



Invesco NASDAQ-100 Swap UCITS ETF

Prospektnachtrag

Dieser Prospektnachtrag enthält Informationen zum Invesco NASDAQ -100 Swap UCITS ETF (der „Fonds“), einem Fonds der Invesco Markets plc (die „Gesellschaft“) eine dem irischen Recht unterliegende und von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) genehmigte offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital in Form eines Umbrella-Fonds mit Sitz in PO Box 559 New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Irland.

Dieser Prospektnachtrag ist Bestandteil des Prospekts, darf nur in Verbindung mit dem Prospekt verteilt werden (ausgenommen an vorherige Empfänger des Prospekts der Gesellschaft vom 18. Dezember 2023 in der jeweils geänderten, ergänzten oder modifizierten Fassung, (der „Prospekt“)) und muss im Zusammenhang mit dem Prospekt gelesen werden.

DIESES DOKUMENT IST WICHTIG. SIE SOLLTEN KEINE ANTEILE AN DEM IN DIESEM PROSPEKTNACHTRAG BESCHRIEBENEN FONDS ERWERBEN, WENN SIE NICHT SICHER SIND, DASS SIE DIE ART EINER SOLCHEN ANLAGE UND DIE DAMIT VERBUNDENEN RISIKEN GENAU VERSTEHEN. SIE SOLLTEN SICH FERNER VERGEWISST HABEN, DASS DIE ANLAGE FÜR IHRE PERSÖNLICHEN UMSTÄNDE UND ZIELE UND DIE DAMIT VERBUNDENEN RISIKEN GEEIGNET IST. WENN SIE ZWEIFEL ÜBER DEN INHALT DIESES PROSPEKTNACHTRAGS HABEN, SOLLTEN SIE EINEN IN GEEIGNETER WEISE QUALIFIZIERTEN BERATER KONSULTIEREN.

Definierte Begriffe, die in diesem Prospektnachtrag verwendet werden, haben die Bedeutung, die ihnen im Abschnitt „Definitionen“ weiter unten oder im Prospekt zugeschrieben wird.

Invesco Markets plc

Ein Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds

Mit Datum vom 18. Dezember 2023

WICHTIGE INFORMATIONEN

Eignung einer Anlage

Sie sollten sich selbst über (a) die möglichen steuerlichen Folgen, (b) die rechtlichen und regulatorischen Erfordernisse, (c) etwaige Devisenbeschränkungen oder Devisenkontrollbestimmungen und (d) alle anderen erforderlichen staatlichen oder sonstigen Genehmigungen oder Formalitäten nach den Gesetzen des Landes Ihrer Staatsbürgerschaft, Ihrer Ansässigkeit oder Ihres Wohnsitzes informieren, die für Ihren Kauf, Besitz oder die Veräußerung von Anteilen eine Rolle spielen könnten.

Die Anteile sind nicht kapitalgeschützt. Der Wert der Anteile kann sowohl fallen als auch steigen, und Sie erhalten möglicherweise nicht den ursprünglich investierten Betrag zurück. Lesen Sie bitte den Abschnitt „Risikofaktoren“ im Prospekt sowie den Abschnitt „Sonstige Informationen – Risikofaktoren“ in diesem Prospektnachtrag. Darin werden bestimmte Risiken, die Sie bedenken sollten, behandelt.

Zusätzlich zu Anlagen in übertragbaren Wertpapieren beabsichtigt die Gesellschaft für den Fonds zu Anlagezwecken bzw. zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements (gemäß ausführlicher Erklärung weiter unten im Abschnitt „Einsatz von Derivatekontrakten“) überwiegend in derivative Finanzinstrumente („DFIs“) zu investieren.

Auf dem Sekundärmarkt gekaufte Anteile des Fonds können in der Regel nicht direkt an den Fonds zurückverkauft werden. Anleger können Anteile nur über einen Vermittler (z. B. einen Börsenmakler) auf einem Sekundärmarkt kaufen und verkaufen. Hierbei können Gebühren anfallen. Ferner zahlen Anleger möglicherweise mehr als den aktuellen Nettoinventarwert, wenn sie Anteile kaufen, und erhalten weniger als den aktuellen Nettoinventarwert beim Verkauf derselben.

Bestimmte, mit Anlagen in DFI verbundene Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ erläutert. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft geht davon aus, dass der Nettoinventarwert des Fonds durch die Anlagen in DFI eine mittlere Volatilität haben wird.

Eine Anlage in den Anteilen eignet sich nur für Sie, wenn Sie (entweder allein oder mit Hilfe geeigneter Finanzberater oder sonstiger Berater) die Vorzüge und Risiken einer solchen Anlage beurteilen können und über ausreichende Mittel verfügen, um eventuelle Verluste infolge einer solchen Anlage verkraften zu können. Die Inhalte dieses Dokuments sollen keinen Rat bezüglich rechtlicher, steuerlicher, anlagentechnischer oder sonstiger Angelegenheiten darstellen und sollten auch nicht in dieser Hinsicht ausgelegt werden.

Profil eines typischen Anlegers

Ein typischer Anleger ist ein privater oder professioneller Anleger, der ein langfristiges Kapitalwachstum anstrebt. Ein solcher Anleger kann überdies die Chancen und Risiken einer Anlage in den Anteilen abschätzen.

Verantwortung

Die Verwaltungsratsmitglieder (deren Namen im Abschnitt „**Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft**“ im Prospekt aufgeführt sind) übernehmen die Verantwortung für die im Prospekt und diesem Prospektnachtrag enthaltenen Informationen. Nach bestem Wissen und Gewissen der Verwaltungsratsmitglieder (die alle angemessene Sorgfalt darauf verwendet haben, dies sicherzustellen) stimmen die in diesem Prospektnachtrag enthaltenen Angaben, wenn sie zusammen mit dem Prospekt (in der durch diesen Prospektnachtrag ergänzten, geänderten oder erweiterten Fassung) gelesen werden, mit den Tatsachen zum Stand dieses Prospektnachtrags überein und lassen nichts aus, was die Bedeutung der Angaben beeinträchtigen könnte.

Allgemeines

Dieser Prospektnachtrag enthält Informationen in Bezug auf die Anteile und den Fonds. Sie müssen außerdem den Prospekt lesen, der als gesondertes Dokument vorliegt und die Gesellschaft beschreibt sowie allgemeine Informationen über die Angebote von Anteilen der Gesellschaft enthält. Sie sollten

bezüglich der Anteile keinerlei Maßnahmen ergreifen, sofern Sie noch kein Exemplar des Prospekts erhalten haben. Im Falle von Abweichungen zwischen dem Inhalt des Prospekts und dieses Prospektnachtrags ist der Inhalt dieses Prospektnachtrags in Bezug auf solche Abweichungen maßgeblich. Dieser Prospektnachtrag und der Prospekt sollten beide vollständig und sorgfältig gelesen werden, bevor eine Anlageentscheidung hinsichtlich der Anteile getroffen wird.

Zum Datum dieses Prospektnachtrags hat die Gesellschaft keine ausstehenden oder eingerichteten, aber nicht ausgereichten Darlehen (einschließlich Laufzeitkrediten) und keine ausstehenden Hypotheken, Belastungen, Schuldverschreibungen oder sonstigen Fremdmittel oder Verbindlichkeiten in Form von Mittelaufnahmen, einschließlich Überziehungskrediten, Verbindlichkeiten aus Akzepten oder Akzeptkrediten, Verpflichtungen aus Ratenkäufen oder Finanzierungsleasingverhältnissen, Garantien oder anderer Eventualverbindlichkeiten.

Verteilung dieses Prospektnachtrags und Verkaufsbeschränkungen

Die Verteilung dieses Prospektnachtrags ist nur in Verbindung mit einem Exemplar des Prospekts und des jeweils letzten Jahresberichts und geprüften Jahresabschlusses der Gesellschaft und des Fonds (ausgenommen an vorherige Empfänger des Prospekts) und, sofern diese danach veröffentlicht wurden, einem Exemplar des jeweils letzten Halbjahresberichts und des ungeprüften Halbjahresabschlusses zugelassen. Die Verteilung dieses Prospektnachtrags und das Angebot oder der Kauf der Anteile können in bestimmten Hoheitsgebieten beschränkt sein. Wenn Sie ein Exemplar dieses Prospektnachtrags und/oder des Prospekts erhalten, dürfen Sie dieses Dokument bzw. diese Dokumente nicht so behandeln, als begründeten diese ein Angebot, eine Aufforderung oder ein Ersuchen für Sie zur Zeichnung von Anteilen, sofern nicht im entsprechenden Hoheitsgebiet ein solches Angebot, eine solche Aufforderung oder ein solches Ersuchen an Sie ohne die vorherige Registrierung oder Erfüllung sonstiger rechtlicher Voraussetzungen, mit Ausnahme derer, welche die Gesellschaft bereits erfüllt hat, rechtmäßig erfolgen darf. Wenn Sie die Gelegenheit zum Kauf von Anteilen wahrnehmen möchten, müssen Sie sich selbst über alle gültigen Gesetze und Vorschriften des entsprechenden Hoheitsgebiets informieren und diese beachten. Insbesondere sollten Sie sich hinsichtlich der rechtlichen Voraussetzungen für diese Zeichnung sowie über alle geltenden Devisenkontrollvorschriften und Steuern in dem Land Ihrer Staatsbürgerschaft, Ansässigkeit oder Ihres Wohnsitzes erkundigen.

Definitionen

Die im Prospekt definierten Wörter und Ausdrücke haben im Fall ihrer Verwendung in diesem Prospektnachtrag dieselbe Bedeutung, sofern in diesem Prospektnachtrag nicht anderweitig angegeben.

BEDINGUNGEN DER ANTEILE, DIE EINE BETEILIGUNG AM FONDS BEGRÜNDEN

Anlageziel

Anlageziel des Fonds ist das Erreichen der Total-Return-Nettoperformance des NASDAQ -100 Index® (der „Referenzindex“) abzüglich Gebühren, Kosten und Transaktionskosten.

Weitere Informationen zu den Komponenten und Auswahlkriterien des Referenzindex sind nachstehend im Abschnitt „**Allgemeine Beschreibung des Referenzindex**“ angegeben.

Anlagepolitik

Um das Anlageziel zu erreichen, legt die Gesellschaft für den Fonds den gesamten oder im Wesentlichen gesamten Reinerlös aus der Ausgabe von Anteilen an in:

- (i) einem Korb von globalen Dividendenpapieren und aktienähnlichen Wertpapieren (der „Korb“), wobei der Fonds im Tausch gegen die Performance/Rendite des Korbs einer genehmigten Gegenpartei die Rendite des nicht währungsgesicherten Referenzindex oder einer Version des Referenzindex, die auf eine andere Währung als USD lautet und währungsgesichert ist (die „**abgesicherte Währungsversion**“), über Unfunded Swaps erhält (d. h. der Fonds stellt im Rahmen der Swap-Vereinbarung keine Sicherheiten und nimmt auch keine entgegen), d. h. eine Vereinbarung zwischen dem Fonds und der genehmigten Gegenpartei zum Tausch eines Stroms

an Kapitalflüssen gegen einen anderen Zahlungsstrom gemäß einer Rahmenvereinbarung in Übereinstimmung mit den Auflagen der International Swaps and Derivatives Association. Der Zweck der abgesicherten Währungsversion besteht darin, auf Anteilsklassenebene den durch Fremdwährungsengagements generierten Gewinn oder Verlust beim Halten einer auf USD lautenden Anlage in einer anderen Währung als dem USD zu begrenzen. Dies wird von der abgesicherten Währungsversion durch den Einsatz rollender einmonatiger Devisenterminkontrakte erreicht. Der Fonds geht Unfunded Swaps ein und erhält die Performance des Referenzindex für nicht abgesicherte Anteilsklassen, und er geht Unfunded Swaps ein und erhält die Performance der abgesicherten Währungsversion bei Anteilen, deren Währung sich von der Währung des Referenzindex unterscheidet; oder

- (ii) globalen Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren (möglicherweise einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien), sofern solche Instrumente die Performance des Referenzindex liefern. Der Fonds investiert direkt in diese globalen Aktien und aktienähnlichen Wertpapiere anstelle des Eingehens eines Swaps wie unter (i) oben näher beschrieben. Die globalen Aktien und aktienähnlichen Wertpapiere können sowohl Komponenten des Referenzindex als auch nicht im Referenzindex enthaltene Titel umfassen und werden an den im Anhang 1 des Prospekts aufgeführten Börsen und Märkten notiert und/oder gehandelt. Infolgedessen ist das primäre Kriterium zur Auswahl einzelner Aktien und aktienbezogener Wertpapiere nicht die Attraktivität oder das Wachstums- oder Wertpotenzial, die/das sie vermeintlich aufweisen, sondern vielmehr ihre Eignung zum Erreichen des Anlageziels: der Performance des Referenzindex. Darüber hinaus kann der Fonds, wenn sich die Währung der angebotenen Anteile von der Währung der globalen Aktien und aktienähnlichen Wertpapiere unterscheidet, rollende Devisenterminkontrakte einsetzen, um den durch Fremdwährungsengagements generierten Gewinn oder Verlust beim Halten einer auf USD lautenden Anlage in einer anderen Währung als dem USD zu begrenzen.

Der Fonds beabsichtigt derzeit, sich im Referenzindex über einen Unfunded Swap zu engagieren, wie unter (i) näher beschrieben. Allerdings kann der Fonds unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilshaber jederzeit entscheiden, teilweise oder ganz zwischen den vorstehend unter (i) und (ii) beschriebenen Anlagestrategien zu wechseln, und wird die Anteilshaber im Voraus über einen solchen Wechsel informieren, und der Nachtrag wird entsprechend aktualisiert.

Die Swaps, der Korb, die globalen Aktien und aktienähnlichen Wertpapiere und liquiden Mittel, die vom Fonds gehalten werden, stellen im Sinne des Prospekts das „**Fondsvermögen**“ dar.

Jeder genehmigte Gegenpartei der Swaps hat mit der Gesellschaft im Namen des Fonds einen Rahmenvertrag (einschließlich etwaiger Nebenverträge) geschlossen, und für jede Swap-Transaktion werden Bestätigungen ausgestellt. Diese Bestätigungen können vor oder nach der relevanten Transaktion und in elektronischer Form ausgestellt werden.

Der Fonds setzt für Anlagezwecke oder Zwecke des effizienten Portfoliomanagements keine Hebel (Leverage) ein und ist deshalb keinem Shortfall-Risiko ausgesetzt. Jede finanzielle Verpflichtung, die in Bezug auf den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten entsteht, darf niemals das im Fonds verfügbare Kapital überschreiten.

Die Anteilsklassen EUR Hdg Acc, EUR Hdg Dist, GBP Hdg Acc, GBP Hdg Dist, CHF Hdg Acc, CHF Hdg Dist, MXN Hdg Acc und MXN Hdg Dist sollen das Währungsrisiko entweder durch den Einsatz von Swaps in Bezug auf die abgesicherte Währungsversion oder durch den Einsatz rollender Devisenterminkontrakte (gemäß den obigen Abs. (i) bzw. (ii) im obigen Abschnitt Anlagepolitik) absichern. In beiden Fällen besteht das Ziel der Währungsabsicherung darin, das Fremdwährungsrisiko der Anteilsklassen zu begrenzen, die nicht auf die Währung des Referenzindex lauten. Diese Absicherung resultiert unter normalen Marktbedingungen bei der Berechnung des Gesamtrisikos des Fonds nicht zu einem zusätzlichen Gesamtrisiko nach dem Commitment-Ansatz.

Weitere, für die Anlagepolitik des Fonds relevante Informationen sind im Hauptteil des Prospekts in den Abschnitten „**Anlageziele und Anlagepolitik**“ und „**Anlagebeschränkungen**“ enthalten.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, die in der Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und

des Rates vom 18. Juni 2020 über die Einrichtung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen dargelegt sind.

Indexnachbildungsstrategie

Die Verwaltungsgesellschaft zielt für den Fonds auf einen „**Tracking Error**“ ab (also die Standardabweichung der Renditedifferenz zwischen Fonds und Referenzindex), der unter normalen Marktbedingungen maximal 0,50 % beträgt. Es können allerdings außergewöhnliche Umstände eintreten, derentwegen der Tracking Error des Fonds 0,50 % überschreitet.

Einsatz von Derivatekontrakten

Swaps

Der Anlagepolitik gemäß kann der Fonds Swaps eingehen, um die Total-Return-Nettoperformance des Referenzindex zu erzielen. Zur Klarstellung wird darauf hingewiesen, dass die genehmigte Gegenpartei der Gesellschaft für den jeweiligen Fonds (gegebenenfalls) entsprechende Sicherheiten in Übereinstimmung mit den Anlagebeschränkungen stellen kann, so dass das Risikopotenzial der Gesellschaft gegenüber der genehmigten Gegenpartei auf das von der Zentralbank vorgeschriebene Maß reduziert wird.

Um die Tracking Difference zu mindern und/oder die Wertentwicklung des Fonds zu verbessern, kann die Indexrendite, die zur Berechnung des Swaps bereitgestellt wird, eine niedrigere Quellensteuer aufweisen als es gewöhnlich im Referenzindex der Fall ist.

Die Swaps können von jeder Partei jederzeit oder beim Eintreten bestimmter Ereignisse entweder in Bezug auf den Fonds oder die genehmigte Gegenpartei, insbesondere bei einem Ausfallereignis (wie etwa einer Nichtzahlung, einer Vertragsverletzung oder einem Konkurs) oder einem eine Kündigung auslösenden Ereignis (das nicht auf ein Verschulden seitens einer der Parteien zurückzuführen ist, z. B. Rechtswidrigkeit oder ein Steuerereignis), zu ihrem beizulegenden Zeitwert gekündigt werden.

Wenn die Swaps aufgrund eines Ausfallereignisses oder eines eine Kündigung auslösenden Ereignisses gekündigt werden, wird für die Swaps ein Glattstellungsbetrag festgelegt. Ein dem relevanten Glattstellungsbetrag entsprechender Betrag (der gemäß den Bedingungen der Swaps berechnet wurde) oder ein zwischen den Parteien vereinbarter anderer Betrag wird zwischen der genehmigten Gegenpartei und dem Fonds abgerechnet. Die Swaps werden immer gemäß den Bestimmungen des Prospekts bewertet. Der Fonds kann dann neue Swaps eingehen, es sei denn, der Verwaltungsrat beschließt, dass es nicht ratsam ist, neue Derivatekontrakte einzugehen, oder direkt in die zugrunde liegenden Wertpapiere des Referenzindex zu investieren. Sofern der Verwaltungsrat beschließt, dass es keine andere angemessene Möglichkeit gibt, die Total-Return-Nettoperformance des Referenzindex zu erzielen, kann der Fonds alternativ gemäß den Bestimmungen des Prospekts aufgelöst werden.

Bei den Swaps handelt es sich um Unfunded Swaps, und die Zahlungen sind an den Ertrag des Korbs geknüpft. Der Swap liefert die Differenz zwischen den für den Korb eingegangenen Zahlungen und der Performance des Referenzindex bzw. der abgesicherten Währungsversion.

Der Fonds kann für verschiedene Anteilsklassen separate Swap-Vereinbarungen treffen. Jeder Swap bietet der betreffenden Anteilsklasse entweder ein Engagement im Referenzindex oder in der abgesicherten Währungsversion des Referenzindex. Dementsprechend wird die Performance des entsprechenden Aktienkorbs auf der Ebene der relevanten Anteilsklasse ausgewiesen.

Die Gesellschaft hat der Zentralbank im Namen des Fonds ihre Risikomanagementpolitik eingereicht, die ihr die genaue Messung, Überwachung und Steuerung der verschiedenen, mit dem Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten verbundenen Risiken ermöglicht. Die Gesellschaft stellt den Anteilsinhabern auf Wunsch zusätzliche Informationen hinsichtlich der angewandten Methoden des Risikomanagements, einschließlich der geltenden quantitativen Limits sowie der jüngsten Entwicklungen bezüglich der Risiko- und Ertragsmerkmale der Hauptanlegerkategorien, zur Verfügung.

Zur Berechnung des Gesamtrisikos für den Fonds zieht die Gesellschaft den Commitment-Ansatz heran. Das Gesamtengagement einer Anteilsklasse im Referenzindex bzw. einer abgesicherten Währungsversion ist auf 100 % des Nettoinventarwerts beschränkt. Der Fonds hat kein weiteres zusätzliches Engagement oder gehebeltes Engagement in Bezug auf den Referenzindex oder die abgesicherte Währungsversion. Deshalb beträgt das Gesamtrisiko des Fonds unter normalen Marktbedingungen 0 % (d. h., das

Gesamtengagement des Fonds im Referenzindex oder in der abgesicherten Währungsversion beschränkt sich unter normalen Marktbedingungen auf 100 % des Nettoinventarwerts).

Anlagebeschränkungen

Anleger müssen insbesondere beachten, dass die allgemeinen, im Prospekt im Abschnitt „**Anlagebeschränkungen**“ aufgeführten Anlagebeschränkungen für den Fonds gelten.

Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettovermögens in andere OGAW oder andere offene oder geschlossene Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) investieren.

Effizientes Portfoliomanagement

Weitere Informationen zum effizienten Portfoliomanagement sind im Hauptteil des Prospekts im Abschnitt „**Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten und effizientes Portfoliomanagement**“ enthalten.

Sicherheitenpolitik

Weitere Informationen zur Sicherheitenpolitik enthält der Hauptteil des Prospekts im Abschnitt „**Sicherheitenpolitik**“.

Der Fonds kann gemäß der Sicherheitenpolitik der Gesellschaft Sicherheiten stellen oder hereinnehmen.

Folgen von Störungsereignissen

Beim Eintreten eines Störungsereignisses (und ohne Einschränkung der persönlichen Befugnisse der Verwaltungsratsmitglieder, wie eingehender im Prospekt beschrieben) kann eine genehmigte Gegenpartei Anpassungen vornehmen, um den Wert der relevanten Swaps zu ermitteln, und eine solche Anpassung kann sich auf den Nettoinventarwert auswirken; und/oder der Verwaltungsrat kann (i) die Berechnung des Nettoinventarwertes und alle Zeichnungen, Rückkäufe und Umtäusche von Anteilen gemäß den Bestimmungen des Prospekts im Abschnitt „**Aussetzung der Berechnung des Nettoinventarwertes**“ vorübergehend aussetzen; und/oder (ii) der Verwaltungsrat kann unter bestimmten, im Prospekt aufgeführten Umständen den Fonds auflösen.

Beschränkter Rückgriff

Ein Anteilinhaber ist lediglich berechtigt, sich hinsichtlich aller Zahlungen in Bezug auf seine Anteile an die Vermögenswerte des Fonds zu wenden. Ist das realisierte Nettovermögen des Fonds nicht ausreichend, um auf die betreffenden Anteile fällige Beträge zu zahlen, so hat der Anteilinhaber kein weiteres Recht auf Zahlungen im Hinblick auf diese Anteile oder Forderungen gegen oder Rückgriffsansprüche gegenüber den Vermögenswerten eines anderen Fonds oder sonstigen Vermögenswerten der Gesellschaft.

Leverage

Der Fonds setzt bei seinen Anlagemethoden keine Hebel ein und hält keine gehebelten Instrumente. Wie im Abschnitt „**Allgemeine Beschreibung des Referenzindex**“ angegeben, ist der Referenzindex, der NASDAQ-100 Index®, ein nicht gehebelter Index. Die abgesicherte Währungsversion wendet eine Absicherungsmethode an, die innerhalb des Monats in einer Hebelwirkung (Leverage) resultieren kann. Im Fall eines Gewinns aus der Währungsabsicherung einer abgesicherten Währungsversion resultiert aus diesem Gewinn keine Leverage, aber bei einem Verlust aus dieser Absicherung entsteht Leverage durch diesen Verlust. Die Verwaltungsgesellschaft geht davon aus, dass unter normalen Marktbedingungen die Höhe der durch die abgesicherte Währungsversion generierte Leverage gering sein wird. Ungeachtet dessen ist der Fonds nicht gehebelt, da eine aus der Absicherungsmethode resultierende Leverage aufgehoben wird, wenn die abgesicherte Währungsversion monatlich neu gewichtet wird.

Kreditaufnahme

Gemäß den allgemeinen im Prospekt unter der Überschrift „**Befugnis zur Kreditaufnahme und Kreditvergabe**“ aufgeführten Bestimmungen darf die Gesellschaft im Namen des Fonds kurzfristig bis zu 10 % des Nettoinventarwertes des Fonds aufnehmen. Diese Kreditaufnahmen dürfen nur für kurzfristige Liquiditätszwecke verwandt werden, um die Rücknahme von Anteilen abzusichern.

Ausschüttungspolitik

Es besteht kein Dividendenanspruch für Anteile der Klassen Acc, EUR Hdg Acc, GBP Hdg Acc, CHF Hdg Acc oder MXN Hdg Acc.

Lediglich in Bezug auf Anteile der Klassen Dist, EUR Hdg Dist, GBP Hdg Dist, CHF Hdg Dist und MXN Hdg Dist und nach Ermessen des Verwaltungsrats beabsichtigt der Fonds eine unter Bezugnahme auf die im jeweiligen Dividendenzeitraum im Referenzindex eingebetteten, reinvestierten Dividenden berechnete vierteljährliche Ausschüttung zu zahlen (in der Regel am oder um den 20. März, 20. Juni, 20. September und 20. Dezember), abzüglich Steuern oder anderer Quellensteuern. Der Referenzindex beabsichtigt die Kursperformance der im Referenzindex enthaltenen Unternehmen und die von diesen Unternehmen vorgenommenen Ausschüttungen abzubilden. Es wird nicht garantiert, dass Dividenden gezahlt werden. Es sollte beachtet werden, dass die Zahlung einer Ausschüttung so berechnet wird, dass die beschlossene Ausschüttung niemals die über die Total-Return-Performance des Fonds hinausgehende Performance übersteigen wird, die durch Bezugnahme auf die Kursrendite des Referenzindexes über den jeweiligen Berechnungszeitraum berechnet wird.

Die Gesellschaft wird Dividenden gemäß den Bestimmungen des Prospekts beschließen. Nur Anleger, die Anteile vor dem Datum kaufen, an dem die jeweilige Dividende vom Verwaltungsrat beschlossen wird, und bis zu dem Datum, an dem der Verwaltungsrat die jeweilige Dividende zahlt, Anleger des Fonds bleiben, erhalten die beschlossene Dividende, ansonsten haben sie keinen Anspruch auf diese Dividende. Einzelheiten zu Beschluss und Zahlung von Dividenden werden auf der Webseite veröffentlicht. Eine der wirtschaftlichen Folgen der Zahlung einer (etwaigen) Dividende besteht darin, dass der Nettoinventarwert der Anteile der Klassen Dist, EUR Hdg Dist, GBP Hdg Dist, CHF Hdg Dist und MXN Hdg Dist entsprechend reduziert wird.

Handel

Am oder um das Auflegungsdatum ist ein Antrag bei der Euronext Dublin oder bei der Deutschen Börse und/oder denjenigen anderen Börsen, die der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festlegen kann (die „**relevanten Börsen**“), auf Zulassung der ausgegebenen oder zur Ausgabe zur Verfügung stehenden Anteile zur Notierung und/oder zum Handel am Hauptmarkt jeder relevanten Börse gestellt worden. Dieser Prospektnachtrag und der Prospekt bilden zusammen den Zulassungsprospekt zwecks Zulassung zum Handel am Hauptmarkt jeder relevanten Börse.

Börsengehandelter Indexfonds (ETF)

Der Fonds ist ein börsengehandelter Indexfonds („**ETF**“). Die Anteile dieses Fonds sind unter Anlegern voll übertragbar und werden an den relevanten Börsen notiert und/oder gehandelt. Es ist vorgesehen, dass die Anteile durch private und professionelle Anleger auf die gleiche Weise wie die Stammaktien einer börsennotierten Handelsgesellschaft auf dem Sekundärmarkt gekauft und verkauft werden.

Allgemeine Informationen zum Fonds

Typ	Offen
Basiswährung	USD
Geschäftstag	Ein Tag (mit Ausnahme von Samstagen oder Sonntagen), an dem das United States Federal Reserve System geöffnet hat, oder ein anderer Tag bzw. andere Tage, den bzw. die der Verwaltungsrat festlegt und den Anteilsinhabern im Voraus mitteilt.
Handelstag	Jeder Geschäftstag. Einige Geschäftstage sind jedoch keine Handelstage, wenn z. B. Märkte, an denen die Anlagen des Fonds notiert sind oder gehandelt werden, oder Märkte von Bedeutung für einen Referenzindex geschlossen sind, vorausgesetzt, dass es in jedem Zweiwochenzeitraum mindestens einen Handelstag gibt, und stets vorbehaltlich der Ermessensfreiheit des Verwaltungsrats, die Ermittlung des Nettoinventarwerts sowie den Verkauf, den Umtausch und/oder die Rücknahme von Anteilen an der Gesellschaft oder einem der Fonds gemäß den Bestimmungen des

	<p>Prospekts und der Satzung vorübergehend auszusetzen.</p> <p>Der Anlageverwalter erstellt Handelskalender, in denen die Handelstage für jeden Fonds vorab aufgeführt sind. Die Anlageverwalter kann den Handelskalender von Zeit zu Zeit ändern, beispielsweise dann, wenn der maßgebliche Marktbetreiber, Regulierer oder die maßgebliche Börse einen relevanten Markt als für den Handel und/oder die Abwicklung geschlossen erklärt (eine solche Schließung kann mit kurzfristiger oder ohne Mitteilung an den Anlageverwalter erfolgen).</p> <p>Der Handelskalender für den Fonds ist bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.</p>
Orderannahmeschluss	17:00 (Dubliner Zeit) am relevanten Handelstag. Nach dem Bewertungszeitpunkt sind weder Zeichnung, Umtausch noch Rücknahme möglich.
Zeichnungen, Umtäusche und Rücknahmen von Anteilen gegen Sachwerte (in kind)	Alle Zeichnungen, Umtäusche und Rücknahmen gegen Sachwerte können nur über einen autorisierten Teilnehmer oder einen anderen, von der Gesellschaft im jeweiligen Hoheitsgebiet ernannten Vertreter erfolgen.
Erstausgabezeitraum	Der Erstausgabezeitraum hinsichtlich der Anteile der Klassen EUR Hdg Acc, EUR Hdg Dist, GBP Hdg Acc, GBP Hdg Dist, CHF Hdg Acc, CHF Hdg Dist, MXN Hdg Acc und MXN Hdg Dist bleibt offen von 9:00 Uhr (Dubliner Zeit) am 26. Oktober 2021 bis um 17:00 Uhr (Dubliner Zeit) am 25. April 2022 oder zu einem früheren oder späteren Termin, den der Verwaltungsrat festlegen kann und der Zentralbank mitgeteilt hat.
Mindestfondsvolumen	30.000.000 USD
Bewertungszeitpunkt	Geschäftsschluss am relevanten Handelstag unter Bezugnahme auf den der Nettoinventarwert je Anteil des Fonds ermittelt wird. Der Bewertungszeitpunkt ist stets später als der Orderannahmeschluss.
Abwicklungstag	2 Geschäftstage nach dem relevanten Handelstag.
Webseite	etf.invesco.com Informationen zur Portfoliozusammensetzung und Einzelheiten zum indikativen Nettoinventarwert sind auf der Webseite abrufbar.

Beschreibung der Anteile

Anteilsklasse	„Acc“
Anteilsklassenwährung	USD
Mindestbetrag für Erstzeichnungen	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrücknahmebetrag	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.
Auflegungsdatum	D. h. der 22. März 2021.

Anteilkategorie	„Dist“
Anteilklassenwahrung	USD
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrucknahmebetrag	1.000.000 USD, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.
Auflegungsdatum	D. h. der 18. Juni 2021.

Anteilkategorie	„EUR Hdg Acc“
Anteilklassenwahrung	EUR
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in EUR den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 15390,160 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse EUR Hdg Acc des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrucknahmebetrag	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.

Anteilkategorie	„EUR Hdg Dist“
Anteilklassenwahrung	EUR
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in EUR den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 15390,160 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse EUR Hdg Dist des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.

Erstzeichnungen	
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrücknahmebetrag	1.000.000 EUR, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Anteilsklasse	„GBP Hdg Acc“
Anteilsklassenwahrung	GBP
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in GBP den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 15390,160 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse GBP Hdg Acc des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrucknahmebetrag	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Anteilsklasse	„GBP Hdg Dist“
Anteilsklassenwahrung	GBP
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in GBP den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 15390,160 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse GBP Hdg Dist des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.

Mindestrücknahmebetrag	1.000.000 GBP, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Anteilsklasse	„CHF Hdg Acc“
Anteilsklassenwährung	CHF
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in CHF den offiziellen Schlussstand des Referenzindex am Geschäftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlussstand des Referenzindex 15390,160 wäre und vorausgesetzt, dass der Fonds am nächsten Geschäftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), wäre der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse CHF Hdg Acc des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhältlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag für Erstzeichnungen	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrücknahmebetrag	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Anteilsklasse	„CHF Hdg Dist“
Anteilsklassenwährung	CHF
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in CHF den offiziellen Schlussstand des Referenzindex am Geschäftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 385.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlussstand des Referenzindex 15390,160 wäre und vorausgesetzt, dass der Fonds am nächsten Geschäftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), wäre der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse CHF Hdg Dist des Fonds 39,9744.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhältlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag für Erstzeichnungen	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrücknahmebetrag	1.000.000 CHF, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.

Mindestanlage	Nicht zutr.
----------------------	-------------

Anteilsklasse	„MXN Hdg Acc“
Anteilsklassenwahrung	MXN
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in MXN den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 155.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 309359,1451 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse MXN Hdg Acc des Fonds 1.995,8654.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrucknahmebetrag	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Anteilsklasse	„MXN Hdg Dist“
Anteilsklassenwahrung	MXN
Erstausgabepreis	<p>Bezeichnet in MXN den offiziellen Schlusstand des Referenzindex am Geschaftstag vor dem Auflegungsdatum geteilt durch 155.</p> <p>Beispiel: Falls am 21. Oktober 2021 der offizielle Schlusstand des Referenzindex 309359,1451 ware und vorausgesetzt, dass der Fonds am nachsten Geschaftstag aufgelegt wird (d. h. das Auflegungsdatum), ware der Erstausgabepreis der Anteile der Klasse MXN Hdg Dist des Fonds 1.995,8654.</p> <p>Anleger sollten beachten, dass der Erstausgabepreis der Anteile am Auflegungsdatum vom Administrator und auf der Webseite erhaltlich ist: etf.invesco.com</p>
Mindestbetrag fur Erstzeichnungen	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestzeichnungsbetrag	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestrucknahmebetrag	1.000.000 MXN, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig festgelegt.
Mindestanlage	Nicht zutr.

Intraday-Portfoliowert („iNIW“)

Weitere Informationen zum Intraday-Portfoliowert enthält der Hauptteil des Prospekts im Abschnitt „Intraday-Portfoliowert“.

Gebühren und Kosten

Die folgenden Gebühren fallen für Anteilsinhaber in Bezug auf jeden Anteil an (und fallen demgemäß nicht der Gesellschaft im Namen des Fonds an und wirken sich nicht auf den Nettoinventarwert des Fonds aus):

Anteilsklasse	„Acc“	„Dist“	„EUR Hdg Acc“	„EUR Hdg Dist“	„GBP Hdg Acc“	„GBP Hdg Dist“	„CHF Hdg Acc“	„CHF Hdg Dist“	„MXN Hdg Acc“	„MXN Hdg Dist“
Zeichnungsgebühr	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %	Bis zu 5 %
Rücknahmegebühr	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %	Bis zu 3 %

Die Zeichnungsgebühr wird vom Anlagebetrag abgezogen, der von einem Anleger für die Zeichnung von Anteilen eingegangen ist. Diese Zeichnungsgebühr ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen.

Die folgenden Gebühren und Kosten entstehen der Gesellschaft für den Fonds und wirken sich auf den Nettoinventarwert der jeweiligen Anteilsklasse des Fonds aus.

Anteilsklasse	Managementgebühr
„Acc“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„Dist“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„EUR Hdg Acc“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„EUR Hdg Dist“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„GBP Hdg Acc“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„GBP Hdg Dist“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„CHF Hdg Acc“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„CHF Hdg Dist“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„MXN Hdg Acc“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.
„MXN Hdg Dist“	Maximal 0,20 % jährlich oder ein niedrigerer Betrag, wie er den Anteilsinhabern von Zeit zu Zeit mitgeteilt werden kann.

Die Managementgebühr, ein Prozentsatz des Nettoinventarwerts der jeweiligen Anteilsklasse

(gegebenenfalls zuzüglich MwSt.), ist von der Gesellschaft aus dem Fondsvermögen an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen. Die Managementgebühr fällt täglich an und wird an jedem Handelstag berechnet sowie monatlich rückwirkend gezahlt. Die Verwaltungsgesellschaft zahlt aus ihren Gebühren (und nicht aus dem Fondsvermögen) die etwaigen Gebühren und Kosten des Anlageverwalters, des Administrators, der Verwahrstelle, der Verwaltungsratsmitglieder sowie die dem Fonds entstandenen gewöhnlichen Gebühren, Aufwendungen und Kosten, wozu die Gründungskosten und sonstige Verwaltungskosten gemäß Beschreibung im Prospekt gehören. Als Unterstützung beim Bestreiten einiger Kosten des Fonds (einschließlich der Gebühren des Anlageverwalters, des Administrators, der Verwahrstelle und der Kosten für die Indexlizenz) kann die Verwaltungsgesellschaft einen Gebührenbeitrag von den genehmigten Gegenparteien verlangen (weitere Einzelheiten hierzu sind auf Anfrage erhältlich). Anleger werden darauf hingewiesen, dass aufgrund der Kosten im Zusammenhang mit dem Angebot des währungsgesicherten Engagements möglicherweise nicht dieselben Ausschüttungssätze bei allen Anteilsklassen erreicht werden können.

Dieser Abschnitt „**Gebühren und Kosten**“ sollte in Verbindung mit dem Kapitel „**Gebühren und Kosten**“ im Prospekt gelesen werden.

ALLGEMEINE BESCHREIBUNG DES REFERENZINDEX

Der Referenzindex soll die Wertentwicklung der 100 nach Marktkapitalisierung größten an der Nasdaq notierten Nicht-Finanzunternehmen abbilden.

Der Referenzindex ist nachfolgend näher beschrieben. Diese Beschreibung stellt jedoch nur einen Auszug der aus öffentlichen Quellen verfügbaren Informationen dar, und weder der Verwaltungsrat noch die Verwaltungsgesellschaft, Nasdaq, Inc oder derjenige nachfolgende Sponsor des Referenzindex (der „Indexanbieter“) oder der Anlageverwalter haften für die Richtigkeit oder Vollständigkeit dieser Informationen.

Die zur Aufnahme in den Referenzindex infrage kommenden Wertpapiergattungen sind unter anderem Stammaktien, Tracking Stocks, Treuhandanteilsscheine, Kommanditanteile und American Depositary Receipts („**ADRs**“) einschließlich Depositary Receipts, die Wertpapiere von Nicht-US-Emittenten repräsentieren.

Um für die Aufnahme in den Referenzindex infrage zu kommen, muss ein Wertpapier sämtliche der folgenden Eignungskriterien erfüllen. Für die Aufnahme in den Referenzindex gibt es keine Mindestanforderung an die Marktkapitalisierung oder an den Streubesitz.

Eignungskriterien

1. Der Emittent der primären US-Notierung des Wertpapiers muss ausschließlich am Nasdaq Global Select Market oder am Nasdaq Global Market notiert sein.
2. Das Wertpapier muss gemäß der Industry Classification Benchmark (ICB) – einem Produkt der FTSE International Limited, das für diese Verwendung vom Indexanbieter lizenziert ist – unter Nicht-Finanzunternehmen (also Unternehmen, die unter einer anderen Branchen-Kennziffer als 8000 eingruppiert sind) eingestuft sein.
3. Das Wertpapier muss über drei Monate im Durchschnitt ein tägliches Mindesthandelsvolumen von 200.000 Aktien aufweisen.
4. Das Wertpapier muss mindestens drei volle Kalendermonate an einer zulässigen Börse (wie Nasdaq Global Select Market, Nasdaq Global Market, Nasdaq Capital Market, New York Stock Exchange, NYSE American oder CBOE BZX) gehandelt worden sein, wobei der Monat der Erstnotierung nicht mitzählt. Die Zulässigkeit richtet sich nach dem Stichtag für die Komponentenauswahl, wobei dieser Monat mitzählt.
5. Untersteht der Emittent des Wertpapiers dem Recht eines anderen Landes als der USA, dann müssen börsennotierte Optionen auf das Wertpapier auf einem anerkannten Optionsmarkt in den USA notiert sein oder zum Handel mit börsennotierten Optionen auf einem anerkannten Optionsmarkt in den USA zulässig sein.
6. Das Wertpapier darf nicht von einem Emittenten begeben sein, der sich derzeit im Konkursverfahren befindet.
7. Der Emittent des Wertpapiers darf generell keine endgültige oder sonstige Vereinbarung getroffen haben, die dieses von der Aufnahme in den Referenzindex ausschließen würde und wenn die Transaktion nach Maßgabe des Indexanbieters unmittelbar bevorsteht.
8. Sind mehrere Wertpapierklassen eines Emittenten notiert, so kommen sie alle infrage, sofern sie sämtliche sonstigen Eignungskriterien erfüllen.

Neugewichtung und Gewichtung des Index

Der Referenzindex wird jährlich mit Wirkung ab Handelsschluss am dritten Freitag im Dezember neu erstellt. Damit ein Wertpapier bei der jährliche Neuerstellung für die Aufnahme in den Referenzindex infrage kommt, muss es auf der Grundlage der Marktdaten per Ende Oktober und der per Ende November in Umlauf befindlichen Gesamtzahl von Aktien die vorstehenden Eignungskriterien erfüllen.

Der Referenzindex wird vierteljährlich einer Neugewichtung unterzogen, und zwar nach Handelsschluss am dritten Freitag in jedem März, Juni, September und Dezember, einschließlich einer jährlichen und vierteljährlichen Gewichtungsanpassungen. Der Referenzindex wird anhand einer „modifizierten marktkapitalisierungsgewichteten“ Methode berechnet, die eine Mischform aus Gleichgewichtung und

konventioneller Kapitalisierungsgewichtung darstellt. Bei der jährlichen Gewichtungsanpassung dürfen auf kein Wertpapier mehr als 14 % des Referenzindex entfallen und bei einer der vierteljährlichen Gewichtungsanpassungen auf keinen Emittenten mehr als 24 % der Gewichtung des Referenzindex. Beim Neugewichtungsprozess werden Daten zur Gesamtzahl der in Umlauf befindlichen Aktien und zum letzten Verkaufskurs aller Wertpapierkomponenten per Monatsende vor der Neugewichtung herangezogen (d. h. Februar, Mai, August und November). Es kann jedoch jederzeit eine gesonderte Neugewichtung durchgeführt werden, wenn festgestellt wird, dass dies notwendig ist, um die Integrität des Referenzindex zu wahren. Ergänzende Informationen über die Gewichtung im Referenzindex sind den Leitlinien der Nasdaq zur Anpassung der Indexgewichtung (Nasdaq Index Weight Adjustment Guidelines) zu entnehmen.

Die Neugewichtungs-Frequenz des Referenzindex hat keine direkten Auswirkungen auf die mit dem Fonds selbst verbundenen Transaktionskosten, da eine Neugewichtung im Referenzindex erwartungsgemäß keine höhere Frequenz des Positionsumschlags im Fonds erfordert, als wenn der Referenzindex statisch wäre.

Der Referenzindex wird in USD berechnet. Der Referenzindex hat verschiedene Währungsversionen, die auf eine andere Währung als den USD lauten (jeweils eine „**abgesicherte Währungsversion**“). Diese abgesicherten Währungsversionen setzen Devisenterminkontrakte ein, um die entsprechende Währungsrendite zu erzielen. Die abgesicherten Währungsversionen sollen repräsentativ für die Renditen des Referenzindex sein und gleichzeitig das Währungsrisiko, aber nicht das zugrunde liegende Aktienmarktrisiko absichern. Durch den Einsatz dieser Strategie sollen die abgesicherten Währungsversionen das Risiko negativer Währungsschwankungen reduzieren, wodurch möglicherweise aber auch auf potenzielle Währungsgewinne verzichtet wird.'

Die Verwaltungsgesellschaft überwacht die für den Fonds geltenden Anlagebeschränkungen. Sobald die Verwaltungsgesellschaft davon Kenntnis erlangt, dass die Gewichtung einer bestimmten enthaltenen Aktie im Referenzindex die zulässigen Anlagebeschränkungen übersteigt, wird die Verwaltungsgesellschaft versuchen, entweder die betreffende Position aufzulösen oder das Engagement des Fonds in dieser enthaltenen Aktie zu reduzieren, um sicherzustellen, dass der Fonds jederzeit innerhalb der zulässigen Anlagebeschränkungen bleibt und die Anforderungen der OGAW-Vorschriften einhält.

Das Engagement im Referenzindex gewährt ein indirektes Engagement in den einzelnen Wertpapieren, aus denen sich der Referenzindex zusammensetzt, von bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts.

Indexanbieter und Webseite

Der Referenzindex wird von Nasdaq, Inc gesponsert. Weitere Informationen zum Referenzindex sind abrufbar unter <https://indexes.nasdaqomx.com>.

Veröffentlichung

Der Referenzindexstand wird auf der Seite von Nasdaq, Inc veröffentlicht:
<https://www.nasdaq.com/nasdaq-100>.

SONSTIGE INFORMATIONEN

Risikofaktoren

Bestimmte Risiken in Zusammenhang mit den Anteilen sind im Abschnitt „**Risikofaktoren**“ im Prospekt aufgeführt. Des Weiteren müssen Anteilsinhaber auch Folgendes beachten:

- (a) Die im Rahmen der Swaps mit einer genehmigten Gegenpartei zu zahlende Rendite hängt vom Bonitätsrisiko der genehmigten Gegenpartei ab. Des Weiteren fungiert die genehmigte Gegenpartei als die Berechnungsstelle im Rahmen der Swaps (die „**Berechnungsstelle**“). Anteilsinhaber sollten beachten, dass sie nicht nur dem Bonitätsrisiko der genehmigten Gegenpartei ausgesetzt sind, sondern auch potenziellen Interessenkonflikten bei der Ausübung der Tätigkeit der Berechnungsstelle durch die genehmigte Gegenpartei. Die genehmigte Gegenpartei hat sich verpflichtet, alle angemessenen Anstrengungen zu unternehmen, um solche Interessenkonflikte (unter Berücksichtigung seiner jeweiligen Verpflichtungen und Aufgaben) gerecht zu lösen, sowie sicherzustellen, dass die Interessen der Gesellschaft und der Anteilsinhaber nicht unangemessen beeinträchtigt werden. Der Verwaltungsrat ist überzeugt, dass die genehmigte Gegenpartei für die Ausübung dieser Funktionen geeignet und kompetent ist. Ferner werden die von der genehmigten Gegenpartei in seiner Funktion als Berechnungsstelle gelieferten Bewertungen mindestens wöchentlich von einer von der genehmigten Gegenpartei unabhängigen Partei überprüft, die entweder der Administrator oder gegebenenfalls vom Administrator beauftragt ist, und die für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigt wurde.
- (b) Auf andere Währungen als dem US-Dollar lautende Anteilsklassen sind der abgesicherten Währungsversion im Zusammenhang mit der Währung der jeweiligen Anteilsklasse ausgesetzt. Folglich können die Erträge in Bezug auf eine Klasse, die auf eine Währung lautet, von denen in Bezug auf Klassen abweichen, die auf andere Währungen lauten. Beispiel: Wenn der Wert des Referenzindex (der auf USD lautet) steigt, hängt die Höhe des Anstiegs in der auf Euro, GBP, CHF oder MXN lautenden abgesicherten Währungsversionen vom Wechselkurs zwischen dem USD und der jeweiligen Währung ab; falls der USD der jeweiligen Währung gegenüber relativ schwach ist, fällt der Anstieg bei der jeweiligen abgesicherten Währungsversion kleiner aus als es bei einem gegenüber der jeweiligen Währung relativ starken USD der Fall wäre. Darüber hinaus können die zur Berechnung der abgesicherten Währungsversionen benutzten Wechselkurse weniger günstig als Wechselkurse sein, die von anderen Quellen bezogen werden können.
- (c) .
- (d) Dividenden unterliegen angenommenen Steuersätzen - Eine für eine Aktienkomponente des Korbs angekündigte Dividende wird um einen angenommenen Steuersatz vermindert (der null betragen kann). Dadurch soll die vom Land der Gründung oder des Sitzes des Emittenten einer solchen Aktie erhobene Quellensteuer bzw. der potenzielle Steuersatz, der erhoben werden kann, berücksichtigt werden. Der angenommene Steuersatz wird vom Indexberechnungsanbieter auf der Grundlage seiner Auffassung von geltenden Gesetzen und/oder Vorschriften, überprüfbaren Quellen und/oder Marktpraktiken festgelegt. Die angenommenen Steuersätze können durch den Indexberechnungsanbieter von Zeit zu Zeit geändert werden. Wird der angenommene Steuersatz für eine oder mehrere enthaltene Aktien erhöht, kann sich das auf die Wertentwicklung des Referenzindex auswirken.
- (e) Wenngleich der Fonds Derivatetransaktionen mit einem oder mehreren genehmigten Gegenparteien tätigen kann, muss der Fonds Transaktionen nicht mit mehr als einer genehmigten Gegenpartei durchführen, und dementsprechend kann sich das Gegenparteirisiko auf eine einzige Gegenpartei oder eine kleine Zahl von Gegenparteien konzentrieren. Ferner besteht keine Vereinbarung zwischen genehmigten Gegenparteien und dem Fonds, wonach eine solche genehmigte Gegenpartei an die Stelle einer anderen Gegenpartei tritt, wenn dieser unter einem derivativen Kontrakt in Verzug gerät, oder Verluste ausgleicht, die dem Fonds infolge den Verzug einer Gegenpartei entstehen.
- (f) Sektorkonzentrationsrisiko: Der Fonds investiert vorrangig in Wertpapiere innerhalb eines bestimmten Sektors oder einer kleinen Anzahl von Sektoren und/oder Branchen. Ungünstige

Entwicklungen innerhalb dieser Sektoren und/oder Branchen können den Wert der dem Fonds zugrunde liegenden Wertpapiere, die in solche Titel investieren, beeinflussen. Anleger sollten bereit sein, ein höheres Risiko zu akzeptieren, wenn sie in einen Fonds (wie diesen Fonds) investieren, der primär in Wertpapiere innerhalb eines bestimmten Sektors oder einer Branche bzw. in nur wenigen Sektoren und/oder Branchen investiert, als bei einem Fonds, der über verschiedene Sektoren breiter gestreut ist.

- (g) **Länderkonzentrationsrisiko:** Ein Fonds kann in einem einzelnen Land oder einer kleinen Zahl von Ländern engagiert sein. Eine geografisch konzentrierte Anlagestrategie kann in höherem Maße Volatilität und Risiken ausgesetzt sein, als eine geografisch breiter gestreute. Die Fondsanlagen reagieren infolge der Wirtschafts- oder Geschäftslage in dem Land, in dem der Fonds investiert ist, empfindlicher auf Wertschwankungen. Infolgedessen kann die Gesamtertragsrendite des Fonds von ungünstigen Entwicklungen in einem solchen Land negativ beeinflusst werden.
- (h) **Aktienrisiko:** Der Wert von Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren kann durch mehrere Faktoren beeinträchtigt werden, u. a. die Aktivitäten und Ergebnisse des Emittenten, allgemeine und regionale Wirtschaften, Marktbedingungen und allgemeine wirtschaftliche und politische Entwicklungen. Dies kann zu Schwankungen im Wert des Fonds führen.
- (i) Der Fonds investiert vorrangig in Wertpapiere innerhalb eines bestimmten oder einer kleinen Anzahl von Sektoren und/oder Branchen. Ungünstige Entwicklungen innerhalb dieser Sektoren und/oder Branchen können den Wert der dem Fonds zugrunde liegenden Wertpapiere, die in solche Titel investieren, beeinflussen. Anleger sollten bereit sein, ein höheres Risiko zu akzeptieren, wenn sie in einen Fonds (wie diesen Fonds) investieren, der primär in Wertpapiere innerhalb eines bestimmten Sektors oder einer Branche bzw. in nur wenigen Sektoren und/oder Branchen investiert, als bei einem Fonds, der über verschiedene Sektoren breiter gestreut ist.
- (j) Der Fonds bildet die Wertentwicklung des Referenzindex durch Swaps synthetisch nach. Eine Anlage im Fonds stellt weder einen direkten oder indirekten Kauf oder sonstigen Erwerb noch eine Beteiligung an einer der im Referenzindex enthaltenen Aktien dar. Daher können die Risiken und Renditen einer Anlage im Fonds deutlich von einer physischen Anlage in den betreffenden im Referenzindex enthaltenen Aktien abweichen. Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass der Referenzindex – beständig oder überhaupt – erfolgreich positive Erträge erzielt und der Wert des Referenzindex kann unter außergewöhnlichen Umständen auf null fallen. Unter solchen Umständen besteht das wirtschaftliche Nettoengagement des Fonds im Referenzindex, nicht in den physischen Positionen des Fonds.
- (k) Ein Liquiditätsrisiko besteht, wenn ein bestimmtes Instrument schwer zu kaufen oder zu verkaufen ist. Ist eine Derivatetransaktionen besonders umfangreich oder der betreffende Markt illiquide, wie es bei zahlreichen privat ausgehandelten Derivaten der Fall ist, so kann möglicherweise eine Transaktion nicht initiiert oder eine Position nicht zu einem vorteilhaften Preis oder gar nicht liquidiert werden. Das kann sich auf die Fähigkeit der Verwaltungsgesellschaft auswirken, Zeichnungs- und Rücknahmeanträge zu bearbeiten.

Anleger sollten auch den Prospekt lesen, der zusätzliche Informationen zu Risiken und Interessenkonflikten enthält.

Eine englische Version eines Term Sheets, das die allgemeinen Bedingungen sämtlicher Derivatekontrakte, wie etwa Swap-Vereinbarungen, zusammenfasst, steht Anlegern auf Wunsch am eingetragenen Sitz der Gesellschaft zur Verfügung.

Haftungsausschlüsse

DIE VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER DER GESELLSCHAFT, DIE VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, DER ANLAGEVERWALTER UND DER INDEXANBIETER – ZUSAMMEN DIE „VERANTWORTLICHEN PARTEIEN“ – GARANTIEREN NICHT FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER DIE VOLLSTÄNDIGKEIT EINER BESCHREIBUNG IN BEZUG AUF DEN REFERENZINDEX ODER DER DARIN ENTHALTENEN DATEN, UND DIE VERANTWORTLICHEN PARTEIEN HAFTEN NICHT FÜR ETWAIGE DIESBEZÜGLICHE FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER STÖRUNGEN. DIE VERANTWORTLICHEN PARTEIEN ÜBERNEHMEN GEGENÜBER DEM FONDS, EINEM ANTEILSINHABER DES FONDS ODER EINER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSON IN BEZUG AUF DEN HIERIN BESCHRIEBENEN REFERENZINDEX WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND EINE GEWÄHR.

DER INDEXANBIETER ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN REFERENZINDEX ODER DIE STRATEGIE ODER JEDLICHE DARIN ENTHALTENE DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT AUSDRÜCKLICH JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER DIE EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DES VORHERSTEHENDEN HAFTET DER INDEXANBIETER IN KEINEM FALL FÜR KONKRETE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN ODER FÜR ENTGANGENE GEWINNE, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Der Fonds wird nicht von der Nasdaq, Inc. oder ihren verbundenen Unternehmen (Nasdaq, zusammen mit ihren verbundenen Unternehmen die „**Körperschaften**“) gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben. Die Körperschaften haben keine Aussagen zur Rechtsgültigkeit oder Eignung von Beschreibungen und Offenlegungen bezüglich des Fonds oder deren Richtigkeit oder Angemessenheit getroffen. Die Körperschaften geben gegenüber den Eigentümern des Fonds oder gegenüber anderen Personen keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Erklärungen oder Zusicherungen dahingehend ab, ob Anlagen in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem Fonds im Besonderen empfehlenswert sind, oder hinsichtlich der Fähigkeit des NASDAQ-100 Index®, die allgemeine Aktienmarktperformance nachzubilden. Die einzige Beziehung der Körperschaften zur Gesellschaft („**Lizenznehmer**“) besteht in der Lizenzierung des Nasdaq®, NASDAQ-100 Index®, bestimmter Handelsnamen der Körperschaften sowie der Verwendung des NASDAQ-100 Index®, der von der Nasdaq ohne Berücksichtigung der Belange des Lizenznehmers oder des Fonds ermittelt, zusammengestellt und berechnet wird. Nasdaq ist nicht verpflichtet, bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des NASDAQ-100 Index® die Interessen des Lizenznehmers oder der Eigentümer des Fonds zu berücksichtigen. Die Körperschaften sind nicht haftbar für und waren nicht beteiligt an der Festlegung der Zeitpunkte, Preise oder Mengen, zu denen der Fonds ausgegeben wird, oder an der Festlegung oder Berechnung der Gleichung, anhand derer der Fonds in Barmittel umgerechnet wird. Die Körperschaften übernehmen keinerlei Haftung im Zusammenhang mit der Administration oder dem Vertrieb von oder dem Handel mit dem Fonds.

DIE KÖRPERSCHAFTEN ÜBERNEHMEN KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER DIE UNUNTERBROCHENE BERECHNUNG DES NASDAQ-100 INDEX® ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. DIE KÖRPERSCHAFTEN ÜBERNEHMEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND GEWÄHR FÜR DIE ERGEBNISSE, DIE DER LIZENZNEHMER, DIE EIGENTÜMER DES FONDS ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES NASDAQ-100 INDEX® ODER DER DARIN ENTHALTENEN DATEN ERZIELEN KÖNNEN. DIE KÖRPERSCHAFTEN ÜBERNEHMEN IN BEZUG AUF DEN NASDAQ-100 INDEX® ODER DIE DARIN ENTHALTENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER DIE EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE KÖRPERSCHAFTEN IN KEINEM FALL FÜR ENTGANGENE GEWINNE, ODER KONKRETE ODER ZUFÄLLIGE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.