ComStage ShortDAX® UCITS ETF

Der ComStage ShortDAX® UCITS ETF ist ein börsengehandelter Investmentfonds (Exchange Traded Fund, „ETF"), der sich auf die Wertentwicklung des ShortDAX Index bezieht. ComStage ETFs kombinieren zwei Welten – die Vorteile von Fonds und die einfache Handelbarkeit von Aktien: Der ComStage ETF ist ein Sondervermögen gemäß der europäischen Fondsrichtlinie „UCITS" und somit u.a. ausreichend diversifiziert und getrennt von der Bilanz des Fondsanbieters. Es wird täglich ein Nettoinventarwert (NAV) durch die unabhängige Depotbank errechnet. Gleichzeitig werden sämtliche ComStage ETFs wie Aktien fortlaufend an verschiedenen Börsen gehandelt. Die fondsüblichen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge fallen an den Börsen sowie über den außerbörslichen Market Maker nicht an. Es sind lediglich Transaktionsgebühren zu entrichten, wie sie auch beim Aktienhandel üblich sind.

Indexbeschreibung

Der von der Deutsche Börse AG berechnete ShortDAX® Index ist ein an die Entwicklung des deutschen Leitindex DAX® (Performanceindex) gekoppelter Index, der die Performance einer Anlage mit einer täglichen Short-Position auf den DAX® abbildet.

Die auf täglicher Basis bestimmte Wertentwicklung des ShortDAX® TR Index entspricht ungefähr der inversen (umgekehrten) Entwicklung des DAX®. Eine positive (negative) Veränderung des DAX® führt zu einer negativen (positiven) Veränderung ungefähr gleichen prozentualen Ausmaßes auf Tagesbasis im ShortDAX® TR Index.

Es gilt zu beachten, dass bei einem Investment von mehr als einem Tag, die daraus resultierende Performance aufgrund der Berechnung auf täglicher Basis nicht mehr exakt der inversen Wertentwicklung des Basisindex über den gleichen Zeitraum entspricht.

ComStage im Portrait

In über 100 ComStage ETFs werden derzeit etwa 8,7 Mrd. Euro weltweit verwaltet. Hinter ComStage steht die im Jahre 2008 gegründete Kapitalanlagegesellschaft „Lyxor Funds Solutions S.A." (LFS) (ehemals: Commerz Funds Solutions S.A.) mit Sitz in Luxemburg. Die Palette an ComStage ETFs deckt Indizes auf Aktien, Renten und Rohstoffe sowie Strategie-Indizes ab.

Eine ausführliche Darstellung der Chancen und Risiken dieses ComStage ETFs finden Sie in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie dem Verkaufsprospekt.

Eckdaten

ETF-Informationen	
ETF-Name	ComStage ShortDAX® UCITS ETF
Index	ShortDAX® (DE000A0C4CT0)
Anzahl Indexmitglieder	30
OGAW/UCITS V	Ja
Fondswährung	EUR
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Währungsgesichert	Nein
Replikation	Wertpapierportfolio + besicherter Swap
Pauschalgebühr p.a.	0,30%
Nettoinventarwert (NAV)	19,9985 EUR (Stand: 30.12.2019)
Fondsvolumen	81 Mio. EUR (Stand: 30.12.2019)
Auflagedatum	10.05.2011
Zugelassen zum Vertrieb in	Deutschland, Österreich, Schweiz, Portugal, Luxemburg
Steuerlich transparent in	Deutschland, Österreich, Luxemburg
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland	sonstiger Fonds
VL-Fähigkeit	Nein

Handelsinformationen	
WKN	ETF004
Valor	12603142
ISIN	LU0603940916
Handelszeiten börslich	8:00 - 20:00 Uhr
Handelszeiten außerbörslich	8:00 - 22:00 Uhr
Listing Deutschland	Xetra, Frankfurt, Stuttgart: EUR
Listing Schweiz	Zürich: CHF, EUR
Reuters	CBSHORTDAX.DE
Bloomberg	C004 GY EQUITY
iNAV Reuters	CBSHDAXNAV=COBA
iNAV Bloomberg	CNAVC004

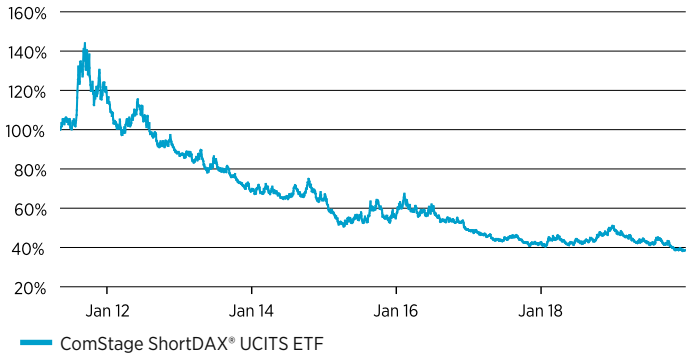
Branchenverteilung des ShortDAX® Index

Verbrauchs- & Verbrauchergüter	17,93%
Öl, Gas & Metalle	16,25%
Banken & Finanzdienstl.	16,01%
Industrie- & Transportunt.	14,57%
IT	13,58%
Pharma & Biotech	8,11%
Telekommunikation	4,47%
Versorger	3,51%
Gesundheitswesen	3,25%
Immobilien & REITs	2,32%

Quelle: Deutsche Börse AG
Stand: 30.12.2019

Wertentwicklung des ComStage ShortDAX® UCITS ETF

normiert in Fondswährung (EUR)



Quelle: Lyxor International Asset Management S.A.S.
Stand: 30.12.2019
Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Top 10 des ShortDAX® Index

Position	Indexgewichtung
SAP SE O.N.	10,00%
LINDE PLC EO 0,001	9,73%
ALLIANZ SE VNA O.N.	8,66%
SIEMENS AG NA	8,47%
BAYER AG NA	6,81%
BASF SE NA O.N.	5,89%
ADIDAS AG NA O.N.	4,96%
DT.TELEKOM AG NA	4,47%
DAIMLER AG NA O.N.	3,95%
MUENCH.RUECKVERS.VNA O.N.	3,54%

Quelle: Deutsche Börse AG
Stand: 30.12.2019

Kennzahlen des ComStage ShortDAX® UCITS ETF

in Fondswährung (EUR)

	lfd. Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit Auflage
Performance eff.	-22,85%	-22,85%	-21,14%	-40,29%	-61,32%
Volatilität p.a.	13,98%	13,98%	13,56%	17,65%	19,13%
Sharpe Ratio	-1,65	-1,65	-0,55	-0,55	-0,56

Quelle: Lyxor International Asset Management S.A.S.
Stand: 30.12.2019
Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Max. Drawdown seit Auflage	-73,43%
Months to Recover	-
Hoch 1 Jahr	26,26
Tief 1 Jahr	19,77
Tracking Error 1 Jahr	0,09%
Tracking Difference 1 Jahr	-0,20%
Dividendenrendite des Index	-
Kurs-Gewinn-Verhältnis des Index	-

Quelle: Lyxor International Asset Management S.A.S.
Stand: 30.12.2019

Hinweis

Der jeweilige Index und seine Marken sind geistiges Eigentum des jeweiligen Index-Sponsors und sind für bestimmte Verwendungen an die Lyxor Funds Solutions S.A. (vormals: Commerz Funds Solutions S.A.) lizenziert worden. Der Teilfonds wird in keiner Weise von dem bzw. den Index-Sponsor(en) der hier aufgeführten Indizes gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Die Index-Sponsoren der hier aufgeführten Indizes geben keinerlei Zusicherungen oder Gewährleistungen in Bezug auf Ergebnisse, die durch die Nutzung ihrer Indizes und/oder der Indexstände an einem bestimmten Tag erzielt wurden, oder in anderer Hinsicht. Die Index-Sponsoren haften nicht für Fehler in ihren Indizes und sind nicht verpflichtet, auf entsprechende Fehler aufmerksam zu machen. Darüber hinaus gibt der Index-Sponsor keine Versicherung hinsichtlich einer Änderung oder eines Wechsels in der Methodologie bei der Berechnung des Index ab und der Index-Sponsor unterliegt auch keiner Verpflichtung den Index fortlaufend weiter zu berechnen, ihn zu veröffentlichen und wiederzugeben.

Diese Publikation ist eine Kundeninformation im Sinne des Wertpapierhandelsgesetzes. Sie dient ausschließlich Informationszwecken und stellt weder eine individuelle Anlageempfehlung noch ein Angebot zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder sonstigen Finanzinstrumenten dar. Diese Ausarbeitung allein ersetzt nicht eine individuelle anleger- und anlagegerechte Beratung.

ComStage ist ein im Großherzogtum Luxemburg registrierter Fonds, ComStage 1, ComStage Vermögensstrategie, ComStage Alpha Dividende Plus UCITS ETF und ComStage Alpha Deutschland Dividende Plus UCITS ETF in Deutschland. Eine umfassende Darstellung der Fondsbedingungen ist im Verkaufsprospekt und in den Wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs) enthalten, die bei den nachfolgend aufgeführten Stellen kostenlos erhältlich sind: Deutschland: Lyxor International Asset Management S.A.S Deutschland, Neue Mainzer Strasse 46-50, 60311 Frankfurt am Main; Luxemburg: Lyxor Funds Solutions S.A., 22 Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg; Österreich: Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Am Belvedere 1, A-1100 Wien agiert als Zahlstelle und steuerlicher Vertreter in Österreich; Schweiz: Société Générale Paris, Zweigniederlassung Zürich, Talacker 50, CH-8001 Zürich agiert als Zahlstelle und Vertreter in der Schweiz.

Die steuerliche Behandlung ist von den persönlichen Verhältnissen des Kunden abhängig und kann zukünftig Änderungen unterworfen sein. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die lokalen Vertreter erbringen eine Beratung in rechtlicher, steuerlicher oder bilanzieller Hinsicht.

© Lyxor International Asset Management S.A.S. 2019. Alle Rechte vorbehalten.

Stand: 02.01.2020