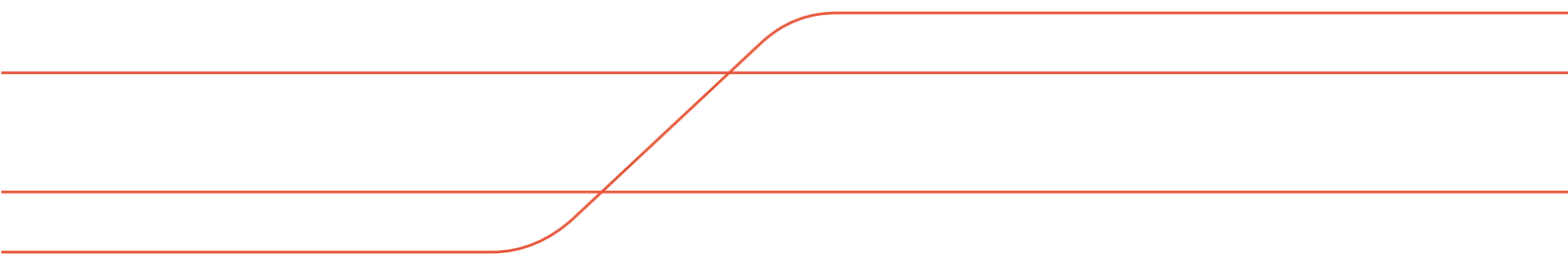


Schema F - Derivate

Datum des Inkrafttretens: 1. Mai 2018



Inhaltsverzeichnis

1	Risikofaktoren.....	4
2	Angaben über den Emittenten.....	4
2.1	Allgemeine Angaben	4
2.1.1	Firma, Sitz, Ort.....	4
2.1.2	Gründung, Dauer	4
2.1.3	Rechtsordnung, Rechtsform.....	4
2.1.4	Zweck	4
2.1.5	Register	4
2.1.6	Konzern.....	4
2.2	Angaben über Verwaltungs-, Geschäftsleitungs- und Revisionsorgane.....	4
2.2.1	Personelle Zusammensetzung.....	4
2.2.2	Revisionsorgan	4
2.3	Geschäftstätigkeit.....	5
2.3.1	Haupttätigkeit.....	5
2.3.2	Gerichts-, Schieds- und Administrativverfahren	5
2.4	Kapital.....	5
2.4.1	Kapitalstruktur	5
2.4.2	Ausstehende Wandel- und Optionsrechte und Anleihen	5
2.4.3	Eigene Beteiligungsrechte	5
2.5	Jahresabschlüsse	5
2.5.1	Jahresabschlüsse	6
2.5.2	Prüfung der Jahresabschlüsse.....	6
2.5.3	Stichtag	6
2.5.4	Angaben über den jüngsten Geschäftsgang des Emittenten	6
2.5.5	Wesentliche Veränderungen seit dem letzten Jahresabschluss.....	6
3	Angaben über die Derivate	6
3.1	Rechtsgrundlage.....	6
3.2	Derivatebedingungen	6
3.2.1	Gesamtbetrag und Aufstockungsmöglichkeit	6
3.2.2	Währungen	6
3.2.3	Anzahl der Derivate oder Nominalbetrag der Emission	6
3.2.4	Stückelung.....	6
3.2.5	Emissionspreis und Zahlungsdatum.....	7
3.2.6	Zinssatz, Ausschüttung	7
3.2.7	Zinstermine.....	7
3.2.8	Laufzeit und Verfall.....	7
3.2.9	Rücknahmemodalitäten.....	7
3.2.10	Vorzeitige Rückzahlung/Kündigungsmöglichkeit	7
3.2.11	Verjährung	7
3.2.12	Steuern	7
3.2.13	Sicherstellung	7
3.2.14	Nachrangigkeit	7
3.2.15	Anwendbares Recht und Gerichtsstand	7
3.2.16	Berechnungs-, Zahl- und Ausübungsstellen.....	7
3.2.17	Trustee.....	8
3.2.18	Mit den Derivaten verbundene Rechte und Anpassungsmodalitäten	8
3.2.19	Ausübungsverfahren	8
3.2.20	Ausübungsmodalitäten.....	8
3.2.21	Verwässerungsschutz.....	8
3.2.22	Veränderung der Basiswerte	8
3.2.23	Kapitalschutz	8

3.2.24	Stillhalter-Optionen	8
3.2.25	Derivate auf eigene Beteiligungsrechte	8
3.3	Erklärung betr. KAG	9
3.4	Ausgestaltung der Derivate	9
3.5	Publikation	9
3.6	Beschränkung der Übertragbarkeit, Handelbarkeit	9
3.7	Valorennummer und ISIN	9
3.8	Settlement Datum	9
3.9	Handelsdauer	9
3.10	Handelsmenge	9
3.11	Quotierungsart	9
3.12	Gebühren	9
3.13	Vertreter	9
4	Angaben zu den Basiswerten	10
4.1	Allgemeine Angaben	10
4.2	Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Beteiligungsrechte oder Forderungsrechte	10
4.3	Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf kollektive Kapitalanlagen	10
4.4	Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Indizes	10
4.5	Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf standardisierte Optionen und Terminkontrakte	10
4.6	Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Baskets von Basiswerten	10
5	Verantwortung für den Kotierungsprospekt	11

1 Risikofaktoren

- Prominente Darstellung (unter einer Rubrik «Risikofaktoren») der Risiken einer Anlage in Derivate. Es steht dem Emittenten offen, das Verlustpotenzial in Worten zu beschreiben oder eine grafische Darstellung der Wertentwicklung der Derivate in Abhängigkeit vom Basiswert abzubilden.

2 Angaben über den Emittenten

Der Kotierungsprospekt muss folgende Angaben über den Emittenten und sein Kapital enthalten:

2.1 Allgemeine Angaben

2.1.1 Firma, Sitz, Ort

- Firma, Sitz und Ort der Hauptverwaltung, wenn dieser nicht mit dem Sitz zusammenfällt, jeweils unter Angabe der Adresse.

2.1.2 Gründung, Dauer

- ^B Datum der Gründung und vorgesehene Dauer des Emittenten, sofern diese nicht unbestimmt ist.

2.1.3 Rechtsordnung, Rechtsform

- Rechtsordnung, unter welcher der Emittent tätig ist und Rechtsform, nach welcher der Emittent besteht.

2.1.4 Zweck

- ^B Zweck des Emittenten unter Bezugnahme auf die betreffende Bestimmung der Statuten oder des Gesellschaftsvertrags.

2.1.5 Register

- ^B Register, Datum der Eintragung in dieses Register und, sofern vorhanden, Registernummer.

2.1.6 Konzern

- ^B Falls der Emittent ein Konzernunternehmen ist: Darstellung der operativen Konzernstruktur des Emittenten.

2.2 Angaben über Verwaltungs-, Geschäftsleitungs- und Revisionsorgane

2.2.1 Personelle Zusammensetzung

- Namen und Geschäftsadresse der nachstehenden Personen:
 1. Mitglieder der Verwaltungs-, Geschäftsleitungs- und gesellschaftsrechtlichen Aufsichtsorgane;
 2. Persönlich haftende Gesellschafter bei einer Kommanditaktiengesellschaft;
 3. Gründer, wenn es sich um eine Gesellschaft handelt, die seit weniger als fünf Jahren besteht.

2.2.2 Revisionsorgan

- Name bzw. Firma und Adresse des gesetzlich zugelassenen Revisionsorgans, welches die Jahresabschlüsse der letzten zwei Geschäftsjahre geprüft hat.

Wurde für das laufende Geschäftsjahr ein anderes Revisionsorgan gewählt, so ist dies anzugeben.

Wurde das Revisionsorgan während des von den historischen Jahresabschlüssen abgedeckten Zeitraums abgewählt bzw. entlassen, nicht wiedergewählt oder hat es sich von selbst zurückgezogen, so sind die Gründe dafür offenzulegen.

^B Im Falle einer zulässigen Kürzung des Kotierungsprospekts gemäss Art. 25 ZR Derivate können die mit «B» bezeichneten Angaben weglassen werden.

2.3 Geschäftstätigkeit

- Die gemäss Ziff. 2.3.1 und 2.3.2 genannten Angaben über die Geschäftstätigkeit, welche für die Beurteilung der Geschäftstätigkeit und Ertragskraft des Emittenten von Bedeutung sind.

Falls diese Angaben durch aussergewöhnliche Ereignisse beeinflusst worden sind, so ist darauf besonders hinzuweisen.

Ist der Emittent eine Konzernobergesellschaft, sind die Angaben über die Geschäftstätigkeit konzernweit auf konsolidierter Basis zu machen. Für andere Emittenten sind die Angaben über die Konzernobergesellschaft ebenfalls anzufügen, sofern sie für die Beurteilung der Derivate und des Emittenten von wesentlicher Bedeutung sind.

2.3.1 Haupttätigkeit

- ^B Beschreibung der aktuellen Haupttätigkeitsbereiche unter Angabe der wichtigsten Arten der vertriebenen Erzeugnisse oder erbrachten Dienstleistungen; Angabe neuer Erzeugnisse oder Tätigkeiten.

2.3.2 Gerichts-, Schieds- und Administrativverfahren

- Hängige oder drohende Gerichts-, Schieds- oder Administrativverfahren, soweit diese von wesentlicher Bedeutung für die Vermögens- oder Ertragslage des Emittenten sind.

Falls keine derartigen Verfahren hängig oder angedroht sind, ist eine entsprechende Negativerklärung in den Kotierungsprospekt aufzunehmen.

2.4 Kapital

2.4.1 Kapitalstruktur

- Betrag des ordentlichen, genehmigten und bedingten Kapitals per Stichtag des Jahresabschlusses, Zahl, Gattung und Nennwert der Effekten, jeweils unter Angabe der Hauptmerkmale, wie Dividendenberechtigung, Vorzugsrechte und ähnliche Berechtigungen unter Hinweis auf den nicht einbezahlten Teil auf dem ordentlichen Kapital.

2.4.2 Ausstehende Wandel- und Optionsrechte und Anleihen

- ^B Ausstehende Wandelanleihen und Anzahl der vom Emittenten oder von Konzerngesellschaften auf die Effekten des Emittenten begebenen Optionen (einschliesslich Mitarbeiteroptionen, die separat darzustellen sind) unter Aufführung von Laufzeit und Wandel- bzw. Optionsbedingungen

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.

Die Angaben können für die oben aufgeführten Kategorien jeweils summarisch erfolgen, soweit eine summarische Darstellung nicht zu einem irreführenden Eindruck führt.

2.4.3 Eigene Beteiligungsrechte

- ^B Anzahl der vom Emittenten oder in seinem Auftrag gehaltenen eigenen Beteiligungsrechte, einschliesslich seiner Beteiligungsrechte, die eine andere Gesellschaft hält, an der er mehr als 50% der Stimmrechte hält.

2.5 Jahresabschlüsse

Siehe hierzu auch:

- Richtlinie Rechnungslegung (RLR)
- Richtlinie komplexe finanzielle Verhältnisse (RLKV)

^B Im Falle einer zulässigen Kürzung des Kotierungsprospekts gemäss Art. 25 ZR Derivate können die mit «B» bezeichneten Angaben weglassen werden.

2.5.1 Jahresabschlüsse

- ^B Für die letzten vollen zwei Geschäftsjahre die nach einem vom Regulatory Board anerkannten Rechnungslegungsstandard erstellten und vom Revisionsorgan geprüften Jahresabschlüsse gemäss Art. 49 KR.

2.5.2 Prüfung der Jahresabschlüsse

- Der Kotierungsprospekt muss den im letzten Geschäftsbericht veröffentlichten Bericht des Revisionsorgans des letzten geprüften Jahresabschlusses enthalten (Art. 49 KR).

2.5.3 Stichtag

- Der Stichtag des letzten geprüften Jahresabschlusses darf zum Zeitpunkt der Publikation des Kotierungsprospekts nicht länger als 18 Monate zurückliegen.

2.5.4 Angaben über den jüngsten Geschäftsgang des Emittenten

- Der Kotierungsprospekt muss allgemeine Angaben über die Geschäftsentwicklung des Emittenten seit Abschluss des Geschäftsjahres, auf das sich der letzte im Kotierungsprospekt veröffentlichte Jahresabschluss bezieht, enthalten, insbesondere über die wichtigsten Tendenzen in der jüngsten Entwicklung des Umsatzes und anderer Angaben, die wesentliche Auswirkungen auf den Geschäftsgang des Emittenten haben.

2.5.5 Wesentliche Veränderungen seit dem letzten Jahresabschluss

- Wesentliche Änderungen, die seit dem Abschluss des letzten Geschäftsjahres oder dem Stichtag des Zwischenabschlusses in der Vermögens-, Ertrags- und Finanzlage des Emittenten eingetreten sind. Andernfalls ist eine Negativerklärung in den Kotierungsprospekt aufzunehmen.

Sofern ein SIX Swiss Exchange-registriertes Emissionsprogramm gemäss Art. 22 Abs. 1 Zusatzreglement Derivate verwendet wird, muss diese Erklärung sowohl im Emissionsprogramm als auch in den Final Terms enthalten sein.

3 Angaben über die Derivate

Der Kotierungsprospekt muss folgende Angaben über die zu kotierenden Derivate enthalten:

3.1 Rechtsgrundlage

- Rechtsgrundlage, aufgrund deren die Derivate begeben worden sind oder begeben werden.

3.2 Derivatebedingungen

Die Derivatebedingungen sind im Kotierungsprospekt vollständig aufzuführen. Insbesondere sind die folgenden Angaben zu machen:

3.2.1 Gesamtbetrag und Aufstockungsmöglichkeit

- Gesamtbetrag der Emission. Ist dieser Betrag nicht festgesetzt oder kann er erhöht werden (zum Beispiel durch Aufstockung), so muss dies erwähnt werden.

3.2.2 Währungen

- Relevante Währungen der Derivate (u.a. Emissions-, Ausübungs-, Zinszahlungs- und/oder Rückzahlungswährung). Bei einer wechselkursabhängigen Auszahlung ist zudem der anwendbare Wechselkurs anzugeben.

3.2.3 Anzahl der Derivate oder Nominalbetrag der Emission

- Anzahl der Derivate oder Nominalbetrag der Emission, sofern anwendbar.

3.2.4 Stückelung

- Stückelung der Derivate, sofern anwendbar.

^B Im Falle einer zulässigen Kürzung des Kotierungsprospekts gemäss Art. 25 ZR Derivate können die mit «B» bezeichneten Angaben weggelassen werden.

3.2.5 Emissionspreis und Zahlungsdatum

- Emissionspreis und Zahlungsdatum, sofern anwendbar.

3.2.6 Zinssatz, Ausschüttung

- Bei verzinslichen Derivaten und Derivaten mit vorgesehener Ausschüttung: Zinssatz bzw. vorgesehene Ausschüttung; bei verzinslichen Derivaten und Derivaten mit vorgesehener Ausschüttung mit variablem Zinssatz bzw. variabler Ausschüttung zudem die Zins- bzw. Ausschüttungsperioden und die Bedingungen für die Festlegung des Zinssatzes bzw. des Betrages der Ausschüttung.

3.2.7 Zinstermine

- Bei verzinslichen Derivaten und Derivaten mit vorgesehener Ausschüttung:
Beginn der Verzinsung bzw. der Berechnungsperiode für die Ausschüttung und Termine für die Auszahlung des Zinses bzw. der Ausschüttung sowie Angabe des Ex-Tages.

3.2.8 Laufzeit und Verfall

- Laufzeit der Emission unter Angabe des Emissions- und Verfalldatums.

3.2.9 Rücknahmemodalitäten

- Rücknahmemodalitäten der Derivate.
Falls die Rücknahmemodalitäten auf der Basis einer Formel berechnet werden müssen, Angabe der zugrundeliegenden Formel(n).

3.2.10 Vorzeitige Rückzahlung/Kündigungsmöglichkeit

- Modalitäten einer vorzeitigen Rückzahlung.

3.2.11 Verjährung

- Fristen für die Verjährung der Ansprüche auf Zinsen oder Ausschüttungen und Rückzahlung.

3.2.12 Steuern

- Allfällige Quellensteuern, welche auf Einkünfte aus den Derivaten erhoben werden, sowie Angaben über eine etwaige Übernahme von Quellensteuern durch den Emittenten.
Angaben zu allfälligen Steuerfolgen, welche beim Erwerb der Basiswerte eintreten.

3.2.13 Sicherstellung

- Beschreibung der Art und Natur von allfälligen Sicherstellungen.
Im Falle von Garantien, Bürgschaften oder ähnlichen Sicherungsversprechen von Dritten ist der volle Wortlaut in den Kotierungsprospekt aufzunehmen.

3.2.14 Nachrangigkeit

- Angaben über eine allfällige Nachrangigkeit der Derivate gegenüber anderen schon bestehenden oder künftigen Verbindlichkeiten des Emittenten.

3.2.15 Anwendbares Recht und Gerichtsstand

- Rechtsordnung, nach der die Derivate begeben wurden, das anwendbare Recht und der Gerichtsstand.

3.2.16 Berechnungs-, Zahl- und Ausübungsstellen

- Angaben über die Berechnungs-, Zahl- und Ausübungsstelle.

3.2.17 Trustee

- Falls zwischen Emittent und Anlegern ein Treuhänder eingeführt wird (Trusteekonstruktionen), sind im Kotierungsprospekt die folgenden Angaben zu machen:
 1. Kurzporträt des Treuhänders;
 2. Kompetenzen des Treuhänders;
 3. Bedingungen für den Wechsel des Treuhänders;
 4. anwendbares Recht und Gerichtsstand des Treuhandvertrags sowie Hinweis, wo die entsprechenden Verträge zur Einsicht aufliegen.

3.2.18 Mit den Derivaten verbundene Rechte und Anpassungsmodalitäten

- Detaillierte Darstellung der mit den Derivaten verbundenen Rechte.

Bei einem Derivat mit dynamischer Struktur ist zudem darzulegen, wie die preisrelevanten Parameter der Produktbedingungen (z.B. die Zusammensetzung der Basiswerte) während der Laufzeit verändert werden können. Insbesondere ist gesondert darauf hinzuweisen, ob und welche Anpassungen der Emittent nach freiem Ermessen vornehmen kann.

3.2.19 Ausübungsverfahren

- Allgemeine Hinweise, wie die Ausübung durch den Anleger vorgenommen werden muss, falls eine solche vorgesehen ist (u.a. Zeitpunkt und Ort der Einreichung der Ausübungserklärung).

3.2.20 Ausübungsmodalitäten

- Angabe des massgebenden Ausübungsverhältnisses sowie des Zeitpunkts der letztmöglichen Ausübung (einschliesslich der Uhrzeit, sofern diese nicht auf den Handelsschluss fällt). Auf eine Beschränkung der maximal zulässigen Ausübungsmenge pro Tag sowie die Festlegung von minimalen Ausübungsmengen ist gesondert hinzuweisen.

Falls am Laufzeitende keine automatische Barabgeltung des inneren Werts durch den Emittenten vorgesehen ist bzw. nicht ausgeübte Derivate wertlos verfallen, so ist dies anzugeben.

3.2.21 Verwässerungsschutz

- Detaillierte Darstellung des Verwässerungsschutzes, sofern ein solcher vorgesehen ist.

3.2.22 Veränderung der Basiswerte

- Angaben für die Anpassung der Bedingungen der Derivate bei unvorhersehbaren Veränderungen der Basiswerte wie einem Titelumtausch oder ähnlichen Transaktionen.

3.2.23 Kapitalschutz

- Höhe des Kapitalschutzes.

Falls der Kapitalschutz von Bedingungen wie dem Erreichen, Über- oder Unterschreiten von Schwellenwerten verbunden ist, so ist dies aufzuführen. Der Kotierungsprospekt muss zudem Angaben darüber enthalten, wie die Höhe des Kapitalschutzes berechnet wird.

3.2.24 Stillhalter-Optionen

- Werden die Derivate als Stillhalter-Optionen bezeichnet, so ist unter dem Titel «Absicherung des Emittenten» eine Erklärung abzugeben, dass die entsprechende Anzahl Basiswerte dem Emittenten und/oder den Inhabern der Optionen verpfändet oder hinterlegt ist, damit der Emittent jederzeit seinen Verpflichtungen zur Lieferung der Titel nachkommen kann.

3.2.25 Derivate auf eigene Beteiligungsrechte

- Bei Aktionärs- und Mitarbeiteroptionen, welche von an der SIX Swiss Exchange kotierten Gesellschaften begeben werden und zum Bezug eigener Beteiligungsrechte des Emittenten berechtigen, ist auf die Art und Weise der Bereitstellung der entsprechenden Anzahl Basiswerte hinzuweisen; bei Vorliegen von bedingtem Kapital: zum Beispiel Generalversammlungsbeschluss; allenfalls konkrete Darstellung der Hinterlegung von Vorratsaktien.

3.3 Erklärung betr. KAG

- Sofern erforderlich, Erklärung, dass es sich bei dem Derivat nicht um eine kollektive Kapitalanlage im Sinne des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) handelt und es nicht der Bewilligung der FINMA untersteht.

Siehe hierzu auch:

- [Bundesgesetz vom 23. Juni 2006 über die kollektiven Kapitalanlagen \(Kollektivanlagegesetz, KAG\)](#)

3.4 Ausgestaltung der Derivate

- Art der Ausgestaltung der Derivate; falls Wertpapiere gedruckt werden, muss angegeben werden, ob es sich um Inhaber- oder Orderpapiere handelt.

Falls die Derivate nicht verbrieft werden, muss die Regelung der börsenmässigen Übertragungsmöglichkeiten und des Nachweises der Rechtsträgerschaft offen gelegt werden.

Falls die Derivate in Form einer oder mehrerer Globalurkunden auf Dauer verbrieft werden, ist im Kotierungsprospekt deutlich darauf hinzuweisen, dass der Anleger gegebenenfalls die Auslieferung von Einzelurkunden nicht verlangen kann.

3.5 Publikation

- Hinweis, wo Mitteilungen über die Derivate und den Emittenten veröffentlicht werden.

Sollen Mitteilungen mittels Veröffentlichung auf einer Webseite erfolgen, so muss im Kotierungsprospekt beschrieben werden, an welcher Stelle der Webseite die entsprechenden Mitteilungen eingesehen werden können.

3.6 Beschränkung der Übertragbarkeit, Handelbarkeit

- Übertragbarkeit der Derivate und allfällige Beschränkungen der Handelbarkeit. Insbesondere ist deutlich auf allfällige Verkaufsbeschränkungen des ausländischen Rechts hinzuweisen.

3.7 Valorenummer und ISIN

- Valorenummer und ISIN der Valoren.

3.8 Settlement Datum

- Angabe des Zahlungs- oder Liefertermins bei Ausübung oder Verfall des Derivats.

3.9 Handelsdauer

- Vorgesehene Handelsdauer der Derivate unter Angabe des letzten Handelstages einschliesslich der Uhrzeit, zu welcher der Handel eingestellt wird, sofern diese nicht mit dem offiziellen Börsenschluss zusammenfällt.

3.10 Handelsmenge

- Angabe der minimalen Handelsmenge, sofern anwendbar.

3.11 Quotierungsart

- Bei Derivaten mit Zinskomponente (wie z.B. Reverse Convertibles) Angabe, ob das Derivat einschliesslich aufgelaufener Marchzinsen gehandelt bzw. quotiert wird oder die aufgelaufenen Zinsen separat ausgewiesen werden («Flat- oder Dirty-Handel» bzw. «Clean-Handel»).

3.12 Gebühren

- Nach Emission während der Laufzeit beim Anleger erhobene Gebühren sind auszuweisen.

3.13 Vertreter

- Hinweis auf eine allfällige Vertretung durch einen anerkannten Vertreter gemäss Art. 43 KR.

4 Angaben zu den Basiswerten

Der Kotierungsprospekt hat folgende Angaben über den Basiswert zu enthalten:

4.1 Allgemeine Angaben

- 1. allgemeine Bezeichnung bzw. Beschreibung des Basiswerts;
- 2. Firma und Domizil des Emittenten der Basiswerte, sofern anwendbar;
- 3. sofern vorhanden, ISIN der Basiswerte; andernfalls ein anderweitiges, eindeutiges Identifikationsmerkmal;
- 4. Angabe darüber, auf Basis welcher Preisquelle der Basiswerte der Wert des Derivats ermittelt wird. Sind die Basiswerte an einer Börse gehandelt, Angabe des Börsenplatzes, ansonsten Angabe, wo die Preisermittlung des Basiswerts öffentlich zugänglich ist;
- 5. Angabe darüber, welcher der für die Ermittlung des Werts des Derivats massgebliche Preis der Basiswerte ist (z.B. Schlusskurs, arithmetischer Durchschnittskurs über einen bestimmten Zeitraum);
- 6. Angaben darüber, wo Informationen über die vergangene Wertentwicklung der Basiswerte eingeholt werden können.

4.2 Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Beteiligungsrechte oder Forderungsrechte

- 1. falls eine Lieferung des Basiswerts vorgesehen ist: Übertragbarkeit der Basiswerte und allfällige Beschränkungen der Handelbarkeit sowie bei Aktien die Angabe der Titelart (z.B. Namenpapier);
- 2. Hinweis, wo die aktuellen Geschäftsberichte der Emittenten der Basiswerte während der gesamten Laufzeit der Derivate kostenlos bezogen werden können.

4.3 Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf kollektive Kapitalanlagen

- 1. bei kollektiven Kapitalanlagen Angabe der Fondsleitung bzw. der herausgebenden Gesellschaft und Angaben zur Zusammensetzung bzw. zum Anlageuniversum der jeweiligen kollektiven Kapitalanlage;
- 2. Bestätigung, dass die kollektive Kapitalanlage von der FINMA zum Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus bewilligt wurde. Andernfalls ist gesondert darauf hinzuweisen, dass der die kollektive Kapitalanlage über keine Vertriebsbewilligung der FINMA verfügt.

4.4 Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Indizes

- 1. Namen der Stelle, welche den Index berechnet und publiziert (Indexsponsor), sowie Angaben darüber, wo Informationen über die Berechnungsweise öffentlich zugänglich sind;
- 2. Angaben darüber, wo Informationen über das Titeluniversum sowie allfällige Anpassungen der Zusammensetzung (insbesondere Ort und Frist der Bekanntgabe einer Anpassung) öffentlich zugänglich sind;
- 3. Angabe, ob es sich um einen Preis («Price»)- oder Performanceindex («Total-Return-Index») handelt.

4.5 Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf standardisierte Optionen und Terminkontrakte

- 1. Kontraktmonate, einschliesslich der Laufzeit und dem Verfall oder Angaben zum Umschichtungsmechanismus (z.B. Roll-over in den jeweiligen «front end future» Kontrakt);
- 2. Kontrakteinheit und Preisnotierung.

4.6 Zusätzliche Angaben bei Derivaten auf Baskets von Basiswerten

- 1. Anfangsfixierung sowie die prozentuale und wo sinnvoll die anteilmässige Anfangsgewichtung der Baskettitel;
- 2. falls die Zusammensetzung des Baskets vordefinierten oder diskretionären Anpassungen unterliegt, ist das zulässige Anlageuniversum zu definieren.

5 Verantwortung für den Kotierungsprospekt

- Der Kotierungsprospekt muss folgende Angaben enthalten über Personen oder die Gesellschaft, die für den Inhalt des Kotierungsprospekts oder gegebenenfalls für bestimmte bezeichnete Abschnitte die Verantwortung übernehmen:
 1. Namen und Stellung (bei juristischen Personen oder Gesellschaften Firma und Sitz der Personen oder Gesellschaften);
 2. Erklärung dieser Personen oder Gesellschaften, dass ihres Wissens die Angaben richtig sind und keine wesentlichen Umstände ausgelassen wurden.

Sofern ein SIX Swiss Exchange-registriertes Emissionsprogramm gemäss Art. 22 Abs. 1 Zusatzreglement Derivate verwendet wird, müssen die oben erwähnten Angaben sowohl im Emissionsprogramm als auch in den Final Terms enthalten sein.