

## AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

### 1. ZIEL UND BENCHMARK

- **AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS** ist eine aktiv, nach einem quantitativen Modellansatz bewirtschaftete Anlagegruppe, die zum Ziel hat, die Benchmark leicht zu übertreffen.
- Benchmark und Anlageuniversum ist der Swiss Performance Index (SPI).

### 2. ANLAGERICHTLINIEN

- **AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS** investiert ausschliesslich in Aktien von Unternehmen, die Mitglied des Swiss Performance Indexes (SPI) sind.
- Die Anlagen erfolgen in börsenkotierten Instrumenten. Grundsätzlich werden Direktanlagen getätigt.
- Der angestrebte mittlere jährliche ex-ante Tracking Error zum Referenzindex soll zwischen 0.5-1.5% liegen.
- Die Beteiligung pro Unternehmen ist auf 5% des Vermögens der Anlagegruppe respektive auf eine Übergewichtung von maximal 2% im Vergleich zur Benchmark beschränkt.
- Die Anlagegruppe ist in mindestens 40 Unternehmen investiert.
- Der Einsatz von Futures (SMI, SMIM) ist erlaubt. Er darf maximal 10% des Gesamtwerts der Anlagegruppe betragen und muss durch eine entsprechende Cashposition gedeckt sein (kein Leverage).
- **AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS** 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: 30.07.2014