

GLOBE INDEX SRI (GISRI)

1. OBJECTIF ET INDICE DE REFERENCE

- **GLOBE INDEX SRI** est un groupe de placements entièrement indexé et géré passivement dont l'objectif est de reproduire l'indice de référence avec une marge d'erreur minimale. La marge d'erreur annuelle ex ante entre le portefeuille et l'indice de référence ne dépasse pas 0.15%.
- Le groupe de placements est géré selon la méthode de réplique quasi complète. L'algorithme utilisé minimise efficacement les écarts de pondération absolus maximums entre le portefeuille et l'indice de référence au niveau des pays, des secteurs et des actions. L'objectif est d'éviter les transactions coûteuses et trop petites et/ou les transactions sur titres illiquides.
- L'univers de placement, respectivement l'indice de référence est le Morgan Stanley Capital International World ex Switzerland SRI net dividend reinvested en CHF (MSCI World ex Switzerland SRI).

2. DIRECTIVES DE PLACEMENT

- **GLOBE INDEX SRI** investit exclusivement dans des actions d'entreprises étrangères, dont les titres sont cotés dans les pays faisant partie de l'univers de l'indice MSCI World ex Switzerland SRI et qui figurent dans cet indice. Sont exclues de l'univers de placement les sociétés figurant sur la liste d'exclusions de l'ASIR ainsi que celles qui génèrent plus de 25% de leur chiffre d'affaires dans l'extraction de charbon et la production d'électricité à partir du charbon.
- Les investissements sont effectués dans des actions cotées en bourse. Sont autorisés les investissements directs et ceux effectués dans des véhicules collectifs. En principe, le groupe de placements peut investir 100% dans des véhicules collectifs.
- La pondération maximale par société est de 5%. Cette limite peut être dépassée de 5% si la pondération d'une entreprise dans l'indice de référence est plus élevée.
- Le recours à des futures – dont la valeur du contrat sous-jacent ne doit pas représenter plus de 5% de la valeur du portefeuille – est aussi autorisé dans le but de répliquer l'indice. Ces futures doivent être négociés régulièrement et cotés en bourse.
- Le groupe de placements **GLOBE INDEX SRI** est en principe entièrement investi.

- L'argent frais qui afflue dans le portefeuille est investi immédiatement pour autant que la liquidité des titres soit suffisante.
- L'unité de calcul du groupe de placements est le franc suisse.

Situation au 28.02.2021