

## GLOBE INDEX (GI)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	7.61 %	14.20 %	0.07 %	0.59	0.60	1.00	0.01 %	-7.09 %	1.00
GLOBE INDEX II	7.65 %	14.20 %	0.07 %	0.59	1.17	1.00	0.05 %	-7.09 %	1.00
GLOBE INDEX III	7.73 %	14.20 %	0.07 %	0.60	2.22	1.00	0.13 %	-7.07 %	1.00
GLOBE INDEX G	7.75 %	14.20 %	0.07 %	0.60	2.47	1.00	0.15 %	-7.07 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	7.57 %	14.20 %	-	0.58	-	-	-	-7.03 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	12.23 %	16.93 %	0.09 %	0.76	1.99	1.00	0.20 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	12.29 %	16.93 %	0.09 %	0.77	2.56	1.00	0.25 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	12.36 %	16.93 %	0.09 %	0.77	3.32	1.00	0.33 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	12.39 %	16.93 %	0.09 %	0.77	3.64	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	12.04 %	16.94 %	-	0.75	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.79 %	14.95 %	0.09 %	0.77	2.11	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.85 %	14.96 %	0.09 %	0.77	2.74	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.91 %	14.96 %	0.09 %	0.78	3.45	1.00	0.33 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.95 %	14.96 %	0.09 %	0.78	3.82	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	10.58 %	14.96 %	-	0.76	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2017 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.32 %	13.15 %	0.08 %	0.92	2.21	1.00	0.20 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	11.40 %	13.15 %	0.07 %	0.92	3.14	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	11.46 %	13.15 %	0.07 %	0.93	3.92	1.00	0.33 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	11.50 %	13.15 %	0.07 %	0.93	4.42	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	11.14 %	13.16 %	-	0.90	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2012 bis 31.03.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.79 % (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