

GLOBE INDEX SRI (GISRI)

1. ZIEL UND BENCHMARK

- **GLOBE INDEX SRI** ist eine voll indexierte, passiv bewirtschaftete Anlagegruppe mit dem Ziel, die Benchmark mit einem minimalen Abweichungsfehler nachzubilden. Der angestrebte mittlere jährliche ex-ante Tracking Error zwischen Portfolio und Referenzindex soll 0.15% nicht übersteigen.
- Die Anlagegruppe wird nach der „quasi-full replication“-Methode bewirtschaftet. Der unter dieser Methode verwendete Algorithmus minimiert effizient die maximalen absoluten Gewichtsabweichungen zwischen dem Portfolio und der Benchmark auf Länder-, Branchen- und Aktienebene. Ziel ist dabei, teure und zu kleine Transaktionen und/oder Transaktionen in illiquiden Titeln zu vermeiden.
- Benchmark und Anlageuniversum sind der Morgan Stanley Capital International World ex Switzerland SRI net dividend reinvested in CHF (MSCI World ex Switzerland SRI).

2. ANLAGERICHTLINIEN

- **GLOBE INDEX SRI** investiert ausschliesslich in Aktien von ausländischen Unternehmen, deren Papiere an den Finanzplätzen der entsprechenden MSCI World-Länder gehandelt werden und die im MSCI World ex-Switzerland SRI-Index enthalten sind. Davon ausgenommen sind Unternehmen, die auf der SVVK-Ausschlussliste figurieren, sowie Unternehmen, die mehr als 25% ihres Umsatzes mit thermischer Kohle erzielen.
- Die Anlagen erfolgen in börsenkotierten Aktien. Es sind sowohl Direktanlagen als auch Anlagen in Kollektivanlagen zugelassen. Grundsätzlich kann die Anlagegruppe 100% in Kollektivanlagen investieren.
- 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.
- 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.
- **GLOBE INDEX SRI** 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: 28.02.2021