



## GLOBE INDEX (GI)

## Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	-16.79 %	20.56 %	0.12 %	-0.82	0.81	1.00	0.07 %	-19.38 %	3.00
GLOBE INDEX II	-16.76 %	20.56 %	0.12 %	-0.82	1.15	1.00	0.10 %	-19.36 %	3.00
GLOBE INDEX III	-16.70 %	20.56 %	0.12 %	-0.82	1.77	1.00	0.17 %	-19.31 %	3.00
GLOBE INDEX G	-16.68 %	20.56 %	0.12 %	-0.82	1.90	1.00	0.18 %	-19.30 %	3.00
MSCI World ex-CH ndr	-16.87 %	20.39 %	-	-0.83	-	-	-	-19.42 %	3.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2022 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	3.61 %	19.36 %	0.10 %	0.18	1.79	1.00	0.19 %	-21.38 %	8.00
GLOBE INDEX II	3.66 %	19.36 %	0.10 %	0.18	2.24	1.00	0.24 %	-21.37 %	8.00
GLOBE INDEX III	3.73 %	19.37 %	0.10 %	0.18	2.96	1.00	0.31 %	-21.36 %	8.00
GLOBE INDEX G	3.75 %	19.37 %	0.10 %	0.18	3.18	1.00	0.33 %	-21.35 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	3.42 %	19.38 %	-	0.17	-	-	-	-21.42 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2020 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	5.25 %	17.15 %	0.09 %	0.29	1.87	1.00	0.19 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	5.30 %	17.15 %	0.09 %	0.30	2.41	1.00	0.24 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	5.37 %	17.16 %	0.09 %	0.30	3.10	1.00	0.31 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	5.40 %	17.16 %	0.09 %	0.30	3.40	1.00	0.34 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	5.06 %	17.16 %	-	0.28	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2018 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.22 %	14.45 %	0.08 %	0.62	2.14	1.00	0.19 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	9.29 %	14.45 %	0.08 %	0.63	2.96	1.00	0.26 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	9.35 %	14.45 %	0.08 %	0.63	3.73	1.00	0.32 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	9.39 %	14.45 %	0.08 %	0.63	4.19	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	9.04 %	14.46 %	-	0.61	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.01.2013 bis 31.12.2022 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 0.20 % (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