

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	24.20 %	10.40 %	0.10 %	2.15	2.65	1.00	0.29 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX II	24.25 %	10.40 %	0.10 %	2.16	3.04	1.00	0.34 %	-4.63 %	2.00
GLOBE INDEX III	24.34 %	10.40 %	0.10 %	2.17	3.76	1.00	0.43 %	-4.61 %	2.00
GLOBE INDEX G	24.36 %	10.40 %	0.10 %	2.17	3.90	1.00	0.45 %	-4.60 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	23.87 %	10.60 %	-	2.08	-	-	-	-4.68 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	7.32 %	14.67 %	0.09 %	0.38	1.80	1.00	0.18 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	7.36 %	14.67 %	0.09 %	0.38	2.23	1.00	0.22 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	7.44 %	14.67 %	0.09 %	0.39	3.02	1.00	0.30 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	7.46 %	14.67 %	0.09 %	0.39	3.19	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	7.14 %	14.66 %	-	0.37	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.18 %	16.73 %	0.09 %	0.50	2.14	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.23 %	16.73 %	0.09 %	0.51	2.65	1.00	0.27 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.31 %	16.73 %	0.09 %	0.51	3.40	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.33 %	16.73 %	0.09 %	0.51	3.65	1.00	0.37 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.96 %	16.73 %	-	0.49	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2019 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.95 %	14.66 %	0.08 %	0.56	2.46	1.00	0.22 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.01 %	14.66 %	0.08 %	0.56	3.15	1.00	0.28 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.08 %	14.67 %	0.08 %	0.57	3.93	1.00	0.35 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.12 %	14.67 %	0.08 %	0.57	4.32	1.00	0.38 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.74 %	14.67 %	-	0.54	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2014 bis 31.03.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.71 % (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