

BASFAKTA FÖR INVESTERARE

Detta dokument innehåller basfakta om den här fonden. Det är inte avsett som marknadsföring. Informationen krävs enligt lag för att hjälpa dig förstå vad det innebär att investera i denna fond och vilka risker det medför. Det rekommenderas att du läser den så att du kan fatta ett motiverat beslut om att investera eller inte.

Lyxor S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll UCITS ETF – Acc ("fonden")

ISIN-kod: LU0832435464 – En delfond i investeringsbolaget MULTI UNITS LUXEMBURG ("Bolaget") med säte i Luxemburg. Förvaltd av Lyxor International Asset Management S.A.S. ("LIAM")

Mål och investeringspolicy

Fonden är en passivt förvaltd UCITS-fond som följer index.

Fondens investeringsmål är att följa utvecklingen både uppåt och nedåt på "S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll Index" ("jämförelseindexet"), noterat i US-dollar (USD) representativt för rörelserna på terminsmarknaden och som är listat på Chicago CBOE samt hänförligt till den implicita volatiliteten på S&P 500 Index, samtidigt som den volatila skillnaden mellan fondens avkastning och avkastningen på jämförelseindexet minimeras ("aktiv risk").

Den förväntade nivån på den aktiva risken under normala marknadsförhållanden anges i fondens prospekt.

Webbplatsen <https://us.spindices.com/> innehåller mer utförlig information om jämförelseindexet.

För att exponeringen ska upprätthållas måste de innehavda terminskontrakten "rullas". Rullande terminskontrakt går ut på att överföra en position på terminskontrakt som närmar sig förfallodagen (och, i varje fall, före terminskontraktets förfallodag) till terminskontrakt med en längre löptid.

Investorare är utsatta för en risk för förlust eller utsikt till vinst från rullningsförfarandet på terminskontrakten.

Fonden strävar efter att uppnå målet via indirekt replikering genom att ingå OTC-swappavtal (finansiella derivatinstrument, "FDI:er").

Fonden kan även placera i en diversifierad portfölj bestående av internationella aktier, vars avkastning byts mot avkastningen för jämförelseindexet via FDI:er.

En uppdaterad sammanställning av fondens innehav finns på www.lyxoretif.com.

Det indikativa substansvärdet publiceras dessutom på Reuters and Bloomburges sidor om fonden och det kan även komma att anges på webbplatserna för de börser där fonden är noterad.

Andelsvalutan är euro (EUR).

- **Investerade finansiella instrument:** Finansiella derivatinstrument, internationella aktier.
- **Utdelningspolicy:** De (eventuella) utdelningsbara beloppen i Fonden betalas inte ut till andelsägarna utan återinvesteras.
- **Substansvärde:** beräknas dagligen under förutsättning att de berörda börserna är öppna för handel och att order kan täckas.
- **Inlösen:** Investorare kan lösa in sina andelar på primärmarknaden varje värderingsdag före kl. 18.30 CET, och sälja sina andelar på andrahandsmarknader när som helst då fondens noteringsplatser håller öppet.

Risk- och vinstprofil



Den ovan angivna risk-/avkastningskategorin baseras på den historiska avkastningen på fondens tillgångar eller resultatet på dess jämförelseindex eller det beräknade resultatet på en portföljmodell. Denna riskbedömning kan därför vara en otillförlitlig indikator för framtida risk, och den kan komma att ändras med tiden. Den lägsta kategorin innebär inte att investeringen är riskfri.

Genom sin exponering mot jämförelseindexet har fonden klassificerats som kategori 7. Kategori 7 anger att en plötslig, allvarlig och även fullständig kapitalförlust är möjlig under normala marknadsvillkor. Värdet av din investering kan förändras avsevärt och i hög grad variera dagligen uppåt eller nedåt.

Viktiga risker som inte täcks av ovannämnda indikator som skulle kunna leda till att Fondens substansvärde minskar och som Fonden är behörig att upplysa om i detta dokument (mer information om risker finns i avsnittet om riskprofil i prospektet):

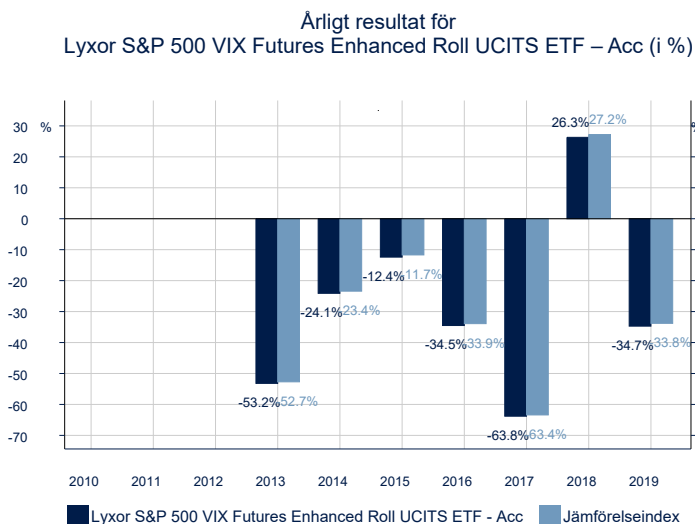
- **Motpartsrisk:** Fonden är exponerad mot risken att en motpart med vilken den har ingått ett avtal eller en transaktion kan bli insolvent eller på annat sätt oförmögen att betala och särskilt när motparten har ingått avtal om finansiella derivatinstrument på OTC-börs eller ingått transaktioner om utlåning av värdepapper. Om en sådan händelse inträffat kan fondens substansvärde minska väsentligt. Enligt den förordning som tillämpas för fonden, får inte en sådan risk överstiga 10 procent av fondens totala tillgångar per motpart.
- **Risk med användning av finansiella derivatinstrument:** Fonden investerar i finansiella derivatinstrument. Dessa finansiella derivatinstrument kan leda till olika risker som till exempel (men inte begränsat till dem) hävstångsrisk, hög volatilitet, värderingsrisk eller likviditetsrisk. Om en sådan risk blir aktuell kan fondens substansvärde minska väsentligt.
- **Operativ risk:** Om ett operativt fel skulle uppstå hos förvaltningsbolaget, eller hos något av dess ombud, kan investorare uppleva förlust, försenad behandling av teckningsbegäran, konverteringar, inlösenordrar eller andra typer av störningar.

Avgifter för denna fond

De avgifter du betalar används för att betala driftkostnaderna för Fonden, inklusive marknadsförings- och distributionskostnader. Dessa avgifter minskar den potentiella ökningen av din investering. Ytterligare information om avgifter finns i det aktuella avsnittet om avgifter i fondprospektet, vilket kan konsulteras på www.lyxoretf.com.

Engångsavgifter som tas ut före eller efter din investering	
Teckningsavgift endast tillämpad på förstahandsmarknaden:	som mest det högsta av i) 50 000 euro per teckningsbegäran och ii) 5 % av substansvärdet per andel multiplicerat med antalet tecknade andelar.
Inlösenavgift endast tillämpad på förstahandsmarknaden:	som mest det högsta av i) 50 000 euro per begäran om inlösen och ii) 5 % av substansvärdet per andel multiplicerat med antalet inlösta andelar.
Detta är det högsta belopp som du kan ta ut av dina pengar innan intäkterna från din investering har betalats ut. Investerare kan få reda på de faktiska teckningsavgifterna och inlösenavgifterna hos sin finansrådgivare eller distributör. Vid investering på en aktiebörs där Fonden är noterad gäller ingen tecknings-/inlösenavgift men andra avgifter kan komma att tas ut, exempelvis mäklaravgifter.	
Avgifter som tas ut från Fonden under ett år.	
Årliga avgifter:	0,60 %.
Beloppet för årliga avgifter grundas på kostnader för föregående år (inklusive skatter i förekommande fall), dvs. året som löpte ut i december 2019 och beloppet kan variera från ett år till ett annat. Resultatrelaterade avgifter och portföljtransaktionskostnader ingår inte, utom vid en tecknings-/inlösenavgift som betalas av fonden vid köp eller försäljning av andelar i underliggande kollektiva investeringsfonder.	
Avgifter som tas ut från Fonden under vissa särskilda omständigheter	
Resultatrelaterad avgift:	Ingen.

Tidigare avkastning



Tidigare avkastning är ingen tillförlitlig indikator för framtida resultat. Avkastningen anges i euro (EUR) och minus alla avgifter som tas ur fonden. Fonden bildades den 25 september 2012.

När Jämförelseindexet är noterat i en annan valuta än Fondens valuta, konverteras Jämförelseindexets resultat till Fondens valuta för jämförelseändamål. Valutatransaktioner verkställs på daglig basis (WM Reuters kurs kl. 17.00 det aktuella datumet).

Praktisk information

- **Förvaringsinstitut:** Société Générale Luxembourg.

Ytterligare praktisk information om fonden, det senaste prospektet, samt den senaste årsredovisningen och eventuella därpå utgivna halvårsrapporter finns att få kostnadsfritt på franska och på engelska från förvaltningsbolagets kundtjänst på adressen 17, Cours Valmy, Tour Société Générale 92800 Puteaux, FRANKRIKE.

Fonden är en delfond tillhörig företaget MULTI UNITS LUXEMBOURG. Prospekt samt senaste årsredovisning och eventuella därefter utgivna halvårsrapporter för hela företaget.

Tillgångar och skulder i varje delfond är separerade enligt lag (dvs. fondens tillgångar kan inte användas för att betala skulder i andra delfonder i företaget). Om tillämpligt redovisas regler för konvertering mellan delfonder i företagets prospekt.

- **Ytterligare information:** substansvärdet och övrig information om andelsklassen (i förekommande fall) finns på www.lyxorfunds.com.

Information om marknadsgaranter, växelkurser och annan handelsinformation finns på fondens sida på webbplatsen www.lyxoretf.com. Det indikativa substansvärdet publiceras i realtid av fondbörsen under handelstiden.

- **Skatt:** gällande skattelagstiftning i den medlemsstat där fonden har sitt säte kan påverka investerarna. Kontakta din ordinarie skatterådgivare för mer information.

Lyxor International Asset Management kan hållas ansvarigt endast om ett påstående i detta faktablad är vilseledande, felaktigt eller oförenligt med de relevanta delarna av fondens prospekt.

Uppgifter om förvaltningsbolagets uppdaterade ersättningspolicy finns på www.lyxor.com eller kan erhållas kostnadsfritt på skriftliga begäran till förvaltningsbolaget. Denna policy beskriver särskilt metoderna för beräkning av ersättning och förmåner för vissa anställningskategorier, organ ansvariga för deras fördelning och sammansättningen av kompensationskommittén.

Fonden är auktoriserad i Luxemburg och tillsyn över fonden utövas av Commission de Surveillance du Secteur Financier. Lyxor International Asset Management regleras av finansmarknadsmyndigheten AMF.

De basfakta för investerare som presenteras i detta dokument gäller per den 14 februari 2020.