GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	23.19 %	11.30 %	0.13 %	2.04	1.23	1.00	0.22 %	-2.77 %	1.00
GLOBE INDEX II	23.24 %	11.30 %	0.06 %	2.04	3.49	1.00	0.21 %	-2.75 %	1.00
GLOBE INDEX III	23.33 %	11.31 %	0.06 %	2.05	4.85	1.00	0.30 %	-2.73 %	1.00
GLOBE INDEX G	23.35 %	11.31 %	0.06 %	2.05	5.13	1.00	0.31 %	-2.72 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	*23.00 %*	*11.60 %*	-	*1.97*	-	-	-	*-2.79 %*	*1.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2025 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	15.55 %	11.35 %	0.10 %	1.37	1.92	1.00	0.20 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	15.60 %	11.35 %	0.07 %	1.37	3.12	1.00	0.24 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	15.69 %	11.35 %	0.07 %	1.38	4.15	1.00	0.32 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	15.70 %	11.35 %	0.07 %	1.38	4.36	1.00	0.34 %	-13.60 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	*15.34 %*	*11.34 %*	-	*1.35*	-	-	-	*-13.65 %*	*6.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.76 %	13.46 %	0.09 %	0.65	1.88	1.00	0.18 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	8.81 %	13.46 %	0.08 %	0.66	2.74	1.00	0.23 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	8.89 %	13.47 %	0.08 %	0.66	3.69	1.00	0.30 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	8.90 %	13.47 %	0.08 %	0.66	3.89	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	*8.58 %*	*13.46 %*	-	*0.64*	-	-	-	*-19.42 %*	*17.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.32 %	14.04 %	0.09 %	0.81	2.13	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	11.38 %	14.04 %	0.08 %	0.81	2.92	1.00	0.26 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	11.45 %	14.04 %	0.08 %	0.82	3.75	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	11.48 %	14.04 %	0.08 %	0.82	4.06	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	*11.11 %*	*14.04 %*	-	*0.79*	-	-	-	*-21.61 %*	*8.00*

Beobachtungszeitraum: 01.07.2016 bis 30.06.2026 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: -0.06 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	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	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\ \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a. – risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch – Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Porfoliowert – Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus