

AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEXIERT (ASI)

1. ZIEL UND BENCHMARK

- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEXIERT** ist eine voll indexierte, passiv bewirtschaftete Anlagegruppe, mit dem Ziel, die Benchmark mit einem minimalen Abweichungsfehler nachzubilden.
- Benchmark und Anlageuniversum ist der Swiss Market Index reinvestiert (SMIC).

2. ANLAGERICHTLINIEN

- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEXIERT** investiert ausschliesslich in Aktien von Unternehmen, die Mitglied des Swiss Market Indexes (SMI) sind.
- Die Anlagen erfolgen in börsenkotierten Instrumenten. Grundsätzlich werden Direktanlagen getätigt. Zwecks Aufwandminimierung können auch Körbe von Wertpapieren gekauft werden. 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 Hauptbörse kotiert sein.
- Der mittlere jährliche ex-ante Tracking Error zwischen Portfoliowert und Referenzindex soll 0.15% nicht übersteigen.
- **AKTIEN SCHWEIZ SMI INDEXIERT** 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: 30.11.2013