



GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	-7.52 %	19.58 %	0.10 %	-0.42	1.93	1.00	0.18 %	-15.84 %	6.00
GLOBE INDEX II	-7.48 %	19.58 %	0.10 %	-0.42	2.34	1.00	0.22 %	-15.83 %	6.00
GLOBE INDEX III	-7.41 %	19.58 %	0.10 %	-0.42	3.08	1.00	0.29 %	-15.80 %	6.00
GLOBE INDEX G	-7.40 %	19.58 %	0.10 %	-0.41	3.24	1.00	0.30 %	-15.79 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	-7.71 %	19.39 %	-	-0.43	-	-	-	-15.92 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	14.63 %	16.93 %	0.09 %	0.81	2.01	1.00	0.21 %	-19.38 %	6.00
GLOBE INDEX II	14.68 %	16.93 %	0.09 %	0.82	2.49	1.00	0.26 %	-19.36 %	6.00
GLOBE INDEX III	14.76 %	16.93 %	0.09 %	0.82	3.28	1.00	0.34 %	-19.31 %	6.00
GLOBE INDEX G	14.79 %	16.93 %	0.09 %	0.82	3.50	1.00	0.37 %	-19.30 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	14.42 %	16.93 %	-	0.80	-	-	-	-19.42 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	7.21 %	17.29 %	0.09 %	0.37	2.17	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	7.26 %	17.29 %	0.09 %	0.37	2.73	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	7.33 %	17.29 %	0.09 %	0.38	3.48	1.00	0.33 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	7.36 %	17.29 %	0.09 %	0.38	3.78	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	7.00 %	17.30 %	-	0.36	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2018 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.74 %	14.47 %	0.08 %	0.55	2.27	1.00	0.20 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	8.81 %	14.47 %	0.08 %	0.55	3.07	1.00	0.26 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.87 %	14.47 %	0.08 %	0.56	3.85	1.00	0.33 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	8.91 %	14.47 %	0.08 %	0.56	4.29	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.55 %	14.48 %	-	0.53	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2013 bis 31.03.2023 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.77 % (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