

## GLOBE INDEX (GI)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	-11.30 %	18.49 %	0.07 %	-0.57	0.54	1.00	0.05 %	-16.52 %	-
GLOBE INDEX II	-11.26 %	18.49 %	0.07 %	-0.57	1.09	1.00	0.09 %	-16.51 %	-
GLOBE INDEX III	-11.20 %	18.49 %	0.07 %	-0.56	2.09	1.00	0.16 %	-16.48 %	-
GLOBE INDEX G	-11.18 %	18.49 %	0.07 %	-0.56	2.33	1.00	0.17 %	-16.47 %	-
MSCI World ex-CH ndr	-11.33 %	18.31 %	-	-0.58	-	-	-	-16.49 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	6.59 %	17.12 %	0.09 %	0.42	1.85	1.00	0.18 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	6.64 %	17.12 %	0.09 %	0.43	2.39	1.00	0.23 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	6.72 %	17.12 %	0.09 %	0.43	3.14	1.00	0.30 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	6.74 %	17.12 %	0.09 %	0.43	3.43	1.00	0.33 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	6.42 %	17.12 %	-	0.41	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	7.90 %	15.68 %	0.09 %	0.55	1.90	1.00	0.18 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	7.95 %	15.69 %	0.09 %	0.55	2.51	1.00	0.24 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.02 %	15.69 %	0.09 %	0.55	3.23	1.00	0.30 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	8.05 %	15.69 %	0.09 %	0.56	3.58	1.00	0.34 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	7.72 %	15.69 %	-	0.54	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2017 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.85 %	13.54 %	0.07 %	0.78	2.10	1.00	0.18 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.92 %	13.54 %	0.07 %	0.78	3.03	1.00	0.25 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.98 %	13.54 %	0.07 %	0.79	3.82	1.00	0.31 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.02 %	13.54 %	0.07 %	0.79	4.31	1.00	0.35 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.68 %	13.55 %	-	0.76	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2012 bis 30.06.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.71 % (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