

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.26 %	15.00 %	0.04 %	0.26	4.57	1.00	0.20 %	-7.72 %	-
GLOBE INDEX II	5.30 %	15.00 %	0.04 %	0.27	5.52	1.00	0.25 %	-7.71 %	-
GLOBE INDEX III	5.38 %	15.00 %	0.04 %	0.27	7.24	1.00	0.32 %	-7.70 %	-
GLOBE INDEX G	5.40 %	15.00 %	0.04 %	0.27	7.60	1.00	0.34 %	-7.70 %	-
MSCI World ex-CH ndr	5.06 %	14.49 %	-	0.25	-	-	-	-7.76 %	-

Beobachtungszeitraum: 01.04.2024 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	6.53 %	14.98 %	0.09 %	0.35	2.59	1.00	0.24 %	-15.84 %	16.00
GLOBE INDEX II	6.57 %	14.98 %	0.09 %	0.35	3.07	1.00	0.28 %	-15.83 %	16.00
GLOBE INDEX III	6.65 %	14.98 %	0.09 %	0.36	3.94	1.00	0.36 %	-15.80 %	16.00
GLOBE INDEX G	6.67 %	14.98 %	0.09 %	0.36	4.12	1.00	0.37 %	-15.79 %	16.00
MSCI World ex-CH ndr	6.30 %	14.98 %	-	0.33	-	-	-	-15.92 %	16.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2022 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	14.51 %	14.76 %	0.09 %	0.89	2.37	1.00	0.23 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	14.56 %	14.76 %	0.09 %	0.90	2.86	1.00	0.28 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	14.64 %	14.76 %	0.09 %	0.90	3.72	1.00	0.36 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	14.66 %	14.76 %	0.09 %	0.90	3.93	1.00	0.38 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	14.28 %	14.76 %	-	0.88	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2020 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.79 %	14.43 %	0.08 %	0.52	2.48	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	8.85 %	14.44 %	0.08 %	0.52	3.11	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	8.92 %	14.44 %	0.08 %	0.53	3.92	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	8.95 %	14.44 %	0.08 %	0.53	4.27	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	8.58 %	14.44 %	-	0.50	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2015 bis 31.03.2025 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.29 % (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