

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	7.87 %	11.60 %	7.17 %	0.64	-0.46	0.65	0.67 %	-7.85 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.94 %	11.60 %	7.17 %	0.65	-0.46	0.65	0.74 %	-7.84 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.98 %	11.60 %	7.17 %	0.65	-0.45	0.65	0.78 %	-7.84 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	10.81 %	17.25 %	-	0.60	-	-	-	-13.65 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.72 %	10.67 %	7.29 %	0.78	-0.88	0.68	-1.97 %	-9.20 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.78 %	10.67 %	7.29 %	0.78	-0.87	0.68	-1.90 %	-9.15 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.82 %	10.67 %	7.29 %	0.79	-0.87	0.68	-1.86 %	-9.12 %	5.00
MSCI World ex-CH ndr	15.47 %	12.89 %	-	1.17	-	-	-	-13.65 %	5.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.70 %	11.79 %	7.33 %	0.70	-0.41	0.70	0.59 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.77 %	11.80 %	7.33 %	0.71	-0.40	0.70	0.66 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.81 %	11.80 %	7.33 %	0.71	-0.39	0.70	0.70 %	-10.43 %	18.00
MSCI World ex-CH ndr	11.35 %	14.43 %	-	0.76	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.95 %	12.07 %	6.33 %	0.54	-0.56	0.75	-0.89 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.03 %	12.07 %	6.33 %	0.55	-0.55	0.75	-0.80 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.08 %	12.07 %	6.33 %	0.55	-0.54	0.75	-0.76 %	-23.95 %	12.00
MSCI World ex-CH ndr	10.27 %	14.43 %	-	0.68	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (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	7.87 %	11.60 %	3.87 %	0.64	1.81	0.93	7.17 %	-7.85 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.94 %	11.60 %	3.87 %	0.65	1.83	0.93	7.23 %	-7.84 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.98 %	11.60 %	3.87 %	0.65	1.84	0.93	7.27 %	-7.84 %	5.00
MSCI World Min Vol NR	0.73 %	11.42 %	-	0.03	-	-	-	-9.21 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2024 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.72 %	10.67 %	3.81 %	0.78	0.80	1.05	2.90 %	-9.20 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.78 %	10.67 %	3.81 %	0.78	0.82	1.05	2.96 %	-9.15 %	5.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.82 %	10.67 %	3.81 %	0.79	0.83	1.05	3.01 %	-9.12 %	5.00
MSCI World Min Vol NR	5.55 %	9.50 %	-	0.54	-	-	-	-9.21 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2022 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	8.70 %	11.79 %	3.47 %	0.70	1.17	1.06	3.92 %	-10.49 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	8.77 %	11.80 %	3.47 %	0.71	1.19	1.06	3.98 %	-10.45 %	18.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	8.81 %	11.80 %	3.47 %	0.71	1.20	1.06	4.03 %	-10.43 %	18.00
MSCI World Min Vol NR	4.53 %	10.64 %	-	0.39	-	-	-	-11.38 %	18.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2020 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
AKTIEN GLOBAL LOW VOL I	6.95 %	12.07 %	3.76 %	0.54	0.21	1.10	0.11 %	-23.99 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL II	7.03 %	12.07 %	3.76 %	0.55	0.23	1.10	0.20 %	-23.97 %	12.00
AKTIEN GLOBAL LOW VOL III	7.08 %	12.07 %	3.76 %	0.55	0.24	1.10	0.24 %	-23.95 %	12.00
MSCI World Min Vol NR	6.24 %	10.45 %	-	0.56	-	-	-	-16.95 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2015 bis 30.09.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.38 % (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