



GLOBE INDEX HEDGED CHF (GIH)

Indicateurs de risque

| 1 année | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---|----------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 19.05 % | 11.01 % | 0.15 % | 1.58 | 2.85 | 1.00 | 0.42 % | -8.68 % | 2.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 19.14 % | 11.01 % | 0.15 % | 1.59 | 3.40 | 1.00 | 0.51 % | -8.66 % | 2.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 19.17 % | 11.01 % | 0.15 % | 1.59 | 3.54 | 1.00 | 0.54 % | -8.66 % | 2.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>18.56 %</i> | <i>10.95 %</i> | - | <i>1.52</i> | - | - | - | <i>-8.79 %</i> | <i>2.00</i> |

Période d'observation: 01.01.2023 au 31.12.2023 Période de base: mensuel

| 3 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 6.28 % | 15.65 % | 0.14 % | 0.29 | 1.50 | 1.00 | 0.21 % | -23.14 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 6.32 % | 15.66 % | 0.14 % | 0.30 | 1.73 | 1.00 | 0.25 % | -23.13 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 6.39 % | 15.66 % | 0.14 % | 0.30 | 2.22 | 1.00 | 0.32 % | -23.08 % | 15.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>6.07 %</i> | <i>15.62 %</i> | - | <i>0.28</i> | - | - | - | <i>-23.18 %</i> | <i>15.00</i> |

Période d'observation: 01.01.2021 au 31.12.2023 Période de base: mensuel

| 5 années | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---|----------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 10.92 % | 17.14 % | 0.15 % | 0.54 | 1.43 | 1.00 | 0.22 % | -23.14 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 10.94 % | 17.14 % | 0.15 % | 0.54 | 1.56 | 1.00 | 0.25 % | -23.13 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 11.03 % | 17.14 % | 0.15 % | 0.54 | 2.13 | 1.00 | 0.33 % | -23.08 % | 15.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>10.69 %</i> | <i>17.12 %</i> | - | <i>0.52</i> | - | - | - | <i>-23.18 %</i> | <i>15.00</i> |

Période d'observation: 01.01.2019 au 31.12.2023 Période de base: mensuel

| Depuis le lancement | Rdmt | Volatilité | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Coefficient bêta | Alpha de Jensen | Perte max. cumulée | Délai de récupération |
|---|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 7.47 % | 14.93 % | 0.14 % | 0.39 | 1.25 | 1.00 | 0.20 % | -23.14 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 7.49 % | 14.93 % | 0.14 % | 0.39 | 1.33 | 1.00 | 0.21 % | -23.13 % | 15.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 7.57 % | 14.94 % | 0.14 % | 0.39 | 1.93 | 1.00 | 0.30 % | -23.08 % | 15.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>7.28 %</i> | <i>14.94 %</i> | - | <i>0.37</i> | - | - | - | <i>-23.18 %</i> | <i>15.00</i> |

Période d'observation: 01.07.2015 au 31.12.2023 Période de base: mensuel

Taux sans risque: 1.68 % (Libor CHF 3 mois)

Informations fournies sous toutes réserves

| Chiffre-clé | Calcul | Description |
|-----------------------------------|---|--|
| Volatilité | $\sqrt{\text{Variance}}$ | Variation moyenne du rendement absolu par rapport à la valeur moyenne |
| Ratio de Sharpe | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque}}{\text{Volatilité du portefeuille}}$ | Rendement excédentaire absolu par unité de risque global couru |
| Tracking error | Déviation standard (rendement annuel du portefeuille – rendement annuel du benchmark) | Variation moyenne du rendement du portefeuille par rapport au rendement du benchmark (volatilité du rendement relatif = risque actif) Le tracking error indique l'écart par rapport au benchmark en fonction du type de gestion |
| Ratio d'information | $\frac{\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{rendement annuel du benchmark}}{\text{Indice de déviation}}$ | Rendement supérieur ou inférieur au risque actif couru |
| Coefficient bêta | $\frac{\text{Covariance entre le rendement du portefeuille et celui du benchmark}}{\text{Variance du rendement du benchmark}}$ | Risque couru/sensibilité aux changements de prix du marché |
| Alpha de Jensen | $\frac{(\text{Rendement annuel du portefeuille} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}{- \beta \times (\text{rendement annuel du benchmark} - \text{taux d'intérêt annuel d'un placement sans risque})}$ | Surperformance ou sous-performance moyenne corrigée du risque |
| Perte relative maximale (cumulée) | $\frac{\text{Valeur minimale du portefeuille après une chute de cours} - \text{valeur maximale avant la chute}}{\text{Valeur maximale du portefeuille avant la chute de cours}}$ | Perte totale maximale réalisée au cours de la période sous revue indépendamment des fluctuations durant cette période |
| Délai de récupération | Date d'atteinte de la valeur maximale du portefeuille après une chute – date de la valeur minimale du portefeuille après une chute de cours selon la période choisie pour la perte relative maximale | Durée jusqu'au moment où la perte maximale précédente est compensée |
| Duration modifiée | $\frac{\text{Valeur actuelle de l'obligation pondérée en fonction de sa durée résiduelle}}{\text{Valeur actuelle de l'obligation}}$ | Taux de sensibilité aux variations du niveau d'intérêt |