



GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	28.62 %	14.13 %	0.08 %	1.90	2.11	1.00	0.23 %	-1.90 %	1.00
GLOBE INDEX II	28.67 %	14.13 %	0.09 %	1.90	2.59	1.00	0.28 %	-1.90 %	1.00
GLOBE INDEX III	28.77 %	14.13 %	0.09 %	1.91	3.46	1.00	0.38 %	-1.89 %	1.00
GLOBE INDEX G	28.79 %	14.13 %	0.09 %	1.91	3.63	1.00	0.40 %	-1.89 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	28.39 %	13.61 %	-	1.95	-	-	-	-1.93 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2024 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	6.59 %	14.75 %	0.09 %	0.34	2.06	1.00	0.20 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	6.63 %	14.75 %	0.09 %	0.34	2.49	1.00	0.24 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	6.71 %	14.75 %	0.09 %	0.35	3.28	1.00	0.32 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	6.73 %	14.75 %	0.09 %	0.35	3.45	1.00	0.34 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	6.39 %	14.74 %	-	0.33	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.11 %	16.28 %	0.09 %	0.52	2.23	1.00	0.23 %	-21.38 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.16 %	16.28 %	0.09 %	0.53	2.71	1.00	0.27 %	-21.37 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.24 %	16.29 %	0.09 %	0.53	3.50	1.00	0.35 %	-21.36 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.26 %	16.29 %	0.09 %	0.53	3.72	1.00	0.37 %	-21.35 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.89 %	16.29 %	-	0.51	-	-	-	-21.42 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.28 %	14.79 %	0.08 %	0.52	2.48	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.33 %	14.79 %	0.08 %	0.52	3.13	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.40 %	14.79 %	0.08 %	0.53	3.93	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.44 %	14.79 %	0.08 %	0.53	4.29	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.06 %	14.80 %	-	0.51	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2015 bis 31.12.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.55 % (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