

GELDMARKT CHF (GM)

1. ZIEL UND BENCHMARK

- **GELDMARKT CHF** ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe mit Anlagen in Schweizer Franken von in- und ausländischen Schuldnern.
- Die Anlagegruppe strebt die Erzielung einer den Geldmarktsätzen entsprechenden Rendite an.
- Als Benchmark gilt der FTSE 3m CHF Eurodeposit Index.

2. ANLAGERICHTLINIEN

- **GELDMARKT CHF** investiert in auf Schweizer Franken lautende Geldmarktanlagen und Obligationen mit einer Restlaufzeit von 2 Jahren von öffentlich-rechtlichen und privaten Schuldern aus dem In- und Ausland.
- Die Anlagen müssen in Titeln erfolgen, für die ein liquider Markt besteht.
- Es können Festgelder und Kontoguthaben in Schweizer Franken bei erstklassigen Banken in der Schweiz unterhalten werden.
- Die Forderungen pro Schuldner dürfen höchstens 10% der Anlagegruppe betragen. Davon ausgenommen sind Anleihen der Eidgenossenschaft und der schweizerischen Pfandbriefinstitute.
- Die maximale Restlaufzeit der Anlagen darf 2 Jahre nicht übersteigen.
- Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit der Anlagegruppe darf 12 Monate nicht übersteigen.
- Die Anlagegruppe muss gut diversifiziert sein. Sie muss mindestens 40 Schuldner aufweisen.
- Die Anlagen müssen ein Mindestrating von P-2 gemäss Moody's oder ein vergleichbares Rating einer anderen Ratingagentur aufweisen.
- Die Anlagegruppe kann bis zu 100% in einer Kollektivanlage investieren sofern diese von der FINMA beaufsichtigt ist, oder von einer ausländischen Aufsichtsbehörde zugelassen ist, mit welcher die FINMA eine Vereinbarung nach Artikel 120 Absatz 2 Buchstabe e des Kollektivanlagengesetzes vom 23. Juni 2006 abgeschlossen hat.
- Die Anlagegruppe ist grundsätzlich voll investiert.

- Zur Umsetzung der Anlagepolitik können standardisierte und nicht standardisierte derivative Finanzinstrumente eingesetzt werden. Diese Geschäfte können an einer Börse, an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt oder auch direkt mit einem auf solche Geschäftsarten spezialisierten Bank- oder Finanzinstitut als Gegenpartei (OTC) abgeschlossen werden.
- Es sind keine Leerverkäufe und/oder Leverage zugelassen.

Stand: 31.07.2019