	-11.11 %	18.00
BVG 25 (2000)	2.33 %	5.16 %	-	0.12	-	-	-	-15.55 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2014 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.71 % (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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	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