

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	3.18 %	19.31 %	0.04 %	0.09	3.89	1.00	0.17 %	-13.62 %	2.00
GLOBE INDEX II	3.22 %	19.31 %	0.04 %	0.09	4.79	1.00	0.22 %	-13.61 %	2.00
GLOBE INDEX III	3.30 %	19.31 %	0.05 %	0.09	6.41	1.00	0.29 %	-13.60 %	2.00
GLOBE INDEX G	3.31 %	19.31 %	0.04 %	0.09	6.77	1.00	0.31 %	-13.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	3.00 %	19.32 %	-	0.08	-	-	-	-13.65 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2024 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.68 %	14.57 %	0.08 %	0.75	2.69	1.00	0.25 %	-13.62 %	2.00
GLOBE INDEX II	11.72 %	14.57 %	0.08 %	0.76	3.19	1.00	0.30 %	-13.61 %	2.00
GLOBE INDEX III	11.80 %	14.57 %	0.08 %	0.76	4.08	1.00	0.38 %	-13.60 %	2.00
GLOBE INDEX G	11.82 %	14.57 %	0.08 %	0.76	4.27	1.00	0.39 %	-13.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	11.43 %	14.58 %	-	0.74	-	-	-	-13.65 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2022 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.01 %	14.58 %	0.08 %	0.71	2.42	1.00	0.21 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	11.06 %	14.58 %	0.08 %	0.71	2.93	1.00	0.25 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	11.14 %	14.58 %	0.08 %	0.72	3.85	1.00	0.33 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	11.16 %	14.58 %	0.08 %	0.72	4.06	1.00	0.35 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	10.80 %	14.57 %	-	0.69	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2020 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.22 %	14.64 %	0.08 %	0.58	2.42	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.27 %	14.64 %	0.08 %	0.59	3.05	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.34 %	14.64 %	0.08 %	0.59	3.87	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.37 %	14.64 %	0.08 %	0.59	4.21	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.01 %	14.64 %	-	0.57	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2015 bis 30.06.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.65 % (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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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