

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	-17.23 %	18.81 %	0.16 %	-0.89	0.64	1.00	0.14 %	-23.14 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	-17.22 %	18.81 %	0.16 %	-0.89	0.71	1.00	0.14 %	-23.13 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	-17.14 %	18.82 %	0.16 %	-0.89	1.27	1.00	0.22 %	-23.08 %	-
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>-17.30 %</i>	<i>18.63 %</i>	<i>-</i>	<i>-0.91</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-23.18 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	4.40 %	18.89 %	0.15 %	0.25	1.30	1.00	0.20 %	-23.14 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	4.41 %	18.89 %	0.15 %	0.25	1.32	1.00	0.20 %	-23.13 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	4.51 %	18.89 %	0.15 %	0.25	1.97	1.00	0.30 %	-23.08 %	-
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>4.20 %</i>	<i>18.88 %</i>	<i>-</i>	<i>0.24</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-23.18 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	4.58 %	16.67 %	0.14 %	0.29	1.21	1.00	0.17 %	-23.14 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	4.59 %	16.67 %	0.14 %	0.29	1.23	1.00	0.17 %	-23.13 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	4.69 %	16.67 %	0.14 %	0.30	1.97	1.00	0.27 %	-23.08 %	-
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>4.41 %</i>	<i>16.66 %</i>	<i>-</i>	<i>0.28</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-23.18 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Seit Beginn	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX HEDGED CHF II	5.29 %	14.96 %	0.14 %	0.37	1.05	1.00	0.16 %	-23.14 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF III	5.29 %	14.96 %	0.14 %	0.37	1.06	1.00	0.16 %	-23.13 %	-
GLOBE INDEX HEDGED CHF G	5.39 %	14.96 %	0.14 %	0.38	1.73	1.00	0.26 %	-23.08 %	-
<i>MSCI World ex Switzerland Net Dividends hedged</i>	<i>5.13 %</i>	<i>14.97 %</i>	<i>-</i>	<i>0.36</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-</i>	<i>-23.18 %</i>	<i>-</i>

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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