

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	17.69 %	10.80 %	0.09 %	1.63	1.11	1.00	0.09 %	-6.11 %	1.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	17.81 %	10.81 %	0.09 %	1.64	2.36	1.00	0.21 %	-6.11 %	1.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	17.59 %	10.99 %	-	1.59	-	-	-	-6.16 %	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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	14.89 %	11.62 %	0.13 %	1.28	1.46	1.00	0.19 %	-8.68 %	2.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	15.00 %	11.62 %	0.13 %	1.29	2.33	1.00	0.30 %	-8.66 %	2.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	14.70 %	11.61 %	-	1.27	-	-	-	-8.79 %	2.00

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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	8.81 %	14.11 %	0.13 %	0.63	1.38	1.00	0.17 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	8.91 %	14.11 %	0.13 %	0.63	2.23	1.00	0.27 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	8.63 %	14.09 %	-	0.61	-	-	-	-23.18 %	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
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	10.76 %	14.05 %	0.13 %	0.77	1.38	1.00	0.18 %	-23.14 %	17.00
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	10.87 %	14.05 %	0.13 %	0.78	2.27	1.00	0.29 %	-23.08 %	17.00
MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged	10.58 %	14.05 %	-	0.75	-	-	-	-23.18 %	17.00

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