

## GLOBE INDEX (GI)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	21.39 %	9.82 %	0.11 %	1.98	2.11	1.00	0.25 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX II	21.44 %	9.82 %	0.11 %	1.98	2.50	1.00	0.30 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX III	21.53 %	9.82 %	0.11 %	1.99	3.19	1.00	0.39 %	-4.61 %	2.00
GLOBE INDEX G	21.55 %	9.82 %	0.11 %	1.99	3.33	1.00	0.40 %	-4.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	21.13 %	9.89 %	-	1.94	-	-	-	-4.68 %	2.00

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 I	6.19 %	14.63 %	0.09 %	0.29	1.93	1.00	0.19 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	6.23 %	14.63 %	0.09 %	0.29	2.36	1.00	0.23 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	6.31 %	14.64 %	0.09 %	0.30	3.15	1.00	0.31 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	6.33 %	14.64 %	0.09 %	0.30	3.33	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	6.00 %	14.63 %	-	0.28	-	-	-	-19.42 %	17.00

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 I	10.33 %	16.20 %	0.09 %	0.52	2.15	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.38 %	16.20 %	0.09 %	0.52	2.64	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.46 %	16.20 %	0.09 %	0.53	3.40	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.48 %	16.20 %	0.09 %	0.53	3.64	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	10.11 %	16.21 %	-	0.50	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.64 %	14.68 %	0.08 %	0.52	2.44	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.69 %	14.68 %	0.08 %	0.53	3.10	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.76 %	14.68 %	0.08 %	0.53	3.89	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.80 %	14.68 %	0.08 %	0.54	4.27	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.42 %	14.69 %	-	0.51	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 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