

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 | 17.47 % | 9.55 % | 0.15 % | 1.62 | 2.84 | 1.00 | 0.45 % | -8.68 % | 2.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 17.56 % | 9.55 % | 0.15 % | 1.63 | 3.39 | 1.00 | 0.54 % | -8.66 % | 2.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 17.58 % | 9.55 % | 0.15 % | 1.64 | 3.53 | 1.00 | 0.56 % | -8.66 % | 2.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>16.99 %</i> | <i>9.44 %</i> | <i>-</i> | <i>1.59</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-8.79 %</i> | <i>2.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

| 3 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 5.71 % | 15.86 % | 0.14 % | 0.24 | 1.82 | 1.00 | 0.25 % | -23.14 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 5.76 % | 15.87 % | 0.14 % | 0.24 | 2.14 | 1.00 | 0.30 % | -23.13 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 5.82 % | 15.86 % | 0.14 % | 0.25 | 2.56 | 1.00 | 0.35 % | -23.08 % | 17.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>5.46 %</i> | <i>15.83 %</i> | <i>-</i> | <i>0.22</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-23.18 %</i> | <i>17.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

| 5 Jahre | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---|----------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 10.27 % | 16.70 % | 0.14 % | 0.50 | 1.62 | 1.00 | 0.25 % | -23.14 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 10.31 % | 16.70 % | 0.15 % | 0.50 | 1.80 | 1.00 | 0.28 % | -23.13 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 10.38 % | 16.70 % | 0.14 % | 0.51 | 2.33 | 1.00 | 0.36 % | -23.08 % | 17.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>10.02 %</i> | <i>16.69 %</i> | <i>-</i> | <i>0.48</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-23.18 %</i> | <i>17.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

| Seit Beginn | Return | Volatilität | Tracking Error | Sharpe Ratio | Information Ratio | Beta | Jensen Alpha | Max. kumulierter Verlust | Erholungsdauer |
|---|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------------|----------|--------------|--------------------------|----------------|
| GLOBE INDEX HEDGED CHF II | 8.39 % | 14.70 % | 0.14 % | 0.44 | 1.33 | 1.00 | 0.21 % | -23.14 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF III | 8.41 % | 14.70 % | 0.14 % | 0.44 | 1.43 | 1.00 | 0.22 % | -23.13 % | 17.00 |
| GLOBE INDEX HEDGED CHF G | 8.49 % | 14.70 % | 0.14 % | 0.45 | 2.03 | 1.00 | 0.31 % | -23.08 % | 17.00 |
| <i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i> | <i>8.19 %</i> | <i>14.71 %</i> | <i>-</i> | <i>0.43</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-</i> | <i>-23.18 %</i> | <i>17.00</i> |

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (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 |