

GLOBE INDEX (GI)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	21.20 %	11.60 %	0.12 %	1.82	1.22	1.00	0.22 %	-2.77 %	1.00
GLOBE INDEX II	21.25 %	11.60 %	0.05 %	1.82	3.59	1.00	0.21 %	-2.75 %	1.00
GLOBE INDEX III	21.34 %	11.61 %	0.05 %	1.83	5.03	1.00	0.30 %	-2.73 %	1.00
GLOBE INDEX G	21.36 %	11.61 %	0.05 %	1.83	5.32	1.00	0.32 %	-2.72 %	1.00
MSCI World ex-CH ndr	21.02 %	11.63 %	-	1.80	-	-	-	-2.79 %	1.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2025 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	18.16 %	11.24 %	0.09 %	1.61	1.82	1.00	0.19 %	-13.62 %	6.00
GLOBE INDEX II	18.21 %	11.24 %	0.07 %	1.61	3.03	1.00	0.22 %	-13.61 %	6.00
GLOBE INDEX III	18.29 %	11.24 %	0.07 %	1.62	4.09	1.00	0.31 %	-13.60 %	6.00
GLOBE INDEX G	18.31 %	11.24 %	0.07 %	1.62	4.30	1.00	0.33 %	-13.60 %	6.00
MSCI World ex-CH ndr	17.96 %	11.23 %	-	1.59	-	-	-	-13.65 %	6.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2023 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	9.74 %	13.36 %	0.09 %	0.73	1.85	1.00	0.18 %	-19.38 %	17.00
GLOBE INDEX II	9.78 %	13.36 %	0.08 %	0.73	2.70	1.00	0.22 %	-19.36 %	17.00
GLOBE INDEX III	9.86 %	13.36 %	0.08 %	0.74	3.65	1.00	0.30 %	-19.31 %	17.00
GLOBE INDEX G	9.88 %	13.36 %	0.08 %	0.74	3.85	1.00	0.32 %	-19.30 %	17.00
MSCI World ex-CH ndr	9.55 %	13.35 %	-	0.72	-	-	-	-19.42 %	17.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2021 bis 30.09.2026 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
GLOBE INDEX I	11.45 %	14.02 %	0.09 %	0.82	2.16	1.00	0.21 %	-21.54 %	8.00
GLOBE INDEX II	11.50 %	14.02 %	0.08 %	0.82	2.95	1.00	0.26 %	-21.53 %	8.00
GLOBE INDEX III	11.58 %	14.02 %	0.08 %	0.83	3.80	1.00	0.34 %	-21.51 %	8.00
GLOBE INDEX G	11.61 %	14.02 %	0.08 %	0.83	4.10	1.00	0.36 %	-21.50 %	8.00
MSCI World ex-CH ndr	11.24 %	14.02 %	-	0.80	-	-	-	-21.61 %	8.00

Beobachtungszeitraum: 01.10.2016 bis 30.09.2026 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	$\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.} - \beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})$	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