

MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	5.89 %	3.06 %	1.37 %	1.36	-1.36	0.80	-0.72 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.95 %	3.06 %	1.37 %	1.38	-1.32	0.80	-0.66 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	7.83 %	4.04 %	-	1.51	-	-	-	-3.62 %	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 30 I	0.19 %	5.78 %	2.03 %	-0.26	0.17	0.77	0.00 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	0.22 %	5.78 %	2.03 %	-0.26	0.19	0.77	0.04 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	-0.28 %	7.42 %	-	-0.27	-	-	-	-16.11 %	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 30 I	2.25 %	6.53 %	1.84 %	0.08	-0.11	0.84	-0.01 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.28 %	6.53 %	1.84 %	0.08	-0.10	0.84	0.01 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	2.37 %	7.59 %	-	0.09	-	-	-	-16.11 %	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 30 I	3.11 %	5.64 %	1.52 %	0.25	-0.42	0.87	-0.35 %	-12.51 %	18.00
MIXTA OPTIMA 30 II	3.13 %	5.64 %	1.52 %	0.25	-0.41	0.87	-0.34 %	-12.49 %	18.00
MO30 Customised	3.72 %	6.27 %	-	0.32	-	-	-	-16.11 %	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