

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	8.03 %	13.23 %	7.17 %	0.49	0.59	0.67	5.81 %	-7.85 %	2.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.09 %	13.23 %	7.17 %	0.50	0.60	0.67	5.88 %	-7.84 %	2.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.14 %	13.23 %	7.17 %	0.50	0.61	0.67	5.92 %	-7.84 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	3.00 %	19.32 %	-	0.08	-	-	-	-13.65 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.35 %	11.64 %	7.60 %	0.49	-0.69	0.68	-1.66 %	-9.20 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.41 %	11.64 %	7.60 %	0.49	-0.68	0.68	-1.60 %	-9.15 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.46 %	11.64 %	7.60 %	0.50	-0.68	0.68	-1.55 %	-9.12 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	11.43 %	14.58 %	-	0.74	-	-	-	-13.65 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.39 %	11.83 %	7.39 %	0.65	-0.38	0.70	0.63 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.46 %	11.83 %	7.39 %	0.66	-0.37	0.70	0.69 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.50 %	11.83 %	7.39 %	0.66	-0.37	0.70	0.74 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	10.80 %	14.57 %	-	0.69	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.31 %	12.31 %	6.36 %	0.46	-0.47	0.76	-0.68 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.39 %	12.31 %	6.36 %	0.46	-0.46	0.76	-0.60 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.44 %	12.32 %	6.36 %	0.47	-0.45	0.76	-0.55 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	9.01 %	14.64 %	-	0.57	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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	8.03 %	13.23 %	4.02 %	0.49	1.04	0.91	4.69 %	-7.85 %	2.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.09 %	13.23 %	4.02 %	0.50	1.05	0.91	4.76 %	-7.84 %	2.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.14 %	13.23 %	4.02 %	0.50	1.06	0.91	4.80 %	-7.84 %	2.00
MSCI World Min Vol NR	3.61 %	12.45 %	-	0.19	-	-	-	-9.06 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.35 %	11.64 %	3.76 %	0.49	0.62	1.07	2.11 %	-9.20 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.41 %	11.64 %	3.76 %	0.49	0.63	1.07	2.17 %	-9.15 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.46 %	11.64 %	3.76 %	0.50	0.64	1.07	2.22 %	-9.12 %	5.00
MSCI World Min Vol NR	4.01 %	10.35 %	-	0.32	-	-	-	-9.06 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.39 %	11.83 %	3.49 %	0.65	1.03	1.06	3.41 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.46 %	11.83 %	3.49 %	0.66	1.04	1.06	3.47 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.50 %	11.83 %	3.49 %	0.66	1.06	1.06	3.51 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	4.73 %	10.65 %	-	0.38	-	-	-	-11.38 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.31 %	12.31 %	3.92 %	0.46	0.01	1.10	-0.63 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.39 %	12.31 %	3.92 %	0.46	0.03	1.10	-0.54 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.44 %	12.32 %	3.92 %	0.47	0.05	1.10	-0.50 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	6.38 %	10.68 %	-	0.53	-	-	-	-16.95 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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