

AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.50 %	11.10 %	8.06 %	0.49	-0.10	0.57	2.29 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.56 %	11.10 %	8.06 %	0.50	-0.09	0.57	2.36 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.61 %	11.10 %	8.06 %	0.50	-0.09	0.57	2.40 %	-7.84 %	7.00
MSCI World ex-CH ndr	5.62 %	17.01 %	-	0.33	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.90 %	8.48 %	7.39 %	0.93	-0.94	0.57	-0.76 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.97 %	8.48 %	7.39 %	0.94	-0.93	0.57	-0.70 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.01 %	8.48 %	7.39 %	0.94	-0.92	0.57	-0.66 %	-7.84 %	7.00
MSCI World ex-CH ndr	15.23 %	11.11 %	-	1.37	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.37 %	11.32 %	7.30 %	0.74	-0.26	0.70	1.46 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.43 %	11.32 %	7.30 %	0.75	-0.25	0.70	1.52 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.47 %	11.32 %	7.30 %	0.75	-0.24	0.70	1.56 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	9.83 %	13.54 %	-	0.73	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.41 %	11.83 %	6.39 %	0.54	-0.54	0.75	-0.84 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.49 %	11.83 %	6.39 %	0.55	-0.53	0.75	-0.76 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.54 %	11.83 %	6.39 %	0.55	-0.53	0.75	-0.71 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.68 %	14.08 %	-	0.69	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.50 %	11.10 %	4.08 %	0.49	2.22	0.90	8.54 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.56 %	11.10 %	4.08 %	0.50	2.23	0.90	8.60 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.61 %	11.10 %	4.09 %	0.50	2.24	0.90	8.64 %	-7.84 %	7.00
MSCI World Min Vol NR	-3.37 %	10.94 %	-	-0.30	-	-	-	-9.90 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.90 %	8.48 %	3.62 %	0.93	1.01	0.93	4.10 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.97 %	8.48 %	3.62 %	0.94	1.02	0.93	4.17 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.01 %	8.48 %	3.62 %	0.94	1.04	0.93	4.21 %	-7.84 %	7.00
MSCI World Min Vol NR	4.08 %	8.25 %	-	0.50	-	-	-	-9.90 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.37 %	11.32 %	3.49 %	0.74	1.22	1.04	4.21 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.43 %	11.32 %	3.49 %	0.75	1.24	1.04	4.28 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.47 %	11.32 %	3.49 %	0.75	1.25	1.04	4.32 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	3.99 %	10.36 %	-	0.39	-	-	-	-11.38 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.41 %	11.83 %	3.81 %	0.54	0.31	1.10	0.59 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.49 %	11.83 %	3.81 %	0.55	0.33	1.10	0.67 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.54 %	11.83 %	3.81 %	0.55	0.34	1.10	0.72 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	5.30 %	10.26 %	-	0.52	-	-	-	-16.95 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 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