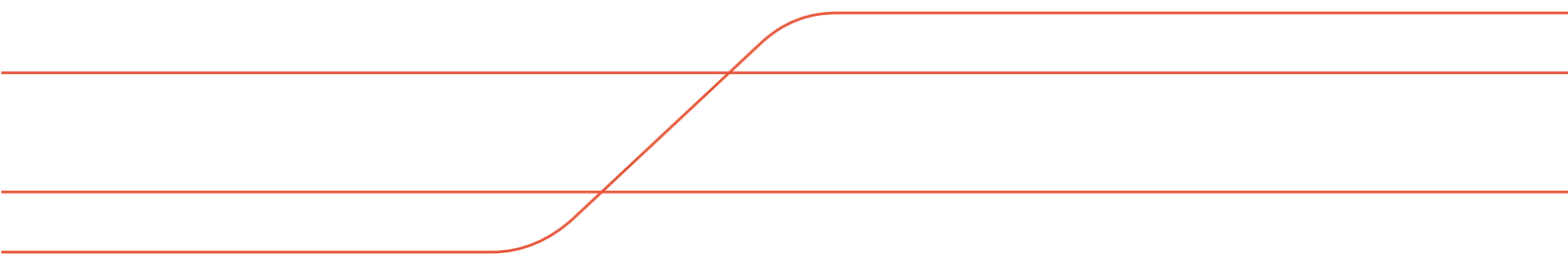


Schema G - Exchange Traded Products

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	Kapitalstruktur	5
2.5	Jahresabschlüsse	5
2.5.1	Jahresabschlüsse	5
2.5.2	Prüfung der Jahresabschlüsse.....	5
2.5.3	Stichtag	5
2.5.4	Angaben über den jüngsten Geschäftsgang des Emittenten (sofern es sich nicht um ein SPV handelt).....	5
2.5.5	Wesentliche Veränderungen seit dem letzten Jahresabschluss.....	6
3	Angaben über die ETPs	6
3.1	Rechtsgrundlage.....	6
3.2	Bedingungen der ETPs	6
3.2.1	Grafische Darstellung der Struktur	6
3.2.2	Gesamtbetrag und Aufstockungs-/Reduktionsmöglichkeit	6
3.2.3	Währungen.....	6
3.2.4	Anzahl der ETPs der Emission	6
3.2.5	Stückelung.....	6
3.2.6	Emissionspreis und Zahlungsdatum.....	6
3.2.7	Laufzeit und Verfall.....	6
3.2.8	Preisbestimmung.....	6
3.2.9	Rückkaufmodalitäten.....	6
3.2.10	Vorzeitige Rückzahlung/Kündigungsmöglichkeit	7
3.2.11	Verjährung	7
3.2.12	Steuern	7
3.2.13	Sicherungsversprechen	7
3.2.14	Besicherung.....	7
3.2.15	Vorgehen im Falle der Verwertung.....	7
3.2.16	Kosten im Falle der Verwertung	7
3.2.17	Anwendbares Recht und Gerichtsstand	7
3.2.18	Berechnungs-, Zahl- und Ausübungsstellen.....	7
3.2.19	Angaben zu den an der Emission Beteiligten	7
3.2.20	Mit den ETPs verbundene Rechte und Anpassungsmodalitäten.....	7
3.2.21	Ausübungsverfahren	8
3.2.22	Ausübungsmodalitäten.....	8
3.2.23	Verwässerungsschutz.....	8
3.2.24	Veränderung der Basiswerte	8
3.3	Erklärung betr. KAG.....	8

3.4	Ausgestaltung der ETPs	8
3.5	Publikation	8
3.6	Beschränkung der Übertragbarkeit, Handelbarkeit	8
3.7	Valorennummer und ISIN	8
3.8	Settlement Datum	8
3.9	Handelsdauer.....	8
3.10	Handelsmenge.....	9
3.11	Gebühren	9
3.12	Vertreter.....	9
4	Angaben zu den Basiswerten	9
4.1	Allgemeine Angaben	9
4.2	Zusätzliche Angaben bei ETPs auf Beteiligungsrechte oder Forderungsrechte	9
4.3	Zusätzliche Angaben bei ETPs auf kollektive Kapitalanlagen	9
4.4	Zusätzliche Angaben bei ETPs auf Indizes.....	9
4.5	Zusätzliche Angaben bei ETPs auf standardisierte Optionen und Terminkontrakte	10
4.6	Zusätzliche Angaben bei ETPs auf Baskets	10
5	Verantwortung für den Kotierungsprospekt	10

1 Risikofaktoren

- Prominente Darstellung (unter einer Rubrik «Risikofaktoren») der Risiken einer Anlage in Exchange Traded Products (ETPs). Das Verlustpotenzial der ETPs ist in Worten und mittels einer grafischen Darstellung (Pay-off-Diagramm) zu beschreiben.

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

- 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

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

2.1.5 Register

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

2.1.6 Konzern

- 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 folgenden Personen:
 1. Mitglieder der Verwaltungs-, Geschäftsleitungs- und gesellschaftsrechtlichen Aufsichtsorgane;
 2. Persönlich haftende Gesellschafter;
 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.

2.3 Geschäftstätigkeit

- Die gemäss Ziff. 2.3.1 und Ziff. 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 (Holding), sind die Angaben über die Geschäftstätigkeit konzernweit auf konsolidierter Basis zu machen. Für andere Emittenten sind die Angaben über die Konzernobergesellschaft (Holding) ebenfalls anzufügen, sofern sie für die Beurteilung der ETP und des Emittenten von wesentlicher Bedeutung sind.

2.3.1 Haupttätigkeit

- 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 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.

2.5 Jahresabschlüsse

Siehe hierzu auch:

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

2.5.1 Jahresabschlüsse

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

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 (sofern es sich nicht um ein SPV handelt)

- 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 Negativklärung in den Kotierungsprospekt aufzunehmen.

Sofern ein SIX Swiss Exchange-registriertes Emissionsprogramm gemäss Art. 16 Abs. 1 Zusatzreglement Exchange Traded Products verwendet wird, muss diese Erklärung sowohl im Emissionsprogramm als auch in den Final Terms enthalten sein.

3 Angaben über die ETPs

- Der Kotierungsprospekt muss den regulatorischen Standard nennen, gemäss welchem die ETPs kotiert werden sowie die folgenden Angaben über die zu kotierenden ETPs enthalten:

3.1 Rechtsgrundlage

- Rechtsgrundlage (gesellschaftsrechtlicher Beschluss o.ä.), aufgrund deren die ETPs begeben worden sind oder begeben werden.

3.2 Bedingungen der ETPs

Die Bedingungen der ETPs sind im Kotierungsprospekt vollständig aufzuführen. Es sind mindestens die folgenden Angaben zu machen:

3.2.1 Grafische Darstellung der Struktur

- Der Kotierungsprospekt hat eine grafische Darstellung der Struktur der ETPs zu enthalten, welche alle an der Struktur Beteiligten, deren Funktion und die Verhältnisse zwischen den Beteiligten aufführt.

3.2.2 Gesamtbetrag und Aufstockungs-/Reduktionsmöglichkeit

- Gesamtbetrag der Emission. Kann dieser aufgestockt/reduziert werden, so ist in einfachen Worten zu beschreiben, wie eine Aufstockung/Reduktion von statten geht.

3.2.3 Währungen

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

3.2.4 Anzahl der ETPs der Emission

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

3.2.5 Stückelung

- Stückelung der ETPs, sofern anwendbar.

3.2.6 Emissionspreis und Zahlungsdatum

- Emissionspreis und Zahlungsdatum, sofern anwendbar.

3.2.7 Laufzeit und Verfall

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

3.2.8 Preisbestimmung

- Angaben darüber, wie der Preis des ETP berechnet wird (unter Angabe eines allfälligen Hebels, Gebühren usw.). Die Preisbestimmung kann auch mittels Angabe einer mathematischen Formel dargestellt werden.

3.2.9 Rückkaufmodalitäten

- Rückkaufmodalitäten der ETPs.

Falls die Rückkaufmodalitäten 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 Ausschüttungen und Rückzahlung.

3.2.12 Steuern

- Allfällige Quellensteuern, welche auf Einkünfte aus den ETPs 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 Sicherungsversprechen

- Im Falle von Garantien, Bürgschaften oder ähnlichen Sicherungsversprechen von Dritten ist der volle Wortlaut des Sicherungsversprechens in den Kotierungsprospekt aufzunehmen.

3.2.14 Besicherung

- Detaillierte Beschreibung des Besicherungsmechanismus.
Der Kotierungsprospekt hat Angaben über die Methodik der Besicherung zu enthalten. Dabei ist anzugeben, welche Sicherheiten bei welcher Verwahrungsstelle hinterlegt werden. Zusätzlich ist das Vorgehen bei der Bewirtschaftung der Sicherheiten sowie die Höhe der Besicherung anzugeben.

3.2.15 Vorgehen im Falle der Verwertung

- Detaillierter Beschrieb der Verwertungsfälle sowie dem Vorgehen bei Verwertung der Sicherheiten. Dabei ist auf die an der Verwertung Beteiligten Bezug zu nehmen sowie deren Funktion im Verwertungsprozess zu beschreiben.
Der Kotierungsprospekt hat den Anleger darüber zu informieren, wie und gegen wen er seine Ansprüche am Verwertungserlös der Effekten geltend machen kann.

3.2.16 Kosten im Falle der Verwertung

- Der Kotierungsprospekt hat sämtliche in Bezug auf die Verwertung der Sicherheiten anfallenden Kosten aufzuführen.

3.2.17 Anwendbares Recht und Gerichtsstand

- Rechtsordnung, nach der die ETPs begeben wurden. Sofern die ETPs ausländischem Recht unterstellt sind, muss im Kotierungsprospekt auf der vorderen Umschlagseite textlich hervorgehoben in Fettschrift darauf hingewiesen werden.
Gerichtsstand. Sofern kein Gerichtsstand in der Schweiz besteht, muss im Kotierungsprospekt auf der vorderen Umschlagseite textlich hervorgehoben in Fettschrift darauf hingewiesen werden.

3.2.18 Berechnungs-, Zahl- und Ausübungsstellen

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

3.2.19 Angaben zu den an der Emission Beteiligten

- Für sämtliche an der Emission Beteiligten sind im Kotierungsprospekt die folgenden Angaben zu machen:
 1. Kurzporträt des Beteiligten (Angaben gemäss Ziff. 2.1);
 2. Kompetenzen des Beteiligten in Bezug auf die Emission;
 3. Bedingungen für einen Wechsel eines Beteiligten;
 4. Hinweis, wo die Verträge (Hinterlegungsvertrag usw.) kostenlos bezogen werden können;
 5. Haftung der Beteiligten in Bezug auf die Emission.

3.2.20 Mit den ETPs verbundene Rechte und Anpassungsmodalitäten

- Detaillierte Darstellung der mit den ETPs verbundenen Rechte.
Sämtliche Rechte des Anlegers im Zusammenhang mit den ETPs sind leicht verständlich darzulegen.

3.2.21 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).

3.2.22 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.

3.2.23 Verwässerungsschutz

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

3.2.24 Veränderung der Basiswerte

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

3.3 Erklärung betr. KAG

- Auf der vorderen Umschlagseite textlich hervorgehobene Erklärung in Fettschrift, dass es sich bei den ETPs nicht um kollektive Kapitalanlagen im Sinne des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) handelt und es weder der Bewilligung noch der Aufsicht der FINMA untersteht.

Siehe hierzu auch:

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

3.4 Ausgestaltung der ETPs

- Art der Ausgestaltung der ETPs, falls Wertpapiere gedruckt werden.

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

Falls die ETPs 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 ETP 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 ETPs und allfällige Beschränkungen der Handelbarkeit. Insbesondere ist deutlich auf allfällige Verkaufsbeschränkungen des ausländischen Rechts hinzuweisen.

3.7 Valorenummer und ISIN

- Valorenummer und ISIN der ETPs.

3.8 Settlement Datum

- Angabe des Zahlungs- oder Liefertermins bei Ausübung oder Verfall der ETPs.

3.9 Handelsdauer

- Vorgesehene Handelsdauer der ETPs 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 Gebühren

- Prominente Darstellung aller für den Anleger anfallenden Gebühren.

Die Aufstellung hat alle Gebühren und deren Berechnungsgrundlage in für den Anleger nachvollziehbarer Weise zu umfassen.

3.12 Vertreter

- Angabe des 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 der ETPs ermittelt wird. Sind die Basiswerte an einer Börse gehandelt, Angabe des Börsenplatzes;
- 5. Angabe darüber, welcher der für die Ermittlung des Werts der ETPs massgebliche Preis der Basiswerte ist (z.B. Eröffnungskurs, Schlusskurs);
- 6. Angaben darüber, auf welcher Webseite und an welcher Stelle der Webseite Informationen über die vergangene Wertentwicklung der Basiswerte kostenlos eingeholt werden können.

4.2 Zusätzliche Angaben bei ETPs 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 ETPs kostenlos bezogen werden können.

4.3 Zusätzliche Angaben bei ETPs 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 öffentlichen Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus bewilligt wurde. Andernfalls ist gesondert darauf hinzuweisen, dass die kollektive Kapitalanlage über keine Vertriebsgenehmigung der FINMA verfügt.

4.4 Zusätzliche Angaben bei ETPs auf Indizes

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

4.5 Zusätzliche Angaben bei ETPs 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 ETPs auf Baskets

- Anfangsfixierung sowie die prozentuale und wo sinnvoll die anteilmässige Anfangsgewichtung der Baskettitel.

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. 16 Abs. 1 Zusatzreglement Exchange Traded Products verwendet wird, müssen die oben erwähnten Angaben sowohl im Emissionsprogramm als auch in den Final Terms enthalten sein.