

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	11.69 %	10.57 %	6.50 %	0.98	0.90	0.59	8.17 %	-2.17 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.75 %	10.57 %	6.49 %	0.99	0.91	0.59	8.24 %	-2.16 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.80 %	10.57 %	6.50 %	0.99	0.91	0.59	8.28 %	-2.16 %	-
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>5.06 %</i>	<i>14.49 %</i>	-	<i>0.25</i>	-	-	-	<i>-7.76 %</i>	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.47 %	11.51 %	8.19 %	0.36	-0.19	0.65	0.95 %	-10.24 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.53 %	11.51 %	8.19 %	0.37	-0.18	0.65	1.01 %	-10.22 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.57 %	11.51 %	8.19 %	0.37	-0.18	0.65	1.05 %	-10.21 %	18.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>6.30 %</i>	<i>14.98 %</i>	-	<i>0.33</i>	-	-	-	<i>-15.92 %</i>	<i>16.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.23 %	11.80 %	7.45 %	0.84	-0.45	0.69	0.94 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.30 %	11.80 %	7.45 %	0.84	-0.44	0.69	1.01 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.34 %	11.80 %	7.45 %	0.85	-0.44	0.69	1.06 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>14.28 %</i>	<i>14.76 %</i>	-	<i>0.88</i>	-	-	-	<i>-19.42 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.23 %	12.18 %	6.34 %	0.40	-0.42	0.76	-0.59 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.32 %	12.18 %	6.34 %	0.41	-0.41	0.76	-0.51 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.36 %	12.18 %	6.34 %	0.41	-0.40	0.76	-0.46 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>8.58 %</i>	<i>14.44 %</i>	-	<i>0.50</i>	-	-	-	<i>-21.61 %</i>	<i>8.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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	11.69 %	10.57 %	2.80 %	0.98	0.13	0.93	1.14 %	-2.17 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.75 %	10.57 %	2.80 %	0.99	0.16	0.93	1.21 %	-2.16 %	-
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.80 %	10.57 %	2.80 %	0.99	0.17	0.93	1.26 %	-2.16 %	-
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>11.22 %</i>	<i>9.85 %</i>	-	<i>1.01</i>	-	-	-	<i>-2.20 %</i>	<i>1.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.47 %	11.51 %	3.47 %	0.36	0.24	1.11	0.38 %	-10.24 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.53 %	11.51 %	3.47 %	0.37	0.26	1.11	0.44 %	-10.22 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.57 %	11.51 %	3.47 %	0.37	0.27	1.11	0.48 %	-10.21 %	18.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>4.71 %</i>	<i>9.93 %</i>	-	<i>0.34</i>	-	-	-	<i>-9.91 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	11.23 %	11.80 %	3.31 %	0.84	0.92	1.08	2.69 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	11.30 %	11.80 %	3.31 %	0.84	0.94	1.08	2.76 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	11.34 %	11.80 %	3.31 %	0.85	0.96	1.08	2.80 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>8.03 %</i>	<i>10.56 %</i>	-	<i>0.64</i>	-	-	-	<i>-11.38 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.23 %	12.18 %	3.94 %	0.40	-0.07	1.10	-0.98 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	6.32 %	12.18 %	3.94 %	0.41	-0.05	1.10	-0.90 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	6.36 %	12.18 %	3.94 %	0.41	-0.04	1.10	-0.85 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>6.67 %</i>	<i>10.52 %</i>	-	<i>0.51</i>	-	-	-	<i>-16.95 %</i>	<i>15.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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