Prüfstelle der BX Swiss AG

Rule-Check: **Derivate**

Inhalt

[I. Kohärenz 2](#_Toc40262063)

[II. Verständlichkeit 2](#_Toc40262064)

[III. Vollständigkeit 2](#_Toc40262065)

## Kohärenz

Die Prüfung des Prospekts auf Kohärenz erfolgt anhand der Prüfkriterien gemäss Abschnitt II Ziff. 2.2. des Reglements der Prüfstelle der BX Swiss AG:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Kohärenz** | | **Erfüllt?** |
| 2.2. a) | Wurden etwaige in der Zusammenfassung erwähnte Risiken in den Abschnitt über Risikofaktoren aufgenommen? |  |
| 2.2. b) | Entsprechen die Angaben in der Zusammenfassung den Angaben an anderer Stelle im Prospekt? |  |
| 2.2. c) | Entsprechen alle etwaigen Zahlen zur Verwendung des Emissionserlöses der Höhe des zu erwartenden Erlöses? |  |
| 2.2. d) | Stimmen die im Prospekt wiedergegebenen Finanzzahlen mit denjenigen der inkorporierten Finanzberichte überein? |  |

## Verständlichkeit

Die Prüfung des Prospekts auf Verständlichkeit erfolgt anhand der Prüfkriterien gemäss Abschnitt II Ziff. 2.3. des Reglements der Prüfstelle der BX Swiss AG:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Verständlichkeit** | | **Erfüllt?** |
| 2.3. a) | Verfügt der Prospekt über ein klares und detailliertes Inhaltsverzeichnis? |  |
| 2.3. b) | Ist der Prospekt frei von unnötigen Wiederholungen? |  |
| 2.3. c) | Sind zusammenhängende Angaben gruppiert? |  |
| 2.3. d) | Wird im Prospekt eine leicht lesbare Schriftgröße verwendet? |  |
| 2.3. e) | Ermöglicht die Struktur des Prospekts den Anlegern das Verständnis des Inhalts? |  |
| 2.3. f) | Sind im Prospekt die Bestandteile von mathematischen Formeln definiert? |  |
| 2.3. g) | Ist der Prospekt nicht in bewusst irreführender Sprache gehalten |  |

## Vollständigkeit

Die Prüfung des Prospekts auf Vollständigkeit erfolgt gemäss Anhang 3 zur Finanzdienstleistungsverordnung FIDLEV:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Mindestinhalt des Prospektes Schema für Derivate** | | |
| **Ziff.** | **Inhalt** | **Seite bzw. Ziff. im Prospekt / Kommentare** |
| **0** | **Erleichterungen und Angaben auf der ersten Seite** |  |
| **0.1** | **Erleichterungen** |  |
|  | Die Erleichterungen nach Artikel 57 sind nachstehend wie folgt gekennzeichnet: |  |
| a. | Erleichterungen für Emittenten nach Artikel 47 Absatz 1 FIDLEG: [\*]; |  |
| b. | Erleichterungen für Emittenten nach Artikel 47 Absatz 2 Buchstabe c FIDLEG: [#]; |  |
| c. | Erleichterung bei öffentlichem Angebot ohne Handelszulassung: [×]; |  |
| d. | Erleichterung bei Handelszulassung ohne öffentliches Angebot: [∞]; |  |
| **0.2** | **Angaben auf der ersten Seite** |  |
| 0.2.1 | Prospekt vom [Datum] genehmigt durch [Name Prüfstelle] am [Datum]. |  |
| 0.2.2 | Bei Beanspruchung einer Ausnahme nach Artikel 51 Absatz 2 FIDLEG: Hinweis darauf, dass eine solche Ausnahme beansprucht wird, der Prospekt noch nicht geprüft und nur per Prospektdatum aktuell ist und dass er bis zum Prüfentscheid nicht aktualisiert oder nachgeführt werden muss. |  |
| 0.2.3 | An prominenter Stelle textlich in Fettschrift hervorgehoben: Hinweis darauf, dass das Derivat: |  |
| a. | keine kollektive Kapitalanlage ist und nicht der Bewilligung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA untersteht; |  |
| b. | ein Emittentenrisiko aufweist; und |  |
| c. | gegebenenfalls nicht von einem beaufsichtigten Institut im Sinne von Artikel 70 Absatz 1 FIDLEG ausgegeben, garantiert oder gleichwertig gesichert ist. |  |
| **1** | **Zusammenfassung (Art. 54 FIDLEV) [[1]](#footnote-1)** |  |
| **1.1** | **Prospekt** |  |
| 1.1.1 | Erklärung, dass die Zusammenfassung als Einleitung zum Prospekt zu verstehen ist; |  |
| 1.1.2 | Erklärung, dass sich die Anlegerin oder der Anleger beim Entscheid zur Investition auf die Angaben im Prospekt in seiner Gesamtheit und nicht auf die Zusammenfassung stützen muss; |  |
| 1.1.3 | Erklärung, dass eine Haftung für die Zusammenfassung nur für den Fall besteht, dass diese irreführend, unrichtig oder widersprüchlich ist, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Prospektes gelesen wird; |  |
| 1.1.4 | Firma des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber; |  |
| 1.1.5 | Sitz des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber; |  |
| 1.1.6 | Rechtsform des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber; |  |
| 1.1.7 | Hervorgehobener Hinweis, sofern das Revisionsunternehmen des Emittenten oder allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber nicht von einer vom Bundesrat  nach Artikel 8 RAG und Anhang 2 RAV anerkannten ausländischen Revisionsaufsichtsbehörde beaufsichtigt wird [×]. |  |
| 1.1.8 | Art der Effekten; |  |
| 1.1.9 | sofern vorhanden Wertpapierkennnummern wie Valorennummer oder ISIN; |  |
| 1.1.10 | bei einem öffentlichen Angebot: die wichtigsten Angaben zum Angebot; |  |
| 1.1.11 | bei einer Handelszulassung: die wichtigsten Angaben zur Handelszulassung; |  |
| 1.1.12 | Prospekt vom [Datum] genehmigt durch [Name Prüfstelle] am [Datum]. |  |
| **1.2** | **Basisprospekt** |  |
| 1.2.1 | Angaben nach den Ziffern 1.1.1–1.1.7; |  |
| 1.2.2 | Art derjenigen Effekten, welche im Basisprospekt beschrieben sind. Die Art der Effekten kann gemäss der Swiss Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte (SVSP) mit Kapitalschutzprodukte, Renditeoptimierungsprodukte, Partizipationsprodukte, Hebelprodukte oder Produkte mit Referenzschuldner angegeben werden. |  |
| 1.2.3 | Hinweis, dass die wichtigsten Angaben zu den Effekten für ein allfälliges bestimmtes öffentliches Angebot oder eine bestimmte Handelszulassung in den endgültigen Bedingungen ergänzt werden; |  |
| 1.2.4 | Hinweis, dass die wichtigsten Angaben zum Angebot für ein allfälliges bestimmtes öffentliches Angebot in den endgültigen Bedingungen ergänzt werden. |  |
| 1.2.5 | Hinweis, dass die wichtigsten Angaben in den endgültigen Bedingungen ergänzt werden. |  |
| 1.2.6 | a. Basisprospekt vom [Datum] genehmigt durch [Name Prüfstelle] am [Datum]; |  |
|  | b. Hinweis, dass die endgültigen Bedingungen so bald wie möglich nach Vorliegen der endgültigen Angaben, bei einer Zulassung zum Handel spätestens zum Zeitpunkt der Zulassung der betreffenden Effekte zum Handel, veröffentlicht und bei der Prüfstelle hinterlegt werden. |  |
| **2** | **Angaben über den Emittenten und allfällige Garantie- und**  **Sicherheitengeber (Registrierungsformular)** |  |
| **2.1** | **Risiken** |  |
| 2.1 | Darstellung der wesentlichen Risiken in Bezug auf den Emittenten und allfällige Garantie- oder Sicherheitengeber. |  |
| **2.2** | **Allgemeine Angaben über den Emittenten und über allfällige**  **Garantie- oder Sicherheitengeber** |  |
| 2.2.1 | Firma; |  |
| 2.2.2 | Sitz; |  |
| 2.2.3 | Ort der Hauptverwaltung, sofern dieser nicht mit dem Sitz zusammenfällt [#]; |  |
| 2.2.4 | Rechtsform [#]; |  |
| 2.2.5 | Rechtsordnung, die auf Emittenten und allfällige Garantie- oder Sicherheitengeber Anwendung findet und unter der sie bestehen [#]; |  |
| 2.2.6 | Datum der Gründung und vorgesehene Dauer des Bestehens, sofern diese nicht unbestimmt ist [#]; |  |
| 2.2.7 | Zweck, gegebenenfalls unter Bezugnahme auf die betreffende Bestimmung der Statuten oder des Gesellschaftsvertrages oder Wiedergabe des vollständigen Wortlautes [#]; |  |
| 2.2.8 | Datum der Statuten oder des Gesellschaftsvertrags des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber [#]; |  |
| 2.2.9 | sofern vorhanden Bezeichnung des Registers, Datum der Eintragung in das Register und gegebenenfalls Firmen- oder Registernummer [#]; |  |
| 2.2.10 | gegebenenfalls Darstellung der operativen Konzernstruktur; |  |
| **2.3** | **Angaben über Verwaltungsrat, Geschäftsleitung, Revisionsstelle und weitere Organe des Emittenten und allfälliger Garantie oder Sicherheitengeber** |  |
| 2.3.1 | Personelle Zusammensetzung [#] |  |
|  | Namen und Geschäftsadressen nachstehender Personen: |  |
| a. | der Mitglieder der Verwaltungs-, Geschäftsführungs- und Aufsichtsorgane; |  |
| b. | sofern die Geschäftsführung delegiert wurde: der mit der Geschäftsführung betrauten Mitglieder des oberen Managements und der Geschäftsleitung; |  |
| c. | allfällige weitere Organe einschliesslich von deren personellen Zusammensetzung; |  |
| d. | allfällige persönlich haftende Gesellschafterinnen oder Gesellschafter namentlich bei Kommanditaktien-gesellschaften; |  |
| e. | der Gründerinnen oder der Gründer bei Gesellschaften, welche seit weniger als fünf Jahren bestehen. |  |
| 2.3.2 | Revisionsorgan oder Hinweis auf einen Verzicht auf die eingeschränkte Revision nach Artikel 727a Absatz 2 OR |  |
| a. | Name oder Firma und Adresse des gesetzlich zugelassenen Revisionsorgans; |  |
| b. | wurde für das laufende Geschäftsjahr ein anderes Revisionsorgan gewählt, so ist dies anzugeben; |  |
| c. | falls das Revisionsorgan während des Zeitraums der von im Prospekt veröffentlichten Jahresabschlüssen abgewählt bzw. entlassen, nicht wiedergewählt wurde oder es sich von selbst zurückgezogen hat: Offenlegung der entsprechenden Gründe. |  |
| **2.4** | **Geschäftstätigkeit des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber** |  |
| 2.4.0 | Allgemeines |  |
|  | Ist der Emittent oder Garantie- oder Sicherheitengeber eine Konzernobergesellschaft, sind die folgenden Angaben über die Geschäftstätigkeit konzernweit auf konsolidierter Basis zu machen. |  |
| a. | Die gemäss Ziff. 2.4.1–2.4.2 erforderlichen Angaben, soweit diese für die Beurteilung der Geschäftstätigkeit und Ertragskraft von wesentlicher Bedeutung sind; |  |
| b. | falls diese Angaben durch aussergewöhnliche Ereignisse beeinflusst worden sind: besonderer Hinweis darauf; |  |
| c. | Angaben über die wesentlichen Geschäftsaussichten mit dem Hinweis darauf, dass diese mit Ungewissheit behaftet sind. |  |
| 2.4.1 | Haupttätigkeit [#] |  |
| a. | Beschreibung der aktuellen Haupttätigkeitsbereiche unter Angabe der wichtigsten erbrachten Dienstleistungen. |  |
| 2.4.2 | Gerichts-, Schieds- und Administrativverfahren |  |
| a. | Angaben über hängige oder drohende Gerichts-, Schieds- oder Administrativverfahren, soweit diese von wesentlicher Bedeutung für die Vermögens- oder Ertragslage sind; |  |
| b. | entsprechende Negativerklärung, falls keine Verfahren nach Buchstabe a hängig oder angedroht sind. |  |
| **2.5** | **Kapital und Stimmrechte des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber** |  |
| 2.5.0 | Allgemeines |  |
|  | Sofern es sich beim Garantie- oder Sicherheitengeber um ein Institut nach Artikel 70 Absatz 1 FIDLEG handelt, genügen die Angaben lediglich über den Garantie- oder Sicherheitengeber. |  |
| 2.5.1 | Kapitalstruktur [#] |  |
| a. | Angabe des Betrags des ordentlichen, genehmigten und bedingten Kapitals per Stichtag des Jahresabschlusses; |  |
| b. | Zahl, Gattung und Nennwert der Effekten, jeweils unter Angabe der Hauptmerkmale, wie Stimmrechte, Dividendenberechtigung, Vorzugsrechte und ähnliche Berechtigungen unter Hinweis auf den nicht einbezahlten Teil auf dem ordentlichen Kapital; |  |
| c. | gegebenenfalls Angabe, dass Beteiligungspapiere über eine Zulassung zum Handel auf einem Handelsplatz verfügen. |  |
| 2.5.2 | Ausstehende Anleihen in summarischer Darstellung, soweit diese nicht irreführend ist [#] |  |
|  | Sofern wesentlich, ausstehende Anleihen, wobei zu unterscheiden ist zwischen durch dingliche Sicherheiten oder auf andere Art durch den Emittenten oder durch Dritte sichergestellten und nicht sichergestellten Anleihen unter  Aufführung von Zins, Verfalldatum und Währung. |  |
| 2.5.3 | Eigene Beteiligungspapiere [#] |  |
|  | Anzahl der vom Emittenten oder vom Garantie- oder Sicherheitengeber selber oder im Auftrag gehaltenen eigenen Beteiligungspapiere, einschliesslich  der eigenen Beteiligungspapiere, die eine andere Gesellschaft hält, an der sie mehrheitlich beteiligt sind. |  |
| **2.6** | **Jahres- und Zwischenabschlüsse des Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber** |  |
| 2.6.1 | Jahresabschlüsse |  |
| a. | Der zuletzt veröffentlichte Finanzbericht mit den für die letzten vollen zwei Geschäftsjahre unter Anwendung eines anerkannten Rechnungslegungsstandards erstellten und vom Revisionsorgan geprüften Jahresabschlüssen. Gesellschaften, welche in ihrer wirtschaftlichen Substanz erst seit einer kürzeren Dauer bestehen: entsprechende Reduktion des  Zeitraums der darzustellenden Jahresabschlüsse; |  |
| b. | statutarischer Abschluss für das letzte Geschäftsjahr, soweit dieser für die Gewinnausschüttung oder andere Rechte der Inhaberinnen und Inhaber der Derivate von Bedeutung ist. |  |
| 2.6.2 | Aktuelle Bilanz |  |
| a. | Bei neugegründeten Gesellschaften: geprüfte Eröffnungsbilanz bzw. nach allfällig erfolgter Sacheinlage geprüfte Bilanz. Die Ziffern 2.6.3– 2.6.6 sind dabei sinngemäss anwendbar; |  |
| b. | Auf die Wiedergabe der Eröffnungsbilanz oder Bilanz nach Sacheinlage kann verzichtet werden, wenn der Prospekt einen oder mehrere Jahresabschlüsse nach den Ziffern 2.6.3–2.6.6 enthält. |  |
| 2.6.3 | Prüfung der Jahresabschlüsse |  |
|  | Wiedergabe des Berichts des Revisionsorgans für die im Prospekt offengelegten geprüften Jahresabschlüsse. |  |
| 2.6.4 | Stichtag |  |
|  | Der Stichtag des letzten geprüften Jahresabschlusses darf zum Zeitpunkt der Publikation des Prospektes nicht länger als 18 Monate zurückliegen. |  |
| 2.6.5 | Zwischenabschluss bei öffentlichem Angebot ohne Handelszulassung (x) (\*) |  |
|  | Zusätzlicher Zwischenabschluss nach demselben Rechnungslegungsstandard wie beim Jahresabschluss für mindestens die ersten sechs Monate des Geschäftsjahres, wenn der Stichtag des letzten geprüften Jahresabschlusses zum Zeitpunkt der Publikation des Prospektes mehr als neun Monate zurückliegt. |  |
| 2.6.6 | Wesentliche Veränderungen seit dem letzten Jahresabschluss (bei einem Basisprospekt zusätzlich in die endgültigen Bedingungen aufzunehmen) |  |
| a. | Wesentliche Änderungen, die seit dem Abschluss des letzten Geschäftsjahres oder dem Stichtag des Zwischenabschlusses in der Vermögens-, Ertrags- und Finanzlage eingetreten sind; |  |
| b. | entsprechende Erklärung, falls beim Emittenten keine wesentlichen Änderungen eingetreten sind. |  |
| 2.6.7 | Sofern es sich beim Garantie- oder Sicherheitengeber um ein Institut nach Artikel 70 Absatz 1 FIDLEG handelt, genügen die Angaben lediglich über den Garantie- oder Sicherheitengeber. |  |
| **3** | **Angaben über die Effekten (Effektenbeschreibung)** |  |
| **3.0** | **Angaben im Basisprospekt** |  |
|  | Allgemeine Beschreibung der unter dem Basisprospekt auszugebenden Effekten- oder Produkttypen beispielsweise durch Beschreibung der in der SVSP Swiss Derivatives Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte enthaltenen Produkteoberkategorien. |  |
| **3.1** | **Risiken** |  |
|  | Darstellung der wesentlichen Risiken in Bezug auf die Effekten durch Beschreibung des Verlustpotenzials in Worten oder durch grafische Darstellung der Wertentwicklung der Derivate in Abhängigkeit vom Basiswert. |  |
| **3.3** | **Bedingungen** |  |
| 3.2.0 | Allgemeines |  |
| a. | Bei einem Prospekt: Wiedergabe der vollständigen Emissionsbedingungen. |  |
| b. | Bei einem Basisprospekt: Wiedergabe der allgemeinen Emissionsbedingungen und eines Musters der endgültigen Bedingungen. |  |
| 3.2.1 | Währungen |  |
|  | Relevante Währungen der Effekten wie Emissions-, Zinszahlungs-, und/oder Rückzahlungswährung. Bei einer wechselkursabhängigen Auszahlung; Angabe des anwendbaren Wechselkurses. |  |
| 3.2.2 | Stückelung |  |
|  | Gegebenenfalls Stückelung (Denomination) der Effekten. |  |
| 3.2.3 | Rückzahlung |  |
| a. | Rückzahlungsbetrag der Effekten. Falls der Rückzahlungsbetrag auf der Basis einer Formel berechnet werden muss: Angabe der Formel; |  |
| b. | Modalitäten der Rückzahlung. |  |
| 3.2.4 | Zinssatz / Coupon |  |
|  | Zinssatz, bei Effekten mit variablem Zinssatz zudem die Zinsperioden und die Bedingungen für die Festlegung des Zinssatzes. |  |
| 3.2.5 | Zinstermine |  |
|  | Beginn der Verzinsung und Zinstermine. |  |
| 3.2.6 | Laufzeit |  |
|  | Laufzeit der Effekten. |  |
| 3.2.7 | Verjährung |  |
|  | Fristen für die Verjährung der Ansprüche auf Zinsen und Rückzahlung. |  |
| 3.2.8 | Nachrangigkeit |  |
|  | Gegebenenfalls Angaben über eine Nachrangigkeit der Effekten gegenüber anderen schon bestehenden oder künftigen Verbindlichkeiten des Emittenten. |  |
| 3.2.9 | Anwendbares Recht und Gerichtsstand |  |
|  | Das auf die Effekten anwendbare Recht und der Gerichtsstand. |  |
| 3.2.10 | Zahl-, Berechnungs- und Ausübungsstellen |  |
|  | Gegebenenfalls Angaben über die Zahl-, Berechnungs- und Ausübungsstelle. |  |
| 3.2.11 | Ausgestaltung der Effekten |  |
| a. | Angabe ob Wertpapier, Globalurkunde oder Wertrecht; |  |
| b. | bei nicht verbrieften Effekten: Angaben zu den Übertragungsmöglichkeiten und zum Nachweis der Rechtsträgerschaft oder, bei Wertrechten, Angabe der massgebenden gesetzlichen Bestimmung und der Person,  die das Wertrechtebuch und gegebenenfalls das Hauptregister der betreffenden Emission führt; |  |
| c. | bei Effekten, die in Form einer oder mehrerer Globalurkunden auf Dauer verbrieft oder als Wertrechte ausgegeben werden: hervorgehobener Hinweis, dass der Anleger die Auslieferung von Einzelurkunden nicht verlangen kann. |  |
| 3.2.12 | Mit den Effekten verbundene Rechte und Anpassungsmodalitäten |  |
| a. | Angaben über die mit den Effekten verbundenen Rechte; |  |
| b. | bei Effekten mit dynamischer Struktur: Angabe, wie die preisrelevanten Parameter der Produktbedingungen wie die Zusammensetzung der Basiswerte während der Laufzeit verändert werden können und Angabe, ob und welche Anpassungen der Emittent vornehmen kann. |  |
| 3.2.13 | Ausübungsverfahren |  |
|  | Allgemeine Hinweise dazu, wie gegebenenfalls die Ausübung durch den Anleger vorgenommen werden muss, und insbesondere zu Zeitpunkt und Ort der Einreichung der Ausübungserklärung. |  |
| 3.2.14 | Ausübungsmodalitäten |  |
|  | Angabe des massgebenden Ausübungsverhältnisses sowie des Zeitpunkts der letztmöglichen Ausübung, einschliesslich der Uhrzeit, sofern diese nicht auf den Handelsschluss fällt. Gesonderter Hinweis auf eine Beschränkung der maximal zulässigen Ausübungsmenge pro Tag sowie die Festlegung von  minimalen Ausübungsmengen. |  |
| 3.2.15 | Anpassungsmöglichkeiten |  |
| a. | Angaben über die Anpassungen der Bedingungen der Effekten bei unvorhersehbaren Veränderungen der Basiswerte wie einem Titelumtausch oder ähnlichen Transaktionen; |  |
| b. | gegebenenfalls Angaben über die Möglichkeit von nachträglichen Anpassungen der Bedingungen unabhängig von unvorhersehbaren Veränderungen der Basiswerte. |  |
| 3.2.16 | Kapitalschutz |  |
| a. | Höhe und Berechnung des Kapitalschutzes; |  |
| b. | gegebenenfalls Angaben, wenn der Kapitalschutz von Bedingungen wie dem Erreichen, Über- oder Unterschreiten von Schwellenwerten abhängig ist. |  |
| 3.2.17 | Stillhalter-Optionen |  |
|  | Erklärung unter dem Titel «Absicherung des Emittenten», wonach die entsprechende Anzahl Basiswerte dem Emittenten oder den Inhaberinnen und Inhabern der Optionen verpfändet oder hinterlegt ist, damit der Emittent jederzeit seinen Verpflichtungen zur Lieferung der Titel nachkommen kann. |  |
| 3.2.18 | Wechsel des Emittenten- oder der Garantie- oder Sicherheitengeber |  |
|  | Gegebenenfalls Voraussetzungen für einen Wechsel. |  |
| **3.3** | **Basiswerte** |  |
| 3.3.1 | Allgemeine Angaben |  |
| a. | Allgemeine Bezeichnung der Basiswerte und, sofern es keine öffentliche zugängliche Beschreibung der Basiswerte gibt, kurze Beschreibung der Basiswerte; |  |
| b. | sofern vorhanden, ISIN der Basiswerte; andernfalls ein anderweitiges, eindeutiges Identifikationsmerkmal; |  |
| c. | sind die Basiswerte an einem Handelsplatz gehandelt: Angabe des Handelsplatzes, ansonsten Angabe, wo die Preisermittlung der Basiswerte öffentlich zugänglich ist. |  |
| 3.3.2 | Zusätzliche Angaben bei Effekten auf Beteiligungsrechte oder Forderungsrechte |  |
| a. | Gegebenenfalls Hinweis, falls eine Lieferung der Basiswerte vorgesehen und die Übertragbarkeit der Basiswerte beschränkt ist; |  |
| b. | Hinweis, wo die aktuellen Geschäftsberichte der Emittenten der Basiswerte während der gesamten Laufzeit der Effekten kostenlos bezogen werden können, sofern diesen nicht auf der Internetseite des Emittenten der Basiswerte zugänglich ist oder über diese bezogen werden kann; |  |
| 3.3.3 | Zusätzliche Angaben bei Effekten auf kollektive Kapitalanlagen |  |
|  | Angabe der Fondsleitung oder der herausgebenden Gesellschaft und Angaben zur Zusammensetzung oder zum Anlageuniversum der jeweiligen kollektiven Kapitalanlage, sofern diese Informationen nicht öffentlich zugänglich sind. |  |
| 3.3.4 | Zusätzliche Angaben bei Effekten auf Indizes |  |
| a. | Namen der Stelle, welche den Index berechnet und publiziert (Indexsponsor), sofern diese Informationen nicht öffentlich zugänglich sind; |  |
| b. | Angaben darüber, wo Informationen über das Titeluniversum und die Berechnungsweise des Index öffentlich zugänglich sind; |  |
| c. | Angabe, ob es sich um einen Preis (Price)- oder Performanceindex (Total- Return-Index) handelt. |  |
| 3.3.5 | Zusätzliche Angaben bei Effekten auf standardisierte Optionen und Terminkontrakte |  |
| a. | Kontraktmonate, einschliesslich der Laufzeit und dem Verfall oder Angaben  zum Umschichtungsmechanismus; |  |
| b. | Kontrakteinheit und Preisnotierung. |  |
| 3.3.6 | Zusätzliche Angaben bei Effekten auf Baskets von Basiswerten |  |
| a. | Anfangsfixierung sowie die prozentuale und wo sinnvoll die anteilsmässige Anfangsgewichtung der Baskettitel; |  |
| b. | falls die Zusammensetzung des Baskets vordefinierten Anpassungen unterliegt, ist das zulässige Anlageuniversum zu beschreiben. |  |
| 3.3.7 | Derivate, deren Basiswert während der Laufzeit diskretionär verwaltet wird (*Actively Managed Certificates*) |  |
|  | Hinweis auf die diskretionäre Verwaltung im Prospekt und in den endgültigen Bedingungen. |  |
| a. | Eckwerte der Anlagestrategie wie Titeluniversum, Kriterien der Titelauswahl und Information, wie die Erträge der Basiswerte behandelt werden; |  |
| b. | Name oder Firma und Wohnsitz oder Sitz des Verwalters der Anlagestrategie sowie Angabe der für ihn zuständigen Aufsichtsbehörde oder gegebenenfalls Erklärung, dass er nicht prudenziell beaufsichtigt wird; |  |
| c. | Angaben zu sämtlichen Entschädigungen wie insbesondere Verwaltungsgebühren für den Verwalter der Anlagestrategie , die für das Produkt anfallen; |  |
| d. | Angabe, bei welcher Stelle die Information zur Anlagestrategie kostenfrei bezogen werden kann; |  |
| e. | Angabe, bei welcher Stelle die monatlich aktualisierte und prozentual gewichtete Zusammensetzung des Basiswertes zugänglich ist. |  |
| **3.4** | **Publikation** |  |
| 3.4.1 | Hinweis, wo Mitteilungen über die Effekten und den Emittenten und allfälliger Garantie- oder Sicherheitengeber veröffentlicht werden. |  |
| 3.4.2 | Sollen Mitteilungen mittels Veröffentlichung auf einer Internetseite erfolgen, so muss im Prospekt die Internetseite bezeichnet werden. |  |
| **3.5** | **Beschränkung der Übertragbarkeit, Handelbarkeit** |  |
|  | Übertragbarkeit der Effekten und allfällige Beschränkungen der Handelbarkeit *(Transfer Restrictions)*. |  |
| **3.6** | **Wertpapierkennnummer** |  |
|  | Sofern vorhanden Wertpapierkennnummern wie Valorennummer oder ISIN. |  |
| **3.7** | **Gebühren** |  |
|  | Nach Emission während der Laufzeit bei der Anlegerin oder beim Anleger erhobene Gebühren. |  |
| **3.8** | **Sicherstellung** |  |
| 3.8.1 | Beschreibung der Art und Natur von allfälligen Sicherstellungen. |  |
| 3.8.2 | Auf die Sicherstellung anwendbares Recht und der Gerichtsstand. |  |
| 3.8.3 | Bei Garantien, Bürgschaften oder ähnliche Sicherungsversprechen von Dritten: |  |
| a. | voller Wortlaut, wenn die Prüfstelle nicht wegen dessen grossen Umfangs einer ersatzweisen Darstellung in der Zusammenfassung zustimmt; |  |
| b. | ergänzende Beschreibung, wenn der volle Wortlaut die Rechtsnatur, den Umfang und die Durchsetzbarkeit des Sicherungsversprechens nicht ausreichend darstellt; |  |
| c. | Hinweis an die Anlegerinnen und Anleger auf die Möglichkeit, den vollen Wortlaut kostenlos zu beziehen. |  |
| 3.8.4 | Bei Staatsgarantien: |  |
| a. | voller Wortlaut oder, wenn für den Anleger oder die Anlegerin gleichwertig, Verweisung auf die anwendbaren Gesetzesbestimmungen; |  |
| b. | Angaben zum Inhalt der Staatsgarantie, namentlich dazu, ob sie auch die spezifischen Effekten sicherstellt; |  |
| c. | Angaben zur Geltendmachung und Durchsetzung allfälliger Ansprüche aus dem Sicherungsversprechen gegenüber dem Staat. |  |
| 3.8.5 | Bei einem Keep-Well-Agreement: |  |
| a. | Voller Wortlaut oder, wenn für die Anlegerin oder den Anleger nicht ausreichend, Angaben über die Natur und die Verbindlichkeit des Agreements; darzustellen ist insbesondere:  – dessen rechtliche Durchsetzbarkeit für den Emittenten,  – dessen rechtliche Durchsetzbarkeit für die Anlegerin oder den Anleger, namentlich, ob es direkt gegenüber dem Garantie- oder Sicherheitengeber durchgesetzt werden kann,  – dessen Abänderbarkeit durch die Vertragsparteien mit oder ohne Zustimmung Dritter,  – dessen Abänderung als Fall einer vorzeitigen Rückzahlung,  – der Einschluss des Emittenten in die Konsolidierung der Rechnungslegung der das Agreement abschliessenden Gesellschaft; |  |
| b. | Hinweis darauf, dass es sich nicht um eine Garantie oder eine Solidarbürgschaft handelt. |  |
| **3.9** | **Angaben über die Handelszulassung [×]** |  |
| 3.9.1 | Handelsdauer |  |
|  | Vorgesehene Dauer der Handelbarkeit der Effekten unter Angabe des letzten Handelstags und der Uhrzeit, sofern der Handel nicht bis zum Handelsschluss aufrechterhalten wird. |  |
| 3.9.2 | Handelsmenge |  |
|  | Angabe über die minimale Handelsmenge der Effekten, falls nur ein Vielfaches der Stückelung (Denomination) gehandelt werden kann. |  |
| 3.9.3 | Quotierungsart |  |
|  | Bei Effekten mit Zinskomponente wie Reverse Convertibles: Angabe, ob die Effekten einschliesslich aufgelaufener Marchzinsen gehandelt oder quotiert werden oder die aufgelaufenen Zinsen separat ausgewiesen werden (Flat oder  Dirty-Handel bzw. Clean-Handel). |  |
| **3.10** | **Angaben über das Angebot [∞]** |  |
| 3.10.1 | Ausgabepreis |  |
|  | Ausgabepreis der Effekten |  |
| 3.10.2 | Verkaufsbeschränkungen (*Selling Restrictions*) |  |
|  | Hervorgehobener Hinweis auf allfällige Verkaufs-beschränkungen des ausländischen Rechts. |  |
| **3.11** | **Steuern** |  |
|  | Allfällige Schweizer Quellensteuern, welche auf Einkünfte aus den Effekten  erhoben werden. |  |
| **4.** | **Verantwortung für den Prospekt** |  |
| 4.1 | Angaben über die Gesellschaften oder Personen, die für den Inhalt des Prospektes oder gegebenenfalls für bestimmte bezeichnete Abschnitte die Verantwortung übernehmen |  |
| a. | Firma und Sitz der betreffenden Gesellschaften oder Personen; |  |
| b. | Erklärung der betreffenden Gesellschaften oder Personen, dass ihres Wissens die Angaben richtig sind und keine wesentlichen Umstände ausgelassen wurden. |  |

1. Gemäss Art. 54 Abs. 3 FIDLEV sind gewisse Inhalte der Zusammenfassung in tabellarischer Form widerzugeben [↑](#footnote-ref-1)