

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	-15.23 %	19.49 %	0.09 %	-0.76	0.91	1.00	0.10 %	-19.38 %	-
GLOBE INDEX II	-15.20 %	19.49 %	0.09 %	-0.76	1.33	1.00	0.13 %	-19.36 %	-
GLOBE INDEX III	-15.13 %	19.49 %	0.09 %	-0.76	2.12	1.00	0.20 %	-19.31 %	-
GLOBE INDEX G	-15.12 %	19.49 %	0.09 %	-0.75	2.30	1.00	0.21 %	-19.30 %	-
MSCI World ex-CH ndr	-15.30 %	19.32 %	-	-0.77	-	-	-	-19.42 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	4.39 %	18.30 %	0.09 %	0.25	2.14	1.00	0.20 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	4.44 %	18.30 %	0.09 %	0.26	2.64	1.00	0.25 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	4.51 %	18.30 %	0.09 %	0.26	3.41	1.00	0.32 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	4.53 %	18.30 %	0.09 %	0.26	3.66	1.00	0.35 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	4.18 %	18.30 %	-	0.24	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2019 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.89 %	16.48 %	0.09 %	0.37	1.96	1.00	0.19 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	5.95 %	16.48 %	0.09 %	0.38	2.54	1.00	0.24 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	6.01 %	16.48 %	0.09 %	0.38	3.26	1.00	0.31 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	6.04 %	16.48 %	0.09 %	0.38	3.58	1.00	0.34 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	5.71 %	16.48 %	-	0.36	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2017 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.84 %	14.00 %	0.08 %	0.65	2.23	1.00	0.19 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	8.91 %	14.00 %	0.07 %	0.65	3.10	1.00	0.25 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.97 %	14.01 %	0.07 %	0.66	3.90	1.00	0.32 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.01 %	14.01 %	0.07 %	0.66	4.39	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.66 %	14.01 %	-	0.64	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2012 bis 30.09.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.30 % (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