

## GLOBE INDEX (GI)

### Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	8.21 %	16.43 %	0.12 %	0.50	0.92	1.00	0.12 %	-6.40 %	2.00
GLOBE INDEX II	8.25 %	16.43 %	0.05 %	0.50	2.88	1.00	0.15 %	-6.39 %	2.00
GLOBE INDEX III	8.33 %	16.44 %	0.05 %	0.50	4.24	1.00	0.23 %	-6.39 %	2.00
GLOBE INDEX G	8.35 %	16.44 %	0.05 %	0.51	4.54	1.00	0.25 %	-6.39 %	2.00
MSCI World ex-CH ndr	8.08 %	17.06 %	-	0.47	-	-	-	-6.39 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2025 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	12.26 %	10.86 %	0.10 %	1.13	2.02	1.00	0.20 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	12.30 %	10.86 %	0.07 %	1.13	3.26	1.00	0.24 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	12.38 %	10.86 %	0.07 %	1.14	4.29	1.00	0.32 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	12.40 %	10.86 %	0.07 %	1.14	4.49	1.00	0.34 %	-13.60 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	12.04 %	10.85 %	-	1.11	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2023 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	7.08 %	13.16 %	0.09 %	0.54	1.77	1.00	0.17 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	7.12 %	13.16 %	0.08 %	0.54	2.59	1.00	0.21 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	7.20 %	13.16 %	0.08 %	0.55	3.54	1.00	0.29 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	7.22 %	13.16 %	0.08 %	0.55	3.74	1.00	0.31 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	6.91 %	13.15 %	-	0.53	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2021 bis 31.03.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	10.15 %	13.96 %	0.09 %	0.73	2.17	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	10.20 %	13.97 %	0.08 %	0.73	2.97	1.00	0.26 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	10.27 %	13.97 %	0.08 %	0.74	3.79	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	10.30 %	13.97 %	0.08 %	0.74	4.11	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.94 %	13.97 %	-	0.71	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.04.2016 bis 31.03.2026 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