

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	16.73 %	8.08 %	7.74 %	2.06	-0.81	0.29	10.22 %	-1.64 %	1.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	16.80 %	8.08 %	7.74 %	2.07	-0.80	0.28	10.29 %	-1.63 %	1.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	16.85 %	8.08 %	7.74 %	2.07	-0.79	0.28	10.34 %	-1.62 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	23.00 %	11.60 %	-	1.97	-	-	-	-2.79 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.66 %	8.46 %	7.17 %	1.38	-0.51	0.58	2.81 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.73 %	8.46 %	7.17 %	1.39	-0.50	0.58	2.88 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.77 %	8.46 %	7.17 %	1.39	-0.50	0.58	2.92 %	-7.84 %	7.00
MSCI World ex-CH ndr	15.34 %	11.34 %	-	1.35	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.06 %	10.53 %	7.45 %	0.67	-0.20	0.65	1.48 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.12 %	10.53 %	7.45 %	0.68	-0.19	0.65	1.55 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.17 %	10.53 %	7.45 %	0.68	-0.19	0.65	1.59 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	8.58 %	13.46 %	-	0.64	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.04 %	11.82 %	6.47 %	0.60	-0.63	0.75	-1.26 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.12 %	11.82 %	6.47 %	0.61	-0.62	0.75	-1.18 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.17 %	11.82 %	6.47 %	0.61	-0.61	0.75	-1.13 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	11.11 %	14.04 %	-	0.79	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (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	16.73 %	8.08 %	4.64 %	2.06	3.08	0.56	15.39 %	-1.64 %	1.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	16.80 %	8.08 %	4.64 %	2.07	3.09	0.56	15.46 %	-1.63 %	1.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	16.85 %	8.08 %	4.64 %	2.07	3.10	0.56	15.51 %	-1.62 %	1.00
MSCI World Min Vol NR	2.44 %	8.14 %	-	0.30	-	-	-	-3.71 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.66 %	8.46 %	3.88 %	1.38	1.73	0.87	7.36 %	-7.85 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.73 %	8.46 %	3.88 %	1.39	1.75	0.87	7.43 %	-7.84 %	7.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.77 %	8.46 %	3.88 %	1.39	1.76	0.87	7.48 %	-7.84 %	7.00
MSCI World Min Vol NR	4.94 %	8.73 %	-	0.57	-	-	-	-10.95 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.06 %	10.53 %	3.89 %	0.67	1.24	1.00	4.83 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.12 %	10.53 %	3.89 %	0.68	1.26	1.00	4.89 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.17 %	10.53 %	3.89 %	0.68	1.27	1.00	4.93 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	2.23 %	9.76 %	-	0.23	-	-	-	-11.38 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	7.04 %	11.82 %	3.96 %	0.60	0.58	1.08	1.91 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.12 %	11.82 %	3.96 %	0.61	0.60	1.08	1.99 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.17 %	11.82 %	3.96 %	0.61	0.61	1.08	2.04 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	4.74 %	10.34 %	-	0.46	-	-	-	-16.95 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (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