

GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	9.69 %	16.12 %	0.13 %	0.54	0.02	1.00	0.03 %	-7.18 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	9.77 %	16.12 %	0.13 %	0.55	0.65	1.00	0.12 %	-7.17 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	9.80 %	16.12 %	0.13 %	0.55	0.82	1.00	0.14 %	-7.16 %	2.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	9.68 %	16.09 %	-	0.54	-	-	-	-7.18 %	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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	14.01 %	14.11 %	0.13 %	0.94	1.77	1.00	0.27 %	-11.93 %	6.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	14.10 %	14.11 %	0.13 %	0.95	2.37	1.00	0.35 %	-11.92 %	6.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	14.13 %	14.11 %	0.13 %	0.95	2.53	1.00	0.38 %	-11.92 %	6.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	13.75 %	14.11 %	-	0.92	-	-	-	-11.97 %	6.00

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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	11.99 %	14.75 %	0.13 %	0.77	1.40	1.00	0.19 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	12.04 %	14.75 %	0.13 %	0.77	1.74	1.00	0.25 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	12.10 %	14.75 %	0.13 %	0.77	2.19	1.00	0.31 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	11.79 %	14.74 %	-	0.75	-	-	-	-23.18 %	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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	8.52 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.21	1.00	0.19 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	8.55 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.36	1.00	0.21 %	-23.13 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	8.62 %	14.33 %	0.14 %	0.55	1.91	1.00	0.29 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	8.34 %	14.34 %	-	0.53	-	-	-	-23.18 %	17.00

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