

GLOBE INDEX (GI)
Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.76 %	16.39 %	0.12 %	0.35	1.17	1.00	0.15 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	5.81 %	16.38 %	0.04 %	0.35	4.39	1.00	0.19 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	5.88 %	16.39 %	0.04 %	0.36	6.26	1.00	0.26 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	5.90 %	16.39 %	0.04 %	0.36	6.66	1.00	0.28 %	-13.60 %	6.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	5.62 %	17.01 %	-	0.33	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2025 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	15.46 %	11.12 %	0.09 %	1.39	2.23	1.00	0.22 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	15.51 %	11.13 %	0.07 %	1.39	3.63	1.00	0.26 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	15.60 %	11.13 %	0.07 %	1.40	4.71	1.00	0.34 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	15.61 %	11.13 %	0.07 %	1.40	4.93	1.00	0.36 %	-13.60 %	6.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	15.23 %	11.11 %	-	1.37	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2023 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.02 %	13.54 %	0.09 %	0.74	1.90	1.00	0.19 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	10.06 %	13.55 %	0.08 %	0.74	2.77	1.00	0.23 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	10.14 %	13.55 %	0.08 %	0.75	3.73	1.00	0.31 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	10.16 %	13.55 %	0.08 %	0.75	3.94	1.00	0.33 %	-19.30 %	17.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	9.83 %	13.54 %	-	0.73	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2021 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.89 %	14.08 %	0.09 %	0.70	2.21	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.94 %	14.08 %	0.08 %	0.71	3.03	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.01 %	14.08 %	0.08 %	0.71	3.86	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.04 %	14.08 %	0.08 %	0.71	4.19	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
<i>MSCI World ex-CH ndr</i>	9.68 %	14.08 %	-	0.69	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2016 bis 31.12.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.04 % (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