

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	14.69 %	10.02 %	6.74 %	1.35	-1.01	0.60	0.54 %	-3.01 %	3.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	14.76 %	10.02 %	6.74 %	1.36	-1.00	0.60	0.61 %	-3.01 %	3.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	14.81 %	10.02 %	6.74 %	1.36	-0.99	0.60	0.66 %	-3.00 %	3.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>22.39 %</i>	<i>13.17 %</i>	<i>-</i>	<i>1.57</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-3.36 %</i>	<i>1.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	4.42 %	11.61 %	7.80 %	0.24	-0.23	0.68	0.12 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	4.49 %	11.61 %	7.80 %	0.24	-0.22	0.68	0.18 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	4.53 %	11.61 %	7.80 %	0.25	-0.21	0.68	0.22 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>5.57 %</i>	<i>14.46 %</i>	<i>-</i>	<i>0.27</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-19.42 %</i>	<i>17.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	4.18 %	14.31 %	7.17 %	0.17	-0.75	0.79	-3.67 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	4.24 %	14.31 %	7.17 %	0.18	-0.74	0.79	-3.61 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	4.29 %	14.31 %	7.17 %	0.18	-0.73	0.79	-3.56 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>9.46 %</i>	<i>16.15 %</i>	<i>-</i>	<i>0.48</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.61 %</i>	<i>8.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.36 %	12.50 %	6.15 %	0.30	-0.59	0.77	-1.84 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.45 %	12.50 %	6.15 %	0.30	-0.58	0.77	-1.75 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.50 %	12.50 %	6.15 %	0.31	-0.57	0.77	-1.70 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	<i>8.82 %</i>	<i>14.69 %</i>	<i>-</i>	<i>0.49</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-21.61 %</i>	<i>8.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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	14.69 %	10.02 %	2.18 %	1.35	0.51	1.03	0.86 %	-3.01 %	3.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	14.76 %	10.02 %	2.18 %	1.36	0.54	1.03	0.93 %	-3.01 %	3.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	14.81 %	10.02 %	2.18 %	1.36	0.56	1.03	0.98 %	-3.00 %	3.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>13.46 %</i>	<i>9.17 %</i>	-	<i>1.34</i>	-	-	-	<i>-1.92 %</i>	<i>3.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	4.42 %	11.61 %	3.38 %	0.24	0.56	1.10	1.72 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	4.49 %	11.61 %	3.38 %	0.24	0.57	1.10	1.78 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	4.53 %	11.61 %	3.38 %	0.25	0.59	1.10	1.83 %	-10.43 %	18.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>2.60 %</i>	<i>10.10 %</i>	-	<i>0.09</i>	-	-	-	<i>-11.38 %</i>	<i>18.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	4.18 %	14.31 %	4.30 %	0.17	0.40	1.17	1.31 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	4.24 %	14.31 %	4.30 %	0.18	0.41	1.17	1.38 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	4.29 %	14.31 %	4.30 %	0.18	0.42	1.17	1.42 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>2.69 %</i>	<i>11.77 %</i>	-	<i>0.09</i>	-	-	-	<i>-16.95 %</i>	<i>15.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	5.36 %	12.50 %	4.27 %	0.30	-0.30	1.10	-2.00 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	5.45 %	12.50 %	4.27 %	0.30	-0.28	1.10	-1.91 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	5.50 %	12.50 %	4.27 %	0.31	-0.27	1.10	-1.86 %	-23.95 %	12.00
<i>MSCI World Min Vol NR</i>	<i>6.84 %</i>	<i>10.72 %</i>	-	<i>0.48</i>	-	-	-	<i>-16.95 %</i>	<i>15.00</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2014 bis 30.09.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.65 % (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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	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