

Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Daily Hedged to EUR - Acc

Ticker: SPHC IM

1. FONDSINFORMATIONEN

Anlageziel

Der Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Daily Hedged to EUR - Acc ist ein OGAW-konformer börsenhandelter Fonds mit dem Ziel, den Referenzindex S&P 500 Net Total Return Index so genau wie möglich abzubilden und gleichzeitig die Währungsschwankungen zwischen der Lokalwährung des Index und dem EUR auf täglicher Basis auszugleichen. Die EUR-abgesicherte Anteilsklasse bietet einen einfachen, in das Anlageprodukt integrierten Mechanismus der täglichen Währungsabsicherung, was eine effiziente Lösung zur Handhabung des Fremdwährungsrisikos für Anleger in EUR darstellt.

Der S&P 500 Net Total Return Index beinhaltet die 500 führenden amerikanischen Industrieunternehmen mit hoher Marktkapitalisierung.

Lyxor ETFs sind effiziente, börsennotierte Anlageinstrumente, die Anlegern einen transparenten, liquiden und kostengünstigen Zugang zum Exposure des zugrundeliegenden Referenzindex bieten.

Handelsinformationen

Handelsplatz	Öffnungszeiten (GMT)	Währung	Bloomberg Ticker	Reuters RIC	Aus-schüttend	FX Hedge
Borsa Italiana (Milano)*	08:00 / 16:30	EUR	SPHC IM	SPHC.MI	Nein	Ja
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5C FP	SP5C.PA	Nein	Nein
LSE**	08:00 / 16:30	USD	SP5C LN	SP5C.L	Nein	Nein
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	SP5L LN	SP5L.L	Nein	Nein
Bolsa Mexicana de Valores**	14:00 / 21:00	MXN	SP5CN MM	SP5CN.MX	Nein	Nein
SIX Swiss Exchange**	08:00 / 16:20	CHF	LYSPH SW	LYSPH.S	Ja	Ja
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5H FP	SP5H.PA	Ja	Ja
Borsa Italiana (Milano)**	08:00 / 16:30	EUR	SPXH IM	SPXH.MI	Ja	Ja
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	LYP2 GY	LYP2.DE	Ja	Ja
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	SP5G LN	SP5G.L	Ja	Ja
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	LYPS GY	LYXSP.DE	Ja	Nein
Borsa Italiana (Milano)**	08:00 / 16:30	EUR	SPX IM	LYXSP.MI	Ja	Nein
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5 FP	SP5.MC	Ja	Nein
Bolsa de Madrid**	08:00 / 16:30	EUR	SP5 SM	LYXSP.MI	Ja	Nein
Warsaw Stock Exchange**	08:00 / 16:00	PLN	LYPS PW	ETFSP500.WA	Ja	Nein
LSE**	08:00 / 16:30	USD	LSPU LN	LSPU.L	Ja	Nein
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	LSPX LN	LSPX.L	Ja	Nein
SIX Swiss Exchange**	08:00 / 16:20	USD	LYSP5 SW	LYSP5.S	Ja	Nein
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	6TVM GY	6TVM.DE	Ja	Nein

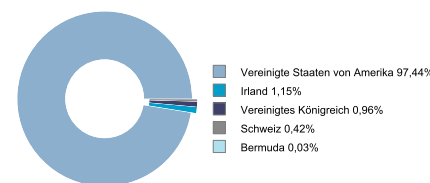
* Handelsplatz der Erstzulassung dieser Anteilsklasse ** Zulassung anderer Anteilsklassen

2. Indexinformationen

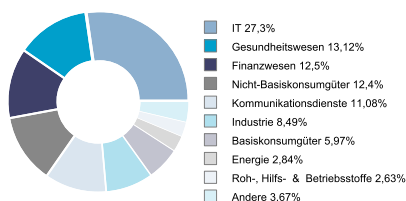
Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 26 Februar 2021



Index Geographische Zuordnung



Branchenallokation



3. ETF-Wertentwicklung

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	3 Jahre	5 Jahre
Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Daily Hedged to EUR - Acc	2.74%	5.26%	-	-	-
Benchmark	2.71%	5.22%	-	-	-
Wertentwicklungsunterschied	0.02%	0.05%	-	-	-

	YTD	2020			
Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Daily Hedged to EUR - Acc	1.57%	8.70%	-	-	-
Benchmark	1.54%	8.65%	-	-	-
Wertentwicklungsunterschied	0.03%	0.04%	-	-	-
Tracking Error	-	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

* Seit Auflegung, 22/10/2020

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 26 Februar 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.

Hauptmerkmale des Fonds

Ticker	SPHC IM
Rechtsform	SICAV
Domizilierung	Luxemburg
UCITS-Konform	Ja
ISIN	LU0959211326
Schweizer Steuer	Nein
Replikationsmethode	Indirekt (Swap-basiert)
Wertpapierleihe	Nein
Voller Besitz der Vermögenswerte	Ja
Währung der Anteilsklasse	EUR
Auflagedatum	22/10/2020
Nettoinventarwert pro Anteil zum Zeitpunkt der Auflage (EUR)	100
Gesamtkostenquote (TER)	0,09%
Fremdwährungsrisiko	Nein
Nettoinventarwert pro Anteil (EUR)	110.40
AuM der Anteilsklasse (Mio EUR)	1.04
Gesamtfondsvermögen (Mio EUR)	7'787.34
Umbrella-Fonds (Mio EUR)	40'691.11
Mindestanlagebetrag (Anteil)	1
Ertragsverwendung	Thesaurierend

Quelle: Lyxor AM, 26 Februar 2021

Name	S&P 500 Daily Hedged Euro Index Net TR
Klassifizierung	USA
Anlageklasse	Aktien
Indexart	Nettogesamtrendite
Währung	EUR
Index Reuters RIC	-
Index Bloomberg Ticker	SPXDHEN
Weitere Informationen	www.indices.standardandpoors.com

Top 10 Komponenten

Apple Inc	6.02%
Microsoft Corp	5.46%
Amazon.Com Inc	4.10%
Facebook Inc-Class A	1.92%
Alphabet Inc-CI A	1.89%
Alphabet Inc-CI C	1.84%
Tesla Inc	1.59%
Berkshire Hathaway Inc-CI B	1.45%
Jpmorgan Chase & Co	1.39%
Johnson & Johnson	1.30%

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.

Die Benchmark kann Veränderungen unterliegen. Zum Vergleich der Entwicklung des ETF mit der Entwicklung seiner Benchmark verwenden wir nachstehende Indizes:

	Vom	bis zum
S&P 500 Daily Hedged Euro Index Net TR	19/08/2013	

	1Y	3Y	5Y
Volatilität des Fonds	-	-	-
Benchmark-Volatilität	-	-	-
Sharpe Ratio	-	-	-

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.

REPLIKATIONSRISSIKO: 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 MORGAN STANLEY BANK AG, SOCIETE GENERALE, 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 Schwellenländerisiken ausgesetzt sind.

WÄHRUNGSRISSIKO: 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.

LIQUIDITÄTSRISSIKO: 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 Handelereignisses 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 MORGAN STANLEY BANK AG, SOCIETE GENERALE et Lyxor International Asset Management S.A.S. 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 Rechtsstaat, 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 Rechtsordnung 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 Kapitalanlage ist Luxemburg. Der Fonds Lyxor S&P 500 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