

**Lyxor Funds Solutions S.A.**  
22, Boulevard Royal  
2449 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg  
Handelsregisternummer Luxemburg: B 139.351  
(die "**Verwaltungsgesellschaft**")

**Mitteilung an alle Anteilinhaber des Teilfonds Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF  
(WKN ETF960, ISIN DE000ETF9603) (der „Teilfonds“)**

**Änderung der Besonderen Anlagebedingungen des Teilfonds der Umbrella-Konstruktion  
Lyxor 1  
gemäß der OGAW-Richtlinie (OGAW-Sondervermögen)  
(der „Fonds“)**

Lyxor Funds Solutions S.A. informiert die Anleger über folgende wesentliche Änderungen in den Besonderen Anlagebedingungen des Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF:

In den Besonderen Anlagebedingungen wurde der neue Paragraph „§ 12 Rückgabefrist und Rückgabebeschränkung“ mit dem für den Teilfonds gültigen Schwellenwert von 10% des Nettoinventarwertes hinzugefügt. Damit kann die Verwaltungsgesellschaft die Rückgabeverlangen der Anleger beschränken, wenn diese den vorgenannten Schwellenwert erreichen. Dies dient der Optimierung des Teilfondsmanagements bei Liquiditätsgrenzen.

Weitere Teilfondscharakteristika ändern sich nicht.

**Die vorgenannten Änderungen treten einen Tag nach Veröffentlichung der Mitteilung an die Anleger im Bundesanzeiger sowie auf der Webseite [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com) in Kraft.**

Sollten Sie Fragen zu dieser Mitteilung haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Finanzberater oder an Lyxor Deutschland unter +49 (0) 69 717 4444, gerne auch per E-Mail an „[info@lyxoretf.de](mailto:info@lyxoretf.de)“.  
Die geänderten Besonderen Anlagebedingungen sind nachfolgend abgedruckt.

Der Verkaufsprospekt, die Anlagebedingungen des Teilfonds, die wesentlichen Anlegerinformationen, die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind in deutscher Sprache bei der Gesellschaft und den nachfolgend genannten Stellen kostenlos in Papierform sowie in elektronischer Form unter [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com) erhältlich.

Kontakt- und Informationsstelle im Großherzogtum Luxemburg:  
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, 2449 Luxemburg

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich:  
Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG, Am Belvedere 1, 1100 Wien

**Luxemburg, 3. November 2021**

**Lyxor Funds Solutions S.A.**  
- Der Verwaltungsrat der Gesellschaft –

**Besondere Anlagebedingungen**  
**für das OGAW-Teilsondervermögen**  
**Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF**

Besondere Anlagebedingungen („BABen“) zur Regelung des Rechtsverhältnisses zwischen den Anlegern und der Lyxor Funds Solutions S.A. mit Sitz in Luxemburg („Gesellschaft“) für das von der Gesellschaft gemäß der OGAW-Richtlinie verwaltete Wertpapierindex-Teilsondervermögen deutschen Rechts Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF („Teilfonds“), die nur in Verbindung mit den für den Teilfonds von der Gesellschaft aufgestellten „Allgemeinen Anlagebedingungen“ („AABen“) gelten.

## **Anlagegrundsätze und Anlagegrenzen:**

### **§ 1 Vermögensgegenstände**

1. Die Gesellschaft darf für den Teilfonds die folgenden Vermögensgegenstände erwerben:
  - a) Wertpapiere gemäß § 6 der AABen,
  - b) Geldmarktinstrumente gemäß § 7 der AABen,
  - c) Bankguthaben gemäß § 8 der AABen,
  - d) Investmentanteile gemäß § 9 der AABen,
  - e) Derivate gemäß § 10 der AABen,
  - f) sonstige Anlageinstrumente gemäß § 11 der AABen.
2. Die Auswahl der für den Teilfonds zu erwerbenden Aktien, Genussscheine, Indexzertifikate und Einzeltitlezertifikate ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index („zugrunde liegender Index“) nachzubilden.

Der zugrunde liegende Index bildet die Wertentwicklung von ca. 480 Werte aus dem STOXX® Europe 600, die durch Anwendung von ESG Kriterien bestimmt werden, ab. Bei den ESG-Kriterien handelt es sich um Compliance-, Engagement und ESG-Performance-Screens. Ausgeschlossen werden Unternehmen, die auf Basis der Bewertung des Datenanbieter Sustainalytics nicht mit den Global Standards Screening konform sind. Das Global Standards Screening identifiziert Unternehmen, die gegen allgemein anerkannte internationale Normen und Standards verstoßen oder Gefahr laufen, Normen zu verletzen, die in den Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC), den Richtlinien für multinationale Unternehmen der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD), den UN-Leitsätzen für Unternehmen und Menschenrechte (UNGPs) und den ihnen zugrunde liegenden Konventionen verankert sind.

Gemäß der Indexregeln sind außerdem Unternehmen ausgeschlossen, die bestimmte Kriterien bezogen auf umstrittene Waffen, Tabakproduktion, Thermische Kohle und Militärverträgen nicht erfüllen.

Details zu den Indexregeln und Auswahlkriterien sind im Verkaufsprospekt beschrieben. Im Verkaufsprospekt ist auch die Internetseite des Indexanbieters genannt, wo die Beschreibung der Methode zur Berechnung des zugrunde liegenden Indexes zu finden ist.

### **§ 2 Wertpapier-Darlehens- und Pensionsgeschäfte**

1. Wertpapier-Darlehensgeschäfte gemäß § 14 der AABen dürfen nicht abgeschlossen werden.
2. Pensionsgeschäfte gemäß § 15 der AABen dürfen nicht abgeschlossen werden.

### **§ 3 Anlagegrenzen**

1. Der § 12 der AABen ist bei den Anlagegrenzen zu berücksichtigen.
2. Derivate gemäß § 10 der AABen dürfen nur in folgenden Sondersituationen im Interesse der Investoren zum Einsatz kommen, wobei der Wert der eingesetzten derivativen Finanzinstrumente 10 Prozent des Teilfonds nicht übersteigen darf:
  - a) Liquiditätsengpässe bei einzelnen Werten, oder
  - b) spezielle Kapitalmaßnahmen oder ähnliches.

3. Der Teilfonds darf insgesamt höchstens 10 Prozent seines Vermögens in Anteile anderer inländischer oder ausländischer Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) oder Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) anlegen. Der Teilfonds ist daher als Zielfonds für Dachfonds geeignet.
4. Vorbehaltlich der in den vorstehenden Absätzen 1 bis 3 festgelegten Anlagegrenzen gilt zudem, dass mindestens 92 Prozent des Wertes des Teilfonds in Kapitalbeteiligungen i. S. d. § 2 Absatz 8 Investmentsteuergesetz angelegt werden. Kapitalbeteiligungen in diesem Sinne sind:
  - a) Anteile an Kapitalgesellschaften, die zum amtlichen Handel an einer Börse zugelassen oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind;
  - b) Anteile an Kapitalgesellschaften, die in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum ansässig sind und dort der Ertragsbesteuerung für Kapitalgesellschaften unterliegen und nicht von ihr befreit sind;
  - c) Anteile an Kapitalgesellschaften, die in einem Drittstaat ansässig sind und dort einer Ertragsbesteuerung für Kapitalgesellschaften in Höhe von mindestens 15 Prozent unterliegen und nicht von ihr befreit sind;
  - d) Anteile an anderen Investmentvermögen entweder in Höhe der bewertungstäglich veröffentlichten Quote ihres Wertes, zu der sie tatsächlich in die vorgenannten Anteile an Kapitalgesellschaften anlegen oder in Höhe der in den Anlagebedingungen des anderen Investmentvermögens festgelegten Mindestquote.

#### **Anteilklassen:**

#### **§ 4 Anteilklassen**

1. Für den Teilfonds können Anteilklassen im Sinne von § 17 Absatz 1 der AABen gebildet werden, die sich hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, des Rücknahmeabschlags, der Pauschalgebühr, der Mindestanlagesumme, der Währung des Anteilwerts, der Höhe des Anteilwerts, des Abschlusses von Währungskurssicherungsgeschäften oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden. Die Bildung von Anteilklassen ist jederzeit zulässig und liegt im Ermessen der Gesellschaft. Es werden folgende Anteilklassen gebildet:
  - Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF (I)
2. Alle Anteile einer Anteilklasse haben gleiche Rechte.
3. Der Anteilwert wird für jede Anteilklasse gesondert errechnet, indem die Kosten der Auflegung neuer Anteilklassen, die Ausschüttungen (einschließlich der aus dem Fondsvermögen ggf. abzuführenden Steuern), die Pauschalgebühr ggf. einschließlich Ertragsausgleich, ausschließlich dieser Anteilklasse zugeordnet werden.
4. Die bestehenden Anteilklassen werden sowohl im Verkaufsprospekt als auch im Jahres- und Halbjahresbericht einzeln aufgezählt. Die Anteilklasse kennzeichnenden Ausgestaltungsmerkmale werden im Verkaufsprospekt und im Jahres- und Halbjahresbericht im Einzelnen beschrieben.
5. Der Abschluss von Währungskurssicherungsgeschäften ausschließlich zugunsten einer einzigen Anteilklasse ist nicht vorgesehen, jedoch grundsätzlich zulässig. Als Währungskurssicherungsinstrumente sind nur Devisentermingeschäfte, Währungs-Futures, Währungsoptionsgeschäfte und Währungsswaps sowie sonstige Währungskurssicherungsgeschäfte soweit sie den Derivaten im Sinne des § 197 Absatz 1 KAGB entsprechen, zulässig.

Ausgaben und Einnahmen aufgrund eines Währungskurssicherungsgeschäfts werden ausschließlich der betreffenden Anteilklasse zugeordnet.

## **Anteile, Ausgabeaufschlag, Rücknahmeabschlag, Rücknahme von Anteilen und Kosten:**

### **§ 5 Anteile**

1. Die Anteile der Anteilklasse Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF (I) werden als Inhaberanteile ausgegeben.
2. Die Anleger sind an den Vermögensgegenständen des Teilfonds in Höhe ihrer Anteile als Miteigentümer nach Bruchteilen beteiligt.

### **§ 6 Ausgabeaufschlag und Rücknahmeabschlag**

1. Der Ausgabeaufschlag beträgt 5 Prozent des Anteilwertes. Es steht der Gesellschaft frei, einen niedrigeren Ausgabeaufschlag zu berechnen. Der Ausgabeaufschlag steht der Gesellschaft zu.
2. Der Rücknahmeabschlag beträgt 5 Prozent des Anteilwertes. Es steht der Gesellschaft frei, einen niedrigeren Rücknahmeabschlag zu berechnen. Der Rücknahmeabschlag steht der Gesellschaft zu. Erfolgt die Rückgabe über die Börse beträgt der Rücknahmeabschlag 0 Prozent.

### **§ 7 Kosten**

1. Die Gesellschaft erhält für die Verwaltung der Anteilklasse Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF (I) des Teilfonds aus dem Fondsvermögen eine Vergütung (die Pauschalgebühr) in Höhe von bis zu 0,19 Prozent pro Jahr auf Basis des börsentäglich nach § 19 der AABen ermittelten Nettoinventarwertes. Es steht der Gesellschaft frei, eine niedrigere Pauschalgebühr zu berechnen.
2. Die Gesellschaft gibt für jede Anteilklasse im Verkaufsprospekt im Jahres- und Halbjahresbericht die erhobene Pauschalgebühr an.
3. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilklasse des Teilfonds berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen.
4. Mit der Pauschalgebühr nach Absatz 1 sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht in den Nr. 5 ff. etwas Abweichendes geregelt ist. Dabei sind von der Pauschalgebühr nach Absatz 1 folgende Kosten erfasst:
  - a) Kosten für die Tätigkeit der Verwahrstelle,
  - b) Bankübliche Depotgebühren, ggf. einschließlich der banküblichen Kosten für die Verwahrung ausländischer Wertpapiere im Ausland, sowie mit der Verwahrung im Zusammenhang stehende Steuern,
  - c) die Kosten im Zusammenhang mit der laufenden Kontoführung,
  - d) die Kosten für die gesetzlich geforderten Drucke und für die Information der Anleger des Teilfonds mittels eines dauerhaften Datenträgers. Anfallende Kosten für Informationen über Fondsverschmelzungen und Informationen über Maßnahmen im Zusammenhang mit Anlagegrenzverletzungen oder Berechnungsfehlern bei der Anteilwertermittlung trägt die Gesellschaft selbst,
  - e) die Kosten für den Druck und Versand der für die Anleger bestimmten gesetzlich vorgeschriebenen Verkaufsunterlagen (Jahres- und Halbjahresberichte, Verkaufsprospekt, wesentliche Anlegerinformationen) im Zusammenhang mit dem Teilfonds,
  - f) die Kosten für die Prüfung des Teilfonds durch den Abschlussprüfer des Sondervermögens,

- g) die Kosten für die Bekanntmachung der Besteuerungsgrundlagen und der Bescheinigung, dass die steuerlichen Angaben nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden,
  - h) die Gebühren und Kosten, die von staatlichen Stellen in Bezug auf den Teilfonds erhoben wurden,
  - i) die Kosten für Rechts- und Steuerberatung im Hinblick auf den Teilfonds,
  - j) die Kosten sowie jegliche Entgelte, die mit dem Erwerb und/oder der Verwendung bzw. Nennung eines Vergleichsmaßstabes oder Finanzindizes anfallen können,
  - k) die Kosten, die im Zusammenhang mit der Herbeiführung, Aufrechterhaltung und Beendigung von Börsennotierungen der Anteile anfallen,
  - l) die Kosten für die Beauftragung von Stimmrechtsbevollmächtigten, und
  - m) die Kosten für die Analyse des Anlageerfolges des Teilfonds durch Dritte.
5. Nicht gemäß Absatz 1 abgegolten sind Kosten, die im Zusammenhang mit dem Erwerb und der Veräußerung von Vermögensgegenständen entstehen („Transaktionskosten“).
6. Nicht gemäß Absatz 1 abgegolten sind Aufwendungen für die Geltendmachung und Durchsetzung von Rechtsansprüchen durch die Gesellschaft für Rechnung des Teilfonds sowie der Abwehr von gegen die Gesellschaft zu Lasten des Teilfonds erhobenen Ansprüchen.
- Diese Aufwendungen können dem Teilfonds zusätzlich zu der Pauschalgebühr gemäß Absatz 1 belastet werden.
7. Die Gesellschaft hat im Jahresbericht und im Halbjahresbericht den Betrag der Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge offen zu legen die dem Teilfonds im Berichtszeitraum für den Erwerb und die Rücknahme von Anteilen im Sinne des § 196 KAGB berechnet worden sind. Beim Erwerb von Anteilen, die direkt oder indirekt von der Gesellschaft selbst oder einer anderen Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Gesellschaft durch eine wesentlich unmittelbare oder mittelbare Beteiligung verbunden ist, darf die Gesellschaft oder die andere Gesellschaft für den Erwerb und die Rücknahme keine Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge berechnen. Die Gesellschaft hat im Jahresbericht und im Halbjahresbericht die Vergütung offen zu legen, die dem Teilfonds von der Gesellschaft selbst, von einer anderen (Kapital-)Verwaltungsgesellschaft oder einer anderen Gesellschaft, mit der die Gesellschaft durch eine wesentliche unmittelbare oder mittelbare Beteiligung verbunden ist, als Pauschalgebühr für die im Teilfonds gehaltenen Anteile berechnet wurde.

## **Ertragsverwendung und Geschäftsjahr:**

### **§ 8 Ausschüttung**

1. Für die ausschüttenden Anteilklassen schüttet die Gesellschaft grundsätzlich die während des Geschäftsjahres für Rechnung des Teilfonds angefallenen und nicht zur Kostendeckung verwendeten anteiligen Zinsen, Dividenden und sonstige Erträge– unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – aus. Realisierte Veräußerungsgewinne– unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – können anteilig ebenfalls zur Ausschüttung herangezogen werden.
2. Die Schlussausüttung erfolgt innerhalb von vier Monaten nach Schluss des Geschäftsjahres. Darüber hinaus kann die Gesellschaft unterjährig Zwischenausüttungen vornehmen.
3. Die Höhe der Zwischenausüttung steht im Ermessen der Gesellschaft. Sie ist nicht verpflichtet die gesamten, bis zum Zeitpunkt einer Zwischenausüttung angesammelten, ausschüttbaren Erträge gemäß Absatz 1 auszuschütten, sondern sie kann die ordentlichen Erträge auch bis zum nächsten Ausschüttungstermin vortragen.

4. Ausschüttbare anteilige Erträge gemäß Absatz 1 können zur Ausschüttung in späteren Geschäftsjahren insoweit vorgetragen werden, als die Summe der vorgetragenen Erträge 15 Prozent des jeweiligen Wertes des Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres nicht übersteigt. Erträge aus Rumpfgeschäftsjahren können vollständig vorgetragen werden.
5. Im Interesse der Substanzerhaltung können anteilige Erträge teilweise, in Sonderfällen auch vollständig, zur Wiederanlage im Teilfonds bestimmt werden.
6. Folgende Anteilklasse ist ausschüttend:
  - Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF (I)

## **§ 9 Thesaurierung der Erträge**

Für die thesaurierenden Anteilklassen legt die Gesellschaft die während des Geschäftsjahres für Rechnung des Teilfonds angefallenen und nicht zur Kostendeckung verwendeten Zinsen, Dividenden und sonstigen Erträge – unter Berücksichtigung des zugehörigen Ertragsausgleichs – sowie die realisierten Veräußerungsgewinne der thesaurierenden Anteilklassen im Teilfonds anteilig wieder an.

## **§ 10 Ertragsverwendung**

Werden für den Teilfonds keine Anteilklassen gebildet, werden Erträge ausgeschüttet. § 8 gilt entsprechend.

## **§ 11 Geschäftsjahr**

Das Geschäftsjahr des Teilfonds beginnt am 1. Juli eines jeden Jahres und endet am 30. Juni des darauf-folgenden Jahres.

## **§ 12 Rückgabefrist und Rückgabebeschränkung**

Die Gesellschaft kann die Rücknahme beschränken, wenn die Rückgabeverlangen der Anleger mindestens 10 Prozent des Nettoinventarwertes erreichen (Schwellenwert).