Lyxor SPI® UCITS ETF

Ticker: CBSPI SW

1. FONDSINFORMATIONEN

Anlageziel

Der Lyxor SPI® UCITS ETF ist ein OGAW-konformer börsengehandelter Fonds mit dem Ziel, den Referenzindex SWISS EXCHANGE SWISS PERFORMANCE INDEX.
Der SPI® TR Index (Swiss Performance Index) misst die Entwicklung des gesamten Schweizer Aktienmarktes. Er umfasst alle Aktientitel von Unternehmen mit juristischem Gesellschaftssitz in der Schweiz, die an der SIX Swiss Exchange primärkotiert sind, es sei denn, die Aktien verfügen über einen frei handelbaren Anteil von weniger als 20%. Der SPI® wurde zum 1. Juni 1987 erstmals mit 1.000 Punkten normiert.

Handelsinformationen

Handelsplatz	Öffnungs-zeiten (GMT)	Währung	Bloomberg Ticker	Aus-schüttend
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	CHF	CBSPI SW	Ja
Deutsche Boerse (Xetra)*	08:00 / 19:00	EUR	C029 GY	Ja

* Handelsplatz der Erstzulassung dieser Anteilsklasse

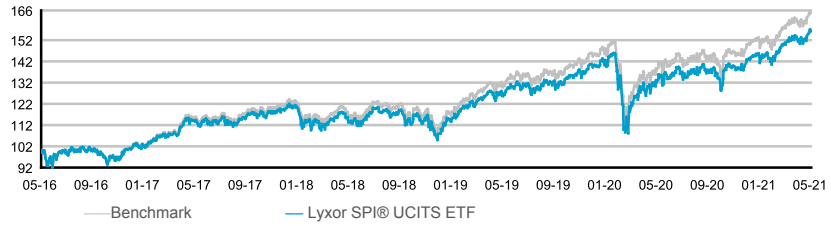
Hauptmerkmale des Fonds

Ticker	CBSPI SW
Rechtsform	SICAV
Domizilierung	Luxemburg
UCITS-Konform	Ja
ISIN	LU0603946798
Schweizer Steuer	Ja
Replikationsmethode	Indirekt (Swap-basiert)
Wertpapierleihe	Nein
Voller Besitz der Vermögenswerte	Ja
Währung der Anteilsklasse	CHF
Auflagedatum	10/05/2011
Nettoinventarwert pro Anteil zum Zeitpunkt der Auflage (CHF)	60.2184
Gesamtkostenquote (TER)	0,40%
Fremdwährungsrisiko	Nein
Nettoinventarwert pro Anteil (CHF)	123.39
AuM der Anteilsklasse (Mio CHF)	19.27
Gesamtfondsvermögen (Mio CHF)	19.27
Umbrella-Fonds (Mio CHF)	3'640.55
Mindestanlagebetrag (Anteil)	1
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Letzte Ausschüttung (CHF)	2.15

Quelle: Lyxor AM, 31 Mai 2021

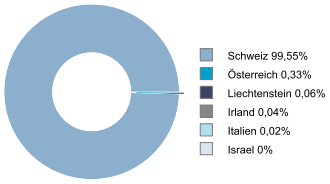
2. Indexinformationen

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 31 Mai 2021

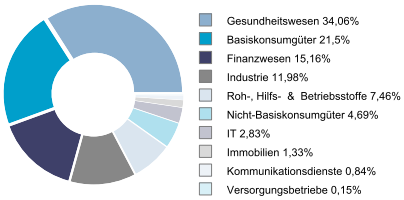


Name	SWISS EXCHANGE SWISS PERFORMANCE INDEX
Klassifizierung	Europa
Anlageklasse	Aktien
Indexart	Nettogesamtrendite
Währung	CHF
Index Reuters RIC	-
Index Bloomberg Ticker	SPI
Weitere Informationen	-

Index Geographische Zuordnung



Branchenallokation



Top 10 Komponenten

Nestle Sa-Reg	19.47%
Roche Hold	13.41%
Novartis Ag-Reg	11.89%
Cie Financiere Richemont-Reg	3.49%
Zurich Insurance Group Ag	3.45%
Abb Ltd-Reg	3.42%
Ubs Group Ag-Reg	3.16%
Lonza Group Ag-Reg	2.63%
Sika Ag-Br	2.50%
Givaudan-Reg	1.95%

3. ETF-Wertentwicklung

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	3 Jahre	5 Jahre
Lyxor SPI® UCITS ETF	**2.98%**	**10.87%**	**11.71%**	**37.63%**	**55.87%**
Benchmark	3.12%	11.32%	12.44%	42.11%	64.52%
Wertentwicklungsunterschied	-0.14%	-0.45%	-0.74%	-4.47%	-8.65%

	YTD	2020	2019	2018	2017
Lyxor SPI® UCITS ETF	**9.08%**	**2.63%**	**29.14%**	**-9.35%**	**18.25%**
Benchmark	9.71%	3.82%	30.59%	-8.57%	19.92%
Wertentwicklungsunterschied	-0.62%	-1.19%	-1.45%	-0.78%	-1.67%
Tracking Error	-	0.10%	0.12%	0.08%	0.26%

Die Performance ausschüttender ETF wird mit Wiederanlage der Dividenden in die ETF-Performance berechnet.
Performance-Gap steht für die Performanceunterschiede zwischen dem ETF und dem Index.
Der Tracking-Error stellt die annualisierte Volatilität der Performanceunterschiede zwischen dem ETF und der Benchmark dar.

	1Y	3Y	5Y
Volatilität des Fonds	10.97%	16.08%	14.31%
Benchmark-Volatilität	10.97%	16.09%	14.31%
Sharpe Ratio	1.71	0.70	0.69

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 31 Mai 2021

Die Daten [zu früheren Wertentwicklungen/simulierten früheren Wertentwicklungen/früheren und simulierten früheren Wertentwicklungen] beziehen sich auf die Vergangenheit und sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Renditen. Dasselbe gilt für die historischen Marktentwicklungen.

Wichtige Informationen für Investoren

Parteien, die an Transaktionen (z. B. Derivat- oder Finanzierungstransaktionen) beteiligt sind oder in Finanzinstrumenten anlegen, die einen Index oder einen variablen Zinssatz (Benchmark) verwenden, sind folgenden Risiken ausgesetzt:
(1) Die Benchmark kann methodischen und anderen Änderungen unterliegen, die den Wert der betroffenen Transaktion beeinflussen können; oder
(2) (i) entspricht eventuell nicht mehr den geltenden Gesetzen und Vorschriften (z. B. EU Referenzwerte-Verordnung), (ii) wird eventuell nicht mehr veröffentlicht (nach Dezember 2021 wird der LIBOR möglicherweise nicht mehr veröffentlicht und die Einstellung von EONIA ist geplant), oder (iii) es kann durch die für die Benchmark zuständige Aufsichtsbehörde oder den Verwalter beschlossen werden, dass der betroffene Referenzwert nicht länger repräsentativ ist, so dass die entsprechende Benchmark durch eine andere Benchmark ersetzt werden kann, was eine starke Beeinträchtigung des wirtschaftlichen Aspekts der betroffenen Transaktionen zur Folge haben könnte.

Wir empfehlen Ihnen, eine eigene, unabhängige Untersuchung und Analyse der potenziellen Folgen aller relevanten Risiken wie den oben erwähnten vorzunehmen, besonders angesichts der laufenden Brancheninitiativen im Zusammenhang mit der Entwicklung alternativer Referenz-Zinssätze und der Aktualisierung der relevanten Marktstandard-Dokumentation.

Risikoprofil

Potenzielle Anleger müssen die folgenden, im Prospekt des Fonds, der unter www.lyxoretf.de abrufbar ist, beschriebenen Risiken berücksichtigen.
KAPITALRISIKO: ETF sind nachbildende Instrumente: Ihr Risikoprofil ähnelt dem einer direkten Anlage in dem zugrunde liegenden Index. Das Kapital der Anleger ist vollständig dem Risiko ausgesetzt und Anleger erhalten unter Umständen den ursprünglich investierten Betrag nicht zurück.
REPLIKATIONSRISIKO: Die Anlageziele des Fonds werden aufgrund unerwarteter Ereignisse an den zugrunde liegenden Märkten, die die Indexberechnung und die effiziente Fondsnachbildung behindern, unter Umständen nicht erreicht.
KONTRAHENTENRISIKO: Die Anleger sind Risiken infolge der Verwendung eines OTC-Swap mit der GOLDMAN SACHS. ausgesetzt. Gemäß den OGAW-Richtlinien darf das mit der Société Générale eingegangene Risiko 10% des Gesamtvermögens des Fonds nicht übersteigen.
RISIKO IN VERBINDUNG MIT DEM BASISWERT: Der zugrunde liegende Index eines Lyxor-ETF kann komplex und volatil sein. Bei Anlagen in Rohstoffen wird der zugrunde liegende Index mit Bezug zu Rohstoff-Futures-Kontrakten berechnet, die den Anleger einem Liquiditätsrisiko in Verbindung mit den Kosten, wie zum Beispiel Fracht- und Transportkosten, aussetzen können. ETFs mit einem Engagement an Schwellenmärkten sind mit einem größeren Risiko möglicher Verluste verbunden als eine Anlage in Industrieländern, da sie vielfältigen und unvorhersehbaren Schwellenländerrisiken ausgesetzt sind.
WÄHRUNGSRISIKO: ETFs können einem Währungsrisiko unterliegen, wenn der ETF auf eine andere Währung als die Währung des nachgebildeten zugrunde liegenden Index lautet. Das bedeutet, dass die Wechselkursschwankungen die Renditen negativ oder positiv beeinflussen können.
LIQUIDITÄTSRISIKO: Die Liquidität wird durch zugelassene Market-Maker an der jeweiligen Börse, an der der ETF notiert ist, einschließlich der Société Générale, zur Verfügung gestellt. Die Liquidität an der jeweiligen Börse kann infolge einer Unterbrechung an dem Markt, der durch den von dem ETF nachgebildeten zugrunde liegenden Index repräsentiert wird, eines Ausfalls der Systeme einer der relevanten Börsen, der Société Générale oder anderer Market-Maker-Systeme oder einer unnormalen Handelssituation bzw. eines unnormalen Handelsereignisses beschränkt sein.

Hinweis

** Die Gesamtkostenquote (TER) deckt alle Kosten ab, die der Managementgesellschaft beim Management der zugrunde liegenden Vermögenswerte entstehen. Sie enthält Managementgebühren und strukturelle Kosten wie nachstehend beschrieben. Mit den Managementgebühren werden die Dienstleistungen der Verwaltungsgesellschaft vergütet. Die strukturellen Kosten bestehen aus den Depotbankgebühren, den Verwaltungsgebühren, den Prüfgebühren und allen anderen operativen Kosten, die von der Verwaltungsgesellschaft beim Betrieb der Fonds gezahlt werden.

Dieses Dokument wurde von Lyxor Asset Management erstellt. Die Informationen sind keine Zukunftsvorhersagen und stellen in keiner Weise eine Verpflichtung oder ein Angebot seitens der GOLDMAN SACHS et LYXOR FUNDS SOLUTIONS S.A. dar.

Societe Générale, Lyxor AM und Lyxor Asset Management Luxembourg übernehmen keinerlei treuhänderische Verantwortung oder Haftung für finanzielle oder anderweitige Konsequenzen, die sich durch die Zeichnung oder den Erwerb der in diesem Dokument beschriebenen Anlageinstrumente ergeben.

Die enthaltenen Informationen sowie die benutzten Zahlen und Beispiele haben einen rein Indikativen und informativen Charakter. Die verwendeten Informationen stammen von anerkannten und vertrauenswürdigen Quellen und wurden mit grösster Sorgfalt erstellt. Es kann nicht garantiert werden, dass sie vollständig, korrekt und aktuell sind. Für etwaige Fehler wird keine Haftung übernommen. Vergangenheitsbezogene Performance Daten sind keine Garantie für die Zukunft.

Ein Anleger sollte sich einen eigenen Eindruck über die Risiken bilden und für zusätzliche Auskünfte in Bezug auf eine Zeichnung oder einen Erwerb einen professionellen Berater konsultieren. Vor allem sollte sich ein Anleger bei Zeichnung und Kauf von Fondsanteilen bewusst sein, dass diese Produkte gewisse Risiken beinhalten (Bsp. Kursentwicklung, Währungsrisiken) und die Rückzahlung unter Umständen unter dem Wert des eingesetzten Kapitals liegen kann, im schlimmsten Fall kann es zu einem Totalverlust kommen. Es wird empfohlen, dass Anleger den Abschnitt "Risikofaktoren" der jeweiligen Verkaufsprospekte sehr genau beachten.

Für den Kauf bzw. Verkauf von Lyxor ETF Fondsanteilen sind ausschliesslich die offiziellen Verkaufsprospekte massgebend. In einigen Rechtsordnungen ist die Verbreitung der in diesem Dokument genannten Informationen unter Umständen gesetzlichen Beschränkungen unterworfen. Es unterliegt dem Investor sicherzustellen, dass er alle Vorschriften und gesetzlichen Richtlinien berücksichtigt, die im Umgang mit den dargestellten Informationen zur Anwendung kommen. Massgebend ist der Rechtstaat, von dem aus der Nutzer auf diese Informationen zugreift.

Die Informationen in diesem Dokument sind nicht für natürliche oder juristische Personen bestimmt, deren Wohn-bzw. Geschäftssitz einer ausländischen Rechtordnung unterliegt, die für die Verbreitung derartiger Informationen Beschränkung vorsieht.

Die genannten ETFs sind nicht nach dem U.S. Securities Act aus dem Jahre 1933 in seiner aktuellen Fassung registriert, und werden daher in den Vereinigten Staaten weder angeboten noch verkauft.

Das Herkunftsland der kollektiven Kapitalange ist Luxemburg. Der Fonds Lyxor SPI® UCITS ETF ist an der SIX Swiss Exchange und/oder BX Swiss Exchange kotiert und zum öffentlichen Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus im Sinne von Artikel 120 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 zugelassen.

In Bezug auf die vertriebenen Anteile einer kollektiven Kapitalanlage in der Schweiz oder von der Schweiz aus, gilt der Sitz des Vertreters in der Schweiz als Erfüllungsort und Gerichtsstand.

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat Société Générale, Paris, Zweigniederlassung Zürich, als Vertreter und als Zahlstelle der Fonds in der Schweiz bewilligt.

Die Prospekte, die vereinfachten Prospekte oder die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger, die Statuten, das Anlagereglement, die Jahres- und Halbjahresberichte der Fonds und alle anderen massgeblichen Dokumente gemäss Artikel 133 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV), können mittels einfacher Anfrage kostenlos beim Vertreter in der Schweiz bezogen werden:

SOCIETE GENERALE PARIS, Zurich Branch, Lyxor ETF Team Switzerland, Talacker 50, P.O. Box 1928, CH-8021 Zurich, www.lyxoretf.ch, info@lyxoretf.ch, +41 58 272 33 44