

## Produkt

# Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll UCITS ETF Acc

Ein Teilfonds von MULTI UNITS LUXEMBOURG

LU0832435464 - Währung: EUR

Dieser Teilfonds ist in Luxemburg zugelassen.

Verwaltungsgesellschaft: Amundi Luxembourg S.A. (nachfolgend: „wir“) ein Mitglied der Amundi-Unternehmensgruppe, ist zugelassen in Luxemburg und wird beaufsichtigt durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).

Die Aufsicht über die Amundi Luxembourg S.A. in Bezug auf dieses Basisinformationsblatt obliegt der CSSF.

Weitere Informationen finden Sie unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) oder rufen Sie die Nummer +352 2686 8001 an.

Dieses Dokument wurde erstellt am 01/01/2024.

## Um welche Art von Produkt handelt es sich?

**Art:** Anteile eines Teilfonds von MULTI UNITS LUXEMBOURG, einem Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW), der als ICAV errichtet wurde.

**Laufzeit:** Die Laufzeit des Teilfonds ist unbegrenzt. Die Verwaltungsgesellschaft kann den Fonds im Einklang mit den gesetzlichen Bestimmungen durch Liquidation oder Verschmelzung mit einem anderen Fonds auflösen.

**Ziele:** Der Fonds ist ein passiv verwalteter OGAW, der einen Index nachbildet.

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, sowohl die Aufwärts- als auch die Abwärtsentwicklung des „S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll Index“ (der „Referenzindex“) in US-Dollar (USD) zu verfolgen, der für die Bewegung des Marktes für Terminkontrakte repräsentativ ist und sich auf die implizite Volatilität des S&P 500 Index bezieht, und gleichzeitig die Volatilität der Differenz zwischen der Rendite des Fonds und der Rendite des Referenzindex zu minimieren (der „Tracking Error“).

Das voraussichtliche Niveau des Tracking Error unter normalen Marktbedingungen ist im Prospekt des Fonds angegeben.

Die Website <https://us.spindices.com/> enthält detailliertere Informationen über den Referenzindex.

Damit das Engagement aufrechterhalten werden kann, müssen die Futures-Kontraktpositionen „gerollt“ werden. Rollierende Terminkontrakte bestehen aus der Übertragung einer Position auf Terminkontrakte, die sich der Fälligkeit nähern (und in jedem Fall vor Ablauf der Terminkontrakte), auf Terminkontrakte mit einer längeren Fälligkeit.

Anleger sind einem Verlust- oder Gewinnrisiko aus dem Rollgeschäft mit den Terminkontrakten ausgesetzt.

Der Fonds strebt an, sein Ziel durch indirekte Replikation zu erreichen, indem er einen außerbörslichen Swap-Vertrag (Finanzderivate, die ADI) abschließt. Ferner kann der Fonds in ein diversifiziertes Portfolio internationaler Aktien investieren, deren Performance über die ADI gegen die Performance des Referenzindex ausgetauscht wird.

Die aktualisierte Zusammensetzung der Fondsbestände ist verfügbar auf [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

Darüber hinaus wird der indikative Nettoinventarwert auf den Reuters- und Bloomberg-Seiten des Fonds veröffentlicht und kann auch auf der Website der Börsen, an denen der Fonds notiert ist, erwähnt werden.

**Kleinanleger-Zielgruppe:** Dieses Produkt ist für Anleger mit guten Kenntnissen und Erfahrungen mit Anlagen in Fonds bestimmt, die Verluste bis zur Höhe des Anlagebetrags tragen können.

**Rücknahme und Handel:** Die Anteile des Teilfonds sind an einer oder mehreren Börsen notiert bzw. werden dort gehandelt. Unter normalen Umständen können Sie während der Handelszeiten der Börsen mit Anteilen handeln. Nur zugelassene Teilnehmer (z. B. ausgewählte Finanzinstitute) können Anteile direkt mit dem Teilfonds auf dem Primärmarkt handeln. Weitere Einzelheiten finden Sie im Prospekt von MULTI UNITS LUXEMBOURG.

**Ausschüttungspolitik:** Da es sich um eine nicht ausschüttende Anteilsklasse handelt, werden Kapitalerträge wieder angelegt. Die thesaurierende Anteilsklasse behält automatisch alle zurechenbaren Erträge innerhalb des Teilfonds ein und reinvestiert diese, wodurch sich der Wert der thesaurierenden Anteile erhöht.

**Weitere Informationen:** Weitere Informationen über den Teilfonds, einschließlich des Prospekts und der Finanzberichte, sind auf Anfrage kostenlos erhältlich bei: Amundi Luxembourg S.A. in 5, allée Scheffer 2520 Luxembourg, Luxemburg.  
Der Nettoinventarwert des Teilfonds ist verfügbar auf [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu).

**Verwahrstelle:** Societe Generale Luxembourg.

## Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

### RISIKOINDIKATOR



Niedrigeres Risiko

Höheres Risiko



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre lang halten.

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 6 eingestuft, wobei 6 der zweithöchsten Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als hoch eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es sehr wahrscheinlich, dass unsere Fähigkeit beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen.

Zusätzliche Risiken: Das Marktliquiditätsrisiko könnte die Schwankungen der Wertentwicklung des Produkts verstärken.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

Neben den im Risikoindikator einberechneten Risiken können sonstige Risiken die Wertentwicklung des Teilfonds beeinträchtigen. Weitere Informationen finden Sie im Prospekt des MULTI UNITS LUXEMBOURG.

### PERFORMANCE-SZENARIEN

Das dargestellte pessimistische, mittlere und optimistische Szenario veranschaulichen die schlechteste, durchschnittliche und beste Wertentwicklung des Teilfonds in den letzten 10 Jahren. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln. Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten.

**Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen.**

| Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre<br>Anlage 10.000 EUR |                                                                                                  |                                |         |
|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|---------|
| Szenarien                                           |                                                                                                  | Wenn sie aussteigen nach [...] |         |
|                                                     |                                                                                                  | 1 Jahr                         | 5 Jahre |
| Minimum                                             | Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren. |                                |         |
| Stressszenario                                      | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten                                     | 30 €                           | 20 €    |
|                                                     | Jährliche Durchschnittsrendite                                                                   | -99,7 %                        | -71,1 % |
| Pessimistisches Szenario                            | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten                                     | 3.270 €                        | 1.350 € |
|                                                     | Jährliche Durchschnittsrendite                                                                   | -67,3 %                        | -37,5 % |
| Mittleres Szenario                                  | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten                                     | 7.120 €                        | 2.810 € |
|                                                     | Jährliche Durchschnittsrendite                                                                   | -28,8 %                        | -23,4 % |
| Optimistisches Szenario                             | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten                                     | 18.870 €                       | 6.430 € |
|                                                     | Jährliche Durchschnittsrendite                                                                   | 88,7 %                         | -8,5 %  |

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Unberücksichtigt ist auch Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann.

Diese Art von Szenario trat bei einer Investition unter Verwendung eines geeigneten Stellvertreters auf.

Optimistisches Szenario: Diese Art von Szenario ist für eine Anlage zwischen dem 29.09.2017 und dem 30.09.2022 eingetreten.

Mittleres Szenario: Diese Art von Szenario ist für eine Anlage zwischen dem 31.01.2017 und dem 31.01.2022 eingetreten

Pessimistisches Szenario: Diese Art von Szenario ist für eine Anlage zwischen dem 31.01.2014 und dem 31.01.2019 eingetreten.

### Was geschieht, wenn Amundi Luxembourg S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Für jeden Teilfonds von MULTI UNITS LUXEMBOURG wird ein gesonderter Pool von Vermögenswerten angelegt und unterhalten. Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Teilfonds sind von denen anderer Teilfonds sowie von denen der Verwaltungsgesellschaft getrennt, und es besteht keine gegenseitige Haftung. Der Teilfonds ist nicht haftbar, wenn die Verwaltungsgesellschaft oder ein beauftragter Dienstleister ausfällt oder in Verzug gerät.

### Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen und wie lange Sie das Produkt halten. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume.

Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0 % Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt.

- 10.000 EUR investiert.

KOSTEN IM ZEITVERLAUF

| Anlage 10.000 EUR                   |                                |          |
|-------------------------------------|--------------------------------|----------|
| Szenarien                           | Wenn sie aussteigen nach [...] |          |
|                                     | 1 Jahr                         | 5 Jahre* |
| Kosten insgesamt                    | 60 €                           | 80 €     |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten** | 0,6 %                          | 0,5 %    |

\* Empfohlene Haltedauer.  
\*\* Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich -22,92 % vor Kosten und -23,38 % nach Kosten betragen.  
Wir berechnen keine Einstiegsgebühr  
Wenn Sie im Rahmen eines Versicherungsvertrags in dieses Produkt investiert sind, enthalten die angegebenen Kosten keine zusätzlichen Kosten, die Sie möglicherweise tragen könnten.

ZUSAMMENSETZUNG DER KOSTEN

| Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg                       |                                                                                                                                        | Wenn sie aussteigen nach 1 Jahr |
|-------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|
| Einstiegskosten*                                                  | Wir berechnen keine Einstiegsgebühr für dieses Produkt.                                                                                | Bis zu 0 EUR                    |
| Ausstiegskosten*                                                  | Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt, die Person, die Ihnen das Produkt verkauft, kann jedoch eine Gebühr berechnen. | 0 EUR                           |
| Laufende Kosten pro Jahr                                          |                                                                                                                                        |                                 |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 0,60 % des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Dieser Prozentsatz basiert auf den tatsächlichen Kosten des letzten Jahres.                    | 60,00 EUR                       |
| Transaktionskosten                                                | Wir berechnen keine Transaktionsgebühr für dieses Produkt                                                                              | 0,00 EUR                        |
| Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen                   |                                                                                                                                        |                                 |
| Erfolgsgebühren                                                   | Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet.                                                                                 | 0,00 EUR                        |

\* Sekundärmarkt: Da es sich bei dem Teilfonds um einen börsengehandelten Fonds handelt, können Anleger, die keine zugelassenen Teilnehmer sind, Anteile im Allgemeinen nur auf dem Sekundärmarkt kaufen oder verkaufen. Dementsprechend zahlen die Anleger Maklergebühren und/oder Transaktionskosten im Zusammenhang mit ihren Transaktionen an der bzw. den Börse(n). Diese Maklergebühren und/oder Transaktionskosten werden weder vom Teilfonds noch von der Verwaltungsgesellschaft erhoben und sind auch nicht an diese zu zahlen, sondern an den Vermittler des Anlegers selbst. Darüber hinaus können die Anleger auch die Kosten der Geld-Brief-Spannen tragen, d. h. die Differenz zwischen den Preisen, zu denen Aktien gekauft und verkauft werden können.  
Primärmarkt: Zugelassene Teilnehmer, die direkt mit dem Fonds handeln, zahlen die entsprechenden Primärmarkttransaktionskosten.

Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

**Empfohlene Haltedauer:** 5 Jahre basierend auf unserer Beurteilung der Risiko- und Ertragseigenschaften und Kosten des Teilfonds.

Dieses Produkt ist für langfristige Anlagen gedacht; Sie sollten bereit sein, mindestens 5 Jahre lang investiert zu bleiben. Sie können Ihre Anlage jederzeit zurückgeben oder die Anlage länger halten.

**Zeitplan für Aufträge:** Angaben zur Handelshäufigkeit finden sich unter „Um welche Art von Produkt handelt es sich?“. Angaben zu etwaigen Ausstiegsgebühren finden sich im Abschnitt „Welche Kosten entstehen?“.

Wie kann ich mich beschweren?

- Falls Sie sich beschweren möchten, haben Sie folgende Möglichkeiten:
- Rufen Sie unsere Beschwerde-Hotline an unter: +352 2686 8001
  - Schreiben Sie auf dem Postweg an Amundi Luxembourg S.A. – Client Servicing – in 5, allée Scheffer 2520 Luxembourg, Luxemburg
  - Senden Sie uns eine E-Mail an: info@amundi.com

Bitte achten Sie darauf, Ihre Kontaktdaten korrekt anzugeben, um uns die Beantwortung Ihres Anliegens zu ermöglichen. Weitere Informationen sind auf unserer Website [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) verfügbar.  
Beschwerden über die Person, die Sie zu diesem Fonds beraten oder Ihnen diesen verkauft hat, können Sie direkt an diese Person richten.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Sie finden den Prospekt, die Satzung, Basisinformationsblätter für Anleger, Mitteilungen an die Anleger, Finanzberichte sowie weitere Informationsdokumente in Bezug auf den Teilfonds, einschließlich verschiedener veröffentlichter Richtlinien des Teilfonds, auf unserer Website [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). Sie können auch eine Kopie dieser Dokumente am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft anfordern.

**Frühere Wertentwicklung:** Sie können die frühere Wertentwicklung des Teilfonds über die letzten 10 Jahre unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) herunterladen.  
**Performance-Szenarien:** Sie finden monatlich aktualisierte frühere Performance-Szenarien unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu).