

Tämä asiakirja antaa sijoittajalle avaintiedot rahastosta. Se ei ole markkinointiaineistoa. Avaintiedot on annettava lakisääteisesti, jotta sijoittaja ymmärtäisi rahaston luonteen ja siihen liittyvät sijoitusriskit. Asiakirjaan tutustumista suositellaan, jotta sijoittaja voisi tehdä sijoituspäätöksensä tietoon perustuen.

Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) UCITS ETF - Acc ("rahasto")

ISIN: LU2198883410 – Luxemburgissa rekisteröidyn MULTI UNITS LUXEMBOURG -sijoitusyhtiön ("yhtiö") alarahasto.

Rahastoa hallinnoi Lyxor International Asset Management S.A.S. ("LIAM")

Tavoitteet ja sijoituspolitiikka

Rahasto on passiivisesti hoidettu indeksiä seuraava yhteissijoitusyhtiö.

Rahaston tavoitteena on seurata Yhdysvaltain dollarin (USD) määräistä S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index -indeksiä ("vertailuindeksi"). Rahaston tuoton ja vertailuindeksin tuoton välisen eron volatiliiteetti ("seurantavirhe") pyritään minimoimaan. Seurantavirheen oletettu taso normaaleissa markkinaolosuhteissa on ilmoitettu rahastoesitteessä.

Vertailuindeksi edustaa S&P 500 Index -indeksiin ("pääindeksi") kelpoisuusehdot täyttäviä osakkeita, jotka on valittu ja painotettu siten, että ne ovat yhdessä yhteensopivia 1,5 °C:een ilmastokenaarin kanssa. Painotusstrategia pyrkii optimoinnin avulla minimoimaan osatekijöiden painotusten erot suhteessa pääindeksiin kattamalla samalla useita eri ilmastotavoitteita kuten siirtymärisin (esimerkiksi kasvihuonekaasuintensivisen toiminnan hiilidioksidipäästöjen vähentäminen keskimäärin vähintään 7 % vuodessa), ilmastomuutoksen mahdollisuudet (huomattavasti korkeammalla uusiutuvien energialähteiden osuudella tuloista) ja fyysisen riskin (pienentämällä ilmastomuutoksesta johtuvaa fyysistä riskiä käyttämällä Trucost-analyytilaitoksen fyysistä riskiä koskevia tietoja vertailuindeksin menetelmän määrittämisen mukaan). Vertailuindeksi pyrkii täyttämään jatkuvasti Euroopan unionin ympäristöön, yhteiskuntaan ja hallintoon liittyvien tietojen julkistamisen teknisen asiantuntijaryhmän asettamat kriteerit, jotta se voi olla EU:n Pariisin ilmastositoumuksen mukainen viitearvo (EU Paris-Aligned Benchmark, "EU PAB").

Rahasto on vahvasti sitoutunut noudattamaan ei-taloudellista lähestymistapaa, joka mahdollistaa vähintään 50 prosenttia alhaisemman kasvihuonekaasupäästöjen kokonaisintensiteetin pääindeksiin verrattuna. Lisätietoja rahaston ympäristöön, yhteiskuntavastuuseen ja hyvään hallintotapaan (ESG-tekijöihin) liittyvistä yleisistä ja erityisistä tavoitteista on rahaston avoimuussäännöissä, jotka on julkaistu verkko-osoitteessa <https://www.lyxoretf.com/>. Vertailuindeksin menetelmän rajoitukset kuvataan rahaston rahastoesitteen riskitekijäosiossa. Niitä ovat muun muassa EU PAB -merkinnän menettäminen ja vertailuindeksin menetelmässä käytettyihin CO2-tietoihin liittyvä riski.

Yritysten nykyisten ja tulevien kasvihuonekaasupäästöjen analyysi perustuu osittain yritysten antamiin tietoihin, malleihin ja arvioihin. Tällä hetkellä kaikkia kasvihuonekaasupäästöihin liittyviä tietoja ei ole käytettävissä, ja jotkut tiedot ovat mallipohjaisia (erityisesti Scope 3 -päästöjä eli muita kuin suoraan tuotteen valmistuksesta syntyviä kasvihuonepäästöjä koskevat tiedot). Vertailuindeksin menetelmä ei estä sisällyttämästä indeksiin paljon kasvihuonekaasupäästöjä tuottavien yritysten arvopapereita.

S&P:n verkkosivuilla (<https://us.spindices.com/>) on tarkempaa tietoa S&P-indekseistä.

Vertailuindeksi on nettotuottoindeksi, jonka tuotto lasketaan sillä perusteella, että mahdolliset osingot ja voitonjatot sisällytetään vertailuindeksin tuottoon veronpidätyksen vähentämisen jälkeen.

Rahasto pyrkii saavuttamaan tavoitteensa suoralla replikoinnilla sijoittamalla pääasiassa vertailuindeksin sisältämiin arvopapereihin. Vertailuindeksin optimaalisen replikoinnin varmistamiseksi rahasto voi valita osakkeita otantaperusteisesti.

Tämän tekniikan mahdollisesta käytöstä ilmoitetaan Lyxorin verkkosivustolla: www.lyxoretf.com.

Rahaston salkun koostumus on nähtävissä sivustolla www.lyxoretf.com.

Lisäksi viitteellinen nettoarvo julkaistaan Reutersin ja Bloombergin rahastoa koskevilla sivuilla ja mahdollisesti myös niiden pörssien verkkosivuilla, joihin rahasto on listattu.

Osuuden valuuttayksikkö on Yhdysvaltain dollari (USD).

- **Sijoituskohteina olevat rahoitusinstrumentit:** johdannaiset, kansainväliset osakkeet, muut rahoitusinstrumentit.
- **Osingonjakoperiaatteet:** rahaston (mahdollisia) osingonjakoon käytettävissä olevia varoja ei jaeta sijoittajille, vaan ne sijoitetaan uudelleen.
- **Substanssiarvo:** lasketaan päivittäin sillä edellytyksellä, että asianomaiset pörssit ovat avoinna kaupankäyntiä varten, ja toimeksiannot voidaan toteuttaa.
- **Lunastukset:** sijoittajat voivat lunastaa osuutensa ensimarkkinoilla jokaisena arvotuspäivänä ennen klo 18.30 Keski-Euroopan/Luxemburgin aikaa ja myydä osuutensa jälkimarkkinoilla milloin tahansa rahaston noteerauspaikkojen kaupankäyntiaikana.

Riski-hyötyprofiili



Edellä esitetty riski-hyötyluokitus perustuu rahaston varallisuuden aiempaan tuottoon, rahaston vertailuindeksin kehitykseen tai mallisalkun simuloituun tuottoon. Tämä riskiarvio ei siksi välttämättä voi luotettavasti ennustaa tulevaa riskiä, ja luokitus voi muuttua ajan myötä. Alhaisintaan riskiluokka ei merkitse riskitöntä sijoitusta.

Vertailuindeksille altistumisesta johtuen rahasto on sijoitettu luokkaan 6. Luokka 6 tarkoittaa, että normaaleissa markkinaolosuhteissa suuret pääoman menetykset ovat mahdollisia, ja sijoituksen arvo voi vaihdella päivittäin hyvin voimakkaasti ja melko nopeasti sekä ylös- että alaspäin.

Tärkeimmät riskit, joita indikaattori ei ota huomioon mutta jotka saattavat vaikuttaa kielteisesti rahaston substanssiarvoon ja jotka rahasto ilmoittaa tässä asiakirjassa (lisätietoja riskeistä on rahastoesitteen riskiprofiiliosiossa):

- **Vastapuoliriski:** Rahastoon kohdistuu riski siitä, että vastapuoli, jonka kanssa rahasto on tehnyt sopimuksen tai suorittanut transaktion, tulee maksukyvyttömäksi tai muuten laiminlyö velvoitteensa, erityisesti silloin, kun kyseessä on pörssin ulkopuolella tehtävä (over-the-counter) johdannaiskauppa tai arvopaperien lainaksiantaminen. Tällainen tapahtuma voi aiheuttaa rahaston nettoarvon huomattavan laskun. Rahastoa koskevista määräyksistä johtuen tämä riski ei voi yksittäisen vastapuolen osalta ylittää 10 prosenttia rahaston kokonaisvarallisuudesta.
- **Johdannaisten käytöstä johtuva riski:** Rahasto sijoittaa johdannaisinstrumentteihin, joihin liittyy eri tyyppisiä riskejä kuten (muun muassa) vipuvaikutusriski, lisääntyneeseen volatiliiteettiin liittyvä riski, arvostusriski tai likviditeettiriski. Tämän riskin realisoiduminen voi aiheuttaa rahaston nettoarvon huomattavan laskun.
- **Operatiivinen riski:** Toimintahäiriöt rahastoyhtiön tai sen edustajien operatiivisissa järjestelmissä voivat aiheuttaa tappioita, merkintä-, vaihto- ja lunastustoimeksiantojen käsittelyviiveitä tai muun tyyppisiä häiriöitä.

Tämän rahaston kulut

Maksettavat kulut käytetään rahaston toimintakustannusten maksamiseen, mukaan lukien markkinointi- ja jakelukustannukset. Nämä kulut vähentävät sijoituksen mahdollista kasvua. Lisätietoja kuluista on rahaston rahastoositteiden kuluja koskevassa osiossa. Rahastoosite on luettavissa osoitteessa www.lyxoretf.com.

Sijoittamista edeltävät tai seuraavat kertamaksut

Merkintäpalkkio: Ei koske jälkimarkkinasijoittajia*

Lunastuspalkkio: Ei koske jälkimarkkinasijoittajia*

Tämä on enimmäismäärä, joka sijoituksesta voidaan veloittaa kuluina ennen sijoittamista ja ennen sijoituksen tuoton maksamista.

***Jälkimarkkinat:** koska rahasto on ETF-rahasto, muut kuin valtuutetut osapuolet voivat yleensä myydä tai ostaa osakkeita vain jälkimarkkinoilla.

Sijoittajat maksavat näin ollen arvopaperipörsseissä tapahtuvaan kaupankäyntiinsä liittyvät välityspalkkiot ja/tai kaupankäyntikulut. Näitä välityspalkkioita ja/tai kaupankäyntikuluja ei makseta rahastolle eikä rahastoyhtiölle, vaan sijoittajan omalle välittäjälle. Lisäksi osakkeiden osto- ja myyntikurssin erosta aiheutuneet kustannukset saatetaan veloittaa sijoittajilta.

Ensimarkkinat: Suoraan rahaston kanssa kauppaa käyvät valtuutetut osapuolet maksavat vastaavat ensimarkkinoiden kaupankäyntikulut.

Lisätietoja on rahaston rahastoositteiden asiaa koskevissa osioissa.

Rahastosta vuoden aikana veloitettavat maksut

Juoksevat kulut: 0,07 %.

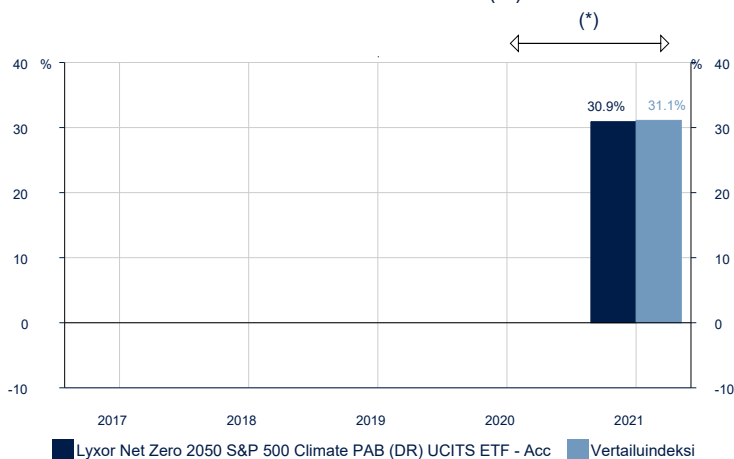
Tässä esitetty juoksevien kulujen määrä on arvio. Arviossa on huomioitu 12. toukokuuta 2021 voimaan tullut hallinnointipalkkioiden lasku. Tässä esitetty luku vastaa mainitun päivämäärän jälkeistä palkkiota ja poikkeaa vuoden aikana tosiasiallisesti veloitetuista kuluista, jotka sisältävät kulut myös muutosta edeltäneeltä ajalta. Tosiasiallisesti veloitetuista kuluista on tiedot yhteissijoitusyrityksen kunkin tilikauden vuosikatsauksessa. Se ei sisällä tulosperusteisia palkkioita eikä kaupankäyntikuluja paitsi sijoituskohteena olevan yhteissijoitusyrityksen osakkeiden/osuuksien ostamisesta tai myymisestä maksetut merkintä- ja lunastuspalkkiot.

Rahastosta tietyissä erityisolosuhteissa veloitettavat maksut

Tulosperusteinen palkkio: Ei sovelleta.

Aiempi tuotto- tai arvonkehitys

Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) UCITS ETF - Acc
-rahaston vuotuinen tuotto (%)



Aiempi tuotto- tai arvonkehitys ei ole luotettava osoitus tulevasta kehityksestä. Tuotto esitetään Yhdysvaltain dollareina (USD) kaikkien rahaston kulujen vähentämisen jälkeen. Rahasto on perustettu 15. heinäkuuta 2020.

Kun vertailuindeksi on muun kuin rahaston valuutan määräinen, vertailuindeksin kehitys muunnetaan vertailutarkoituksessa rahaston valuutan määräiseksi. Vertailuindeksin arvo muunnetaan päivittäin käyttäen WM/Reuters-valuuttakurssia klo 17 Keski-Euroopan aikaa kunkin päivänä.

(*) 4.11.2021 saakka rahaston vertailuindeksin nimi oli S&P 500 Paris-Aligned Climate Net Total Return Index.

Käytännön tiedot

- **Säilytysyhteisö:** Société Générale Luxembourg.

Muut rahastoa koskevat käytännön tiedot, uusin rahastoosite sekä tuorein vuosikertomus ja puolivuotiskatsaus ovat saatavilla veloituksetta englanniksi ja ranskaksi rahastoyhtiön asiakaspalveluosastolta osoitteesta 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Pariisi, Ranska.

Rahasto on MULTI UNITS LUXEMBOURG -yhtiön alarahasto. Rahastoosite, uusin rahastoosite sekä tuorein vuosikertomus ja puolivuotiskatsaus laaditaan koko yhtiölle.

Kunkin alarahaston varat ja vastuut ovat lakisääteisesti erillisiä (eli rahaston varoja ei voida käyttää yhtiön muiden alarahastojen vastuiden kattamiseen). Alarahastojen välisiin vaihtoihin mahdollisesti sovellettavat säännöt on kuvattu yhtiön rahastoositteessä.

- **Lisätietoja:** substanssiarvon ja (mahdollisia) muita osuuslajeja koskevia tietoja saa osoitteesta www.lyxoretf.com.

Arvopaperinvälittäjiä, kaupankäyntipaikkoja ja kaupankäyntimenettelyitä koskevia tietoja saa rahastoa koskevalta sivulta osoitteesta www.lyxoretf.com. Pörssiä operoiva yhtiö julkaisee suuntaa-antavan substanssiarvon reaaliaikaisesti kaupankäyntiaikoina.

- **Verotus:** rahaston kotivaltion verolainsäädäntö voi vaikuttaa sijoittajan henkilökohtaiseen verotukseen. Sijoittajaa kehoitetaan pyytämään lisätietoja omalta veroneuvonantajaltaan.

Lyxor International Asset Management voidaan saattaa vastuuseen vain sillä perusteella, että tämä asiakirja sisältää harhaanjohtavia tai epätarkkoja tietoja tai tietoja, jotka ovat ristiriidassa rahaston rahastoositteiden vastaavien osien kanssa.

Rahastoyhtiön ajantasaiset palkka- ja palkkiopolitiikkaa koskevat tiedot saa osoitteesta www.lyxor.com tai maksutta pyytämällä niitä kirjallisesti rahastoyhtiöltä. Palkka- ja palkkiopolitiikassa kuvataan tiettyjen työntekijäryhmien palkkojen ja palkkioiden sekä korvausten laskentatapa, niiden myöntämisestä vastaavat tahot sekä palkka- ja palkkiokomitean kokoonpano.

Rahastolle on myöntänyt toimiluvan Luxemburg, ja sitä valvoo Commission de surveillance du secteur financier. Lyxor International Asset Managementia valvoo Autorité des marchés financiers.

Nämä sijoittajan avaintiedot ovat ajantasaisia 18. helmikuuta 2022.