



GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	13.16 %	11.79 %	0.07 %	0.97	4.43	1.01	0.28 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX II	13.20 %	11.79 %	0.07 %	0.98	5.01	1.01	0.32 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX III	13.29 %	11.79 %	0.07 %	0.98	6.08	1.01	0.41 %	-4.61 %	2.00
GLOBE INDEX G	13.31 %	11.79 %	0.07 %	0.99	6.31	1.01	0.42 %	-4.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	12.82 %	11.95 %	-	0.91	-	-	-	-4.68 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.82 %	14.53 %	0.09 %	0.28	2.14	1.00	0.19 %	-19.38 %	15.00
GLOBE INDEX II	5.86 %	14.53 %	0.09 %	0.29	2.62	1.00	0.23 %	-19.36 %	15.00
GLOBE INDEX III	5.94 %	14.53 %	0.09 %	0.29	3.49	1.00	0.31 %	-19.31 %	15.00
GLOBE INDEX G	5.95 %	14.53 %	0.09 %	0.29	3.69	1.00	0.33 %	-19.30 %	15.00
MSCI World ex-CH ndr	5.62 %	14.52 %	-	0.27	-	-	-	-19.42 %	15.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.57 %	16.71 %	0.09 %	0.47	2.24	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.62 %	16.71 %	0.09 %	0.47	2.79	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.69 %	16.71 %	0.09 %	0.48	3.56	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.72 %	16.71 %	0.09 %	0.48	3.85	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.35 %	16.72 %	-	0.46	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2019 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.31 %	14.46 %	0.08 %	0.46	2.58	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	8.37 %	14.46 %	0.08 %	0.46	3.31	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.44 %	14.46 %	0.08 %	0.46	4.12	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	8.47 %	14.46 %	0.08 %	0.47	4.54	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.09 %	14.46 %	-	0.44	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2014 bis 31.12.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.68 % (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