

## OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

### 1. ZIEL UND BENCHMARK

- **OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX** ist eine passiv verwaltete Anlagegruppe mit Anleihen in Schweizer Franken von Schuldnern mit Domizil in der Schweiz und im Fürstentum Liechtenstein.
- Ziel ist, die Benchmark mit einer möglichst kleinen Abweichung mittels des Stratified-Sampling-Ansatzes abzubilden.
- Als Benchmark gilt der Swiss Bond Domestic Total Return Index AAA-BBB (SBD14T).

### 2. ANLAGERICHTLINIEN

- **OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX** investiert in auf Schweizer Franken lautende Obligationen und Schuldverschreibungen von öffentlich-rechtlichen und privaten Schuldnern mit Domizil in der Schweiz oder im Fürstentum Liechtenstein.
- Die Anlagen müssen in Titeln erfolgen, für die ein liquider Markt besteht.
- Die Forderungen pro Schuldner dürfen höchstens 10% der Anlagegruppe betragen. Davon ausgenommen sind Anleihen der Eidgenossenschaft und der schweizerischen Pfandbriefinstitute.
- Alternative Forderungen dürfen gehalten werden sofern sie Bestandteil der Benchmark sind. Ihre gesamte Gewichtung darf die Benchmarkgewichtung um maximal 5%-Punkte übersteigen. Der maximal zugelassene ex-ante Tracking-Error beträgt 0.25%.
- Zur Liquiditätshaltung können Festgelder, Geldmarktanlagen und Kontoguthaben in Schweizer Franken bei erstklassigen Banken in der Schweiz unterhalten werden.
- 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