

AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX (ASI)

1. ZIEL UND BENCHMARK

- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX** ist eine voll indexierte, passiv bewirtschaftete Anlagegruppe, mit dem Ziel, die Benchmark mit einem minimalen Abweichungsfehler nachzubilden.
- Die Anlagegruppe wird nach der „full replication“-Methode bewirtschaftet.
- Benchmark und Anlageuniversum ist der Swiss Market Index reinvestiert (SMIC).

2. ANLAGERICHTLINIEN

- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX** investiert ausschliesslich in Aktien von Unternehmen, die Mitglied des Swiss Market Indexes (SMI) sind.
- Die Anlagen erfolgen in börsenkotierten Aktien.
- Die maximale Gewichtung pro Unternehmen beträgt 5%. Diese Limite darf um 5%-Punkte überschritten werden, wenn die Gewichtung eines Unternehmens in der Benchmark höher ist. Die maximale Gewichtung eines Unternehmens darf 20% nicht überschreiten.
- Der Einsatz von Futures, deren unterliegender Kontraktwert höchstens 5% des Portfoliowertes betragen darf, ist zur Replikation ebenfalls zugelassen. Diese müssen einen regelmässigen Handel aufweisen und an einer Börse kotiert sein.
- Der mittlere jährliche ex-ante Tracking Error zwischen Portfolio und Referenzindex soll 0.15% nicht übersteigen.
- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEX** ist grundsätzlich voll investiert.
- Portfolioanpassungen aufgrund von Nettogeldzuflüssen erfolgen – sofern die Liquidität der entsprechenden Titel dies erlaubt – unmittelbar.
- Rechnungseinheit der Anlagegruppe ist der Schweizer Franken.

Stand: 31.07.2019