



**Indexleitfaden für den**

***Cannabis Total Opportunity Index***

ISIN: DE000A2LoQV1

**("Indexleitfaden")**

Version 2.0 vom 01.06.2022

## Wichtige Informationen

Die allgemeinen Grundsätze des Cannabis Total Opportunity Index (der "**Index**") vom 27.11.2018 sind nachstehend aufgeführt.

Es ist zu beachten, dass die allgemeinen Grundsätze des Index von Zeit zu Zeit aktualisiert oder geändert werden können. Bei der Verwaltung des Index verwendet der Index-Administrator die hier beschriebene Methode, deren Anwendung zwingend und bindend ist. Es kann nicht garantiert werden, dass keine steuerlichen, marktbezogenen, regulatorischen, rechtlichen, finanziellen oder sonstigen Umstände eintreten, die nach Ansicht des Index-Administrators eine Anpassung oder Änderung dieser Methodik erforderlich oder wünschenswert machen würden; der Index-Administrator ist daher berechtigt, eine solche Anpassung oder Änderung der Bestimmungen des Index vorzunehmen, die in den allgemeinen Regeln des Index aufgeführt sind. Der Index-Administrator kann auch Änderungen an den Bedingungen des Index vornehmen, die er für notwendig oder wünschenswert hält, einschließlich (aber nicht beschränkt auf) die Korrektur offensichtlicher oder nachgewiesener Fehler zur Behebung, Korrektur oder Ergänzung von Unklarheiten oder fehlerhaften Bestimmungen in dieser Beschreibung des Index. Jede solche Anpassung oder Änderung wird entsprechend wirksam und gilt als Aktualisierung dieser allgemeinen Regeln des Index ab ihrem Gültigkeitsdatum.

Dieses Dokument wird vom Index-Administrator bereitgestellt. Alle hierin enthaltenen Informationen dienen nur zu Informationszwecken und es wird keine Gewähr für ihre Eignung für einen bestimmten Zweck, zufriedenstellende Qualität oder anderweitig übernommen. Der Index-Administrator hat sich nach besten Kräften bemüht sicherzustellen, dass alle Informationen korrekt sind, aber der Index-Administrator kann keine Verantwortung oder Haftung (auch nicht bei Fahrlässigkeit) für Fehler oder Auslassungen oder für Verluste, die sich aus der Verwendung dieser Informationen ergeben, übernehmen.

Die hier dargestellten Informationen wurden auf der Grundlage öffentlich zugänglicher Informationen, intern entwickelter Daten oder anderer Quellen Dritter, die als zuverlässig erachtet werden, erstellt. Alle Meinungen und Ansichten stellen Feststellungen zum Zeitpunkt der Erstellung dar und können jederzeit ohne Mitteilung geändert werden.

Dieses Dokument stellt weder eine Aufforderung zur Investition in ein auf dem Index basierendes Produkt (ein "**Indexbezogenes Produkt**") dar, noch stellen die hierin enthaltenen Informationen, Empfehlungen oder Meinungen ein Angebot zum Verkauf eines Indexbezogenen Produkts dar.

## **Inhaltsverzeichnis**

Einleitung.....	4
1. Index-Beschreibung.....	4
2. Index-Methodik.....	8
3. Berechnung des Index .....	10
4. Änderungshistorie .....	13
5. Kontaktdaten.....	13
6. Definitionen .....	14

## **EINLEITUNG**

Dieses Dokument enthält die zugrundeliegenden Prinzipien und Vorschriften bezüglich der Struktur und der Funktionsweise des Index. Der Index ist alleiniges Eigentum des Index-Sponsors. LIXX als Index-Administrator und Indexberechnungsstelle bemüht sich nach besten Kräften, die Korrektheit der Mechanik und der Berechnung des Index sicherzustellen. Für LIXX besteht - unabhängig von möglichen Verpflichtungen gegenüber Emittenten - keine Verpflichtung, Dritte, einschließlich Anleger und/oder Finanzintermediäre, über etwaige Fehler im Index zu informieren. Dieses Dokument dient als Richtlinie für die Zusammensetzung, Berechnung und Verwaltung des Index. Änderungen des Indexleitfadens werden vom Index-Administrator veranlasst.

Die Berechnung und Veröffentlichung des Index durch LIXX ist keine Empfehlung für eine Kapitalanlage und enthält keine Zusicherung oder Meinung bezüglich einer möglichen Anlage in ein auf diesem Index basierendes Finanzinstrument.

### **1. INDEX-BESCHREIBUNG**

#### **1.1 Zusammenfassung der Index-Spezifikationen**

<b>Referenzmarkt</b>	<b>Zielsetzung</b>
Börsennotierte Aktien von Unternehmen, die geschäftliche Aktivitäten im Zusammenhang mit dem Anbau, der Produktion und / oder dem Vertrieb von Cannabis und / oder verwandten Produkten durchführen.	Ziel des Index ist es, die Performance widerzuspiegeln, die ein Anleger durch Investitionen in solche Cannabis-Aktien erreichen kann, die dem Ziel einer optimalen Balance zwischen maximaler Rendite und Risiko auf Portfolioebene dienen. Um der wirtschaftlichen Realität, insbesondere solchen Faktoren wie Verfügbarkeit von Instrumenten, Wiederanlage von fällig werdenden Instrumenten und Portfoliogröße, Rechnung zu tragen, können die Indexkomponenten angepasst und ihre Gewichtung während der Laufzeit angepasst werden.

### **Verwaltung von Index und Regulierungsstatus**

Der Index wird vom Index-Administrator berechnet, verwaltet, angepasst und veröffentlicht und vom Index-Sponsor gesponsert. Der Index wird nach den Empfehlungen des Index-Allokators gepflegt und angepasst.

Derzeit gilt der Index als "nicht-signifikante Benchmark" im Sinne von Artikel 3 Absatz 1 (27) der Verordnung (EU) 2016/2011 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2016 ("**Benchmark-Verordnung**"). Der Index wird in Übereinstimmung mit den anwendbaren Bestimmungen der Benchmark-Verordnung und den anwendbaren delegierten Verordnungen verwaltet. Der Index-Administrator kann nach eigenem Ermessen beschließen, einige oder alle nicht zwingenden, verzichtbaren Verpflichtungen gemäß Artikel 26 der Benchmark-Verordnung nicht anzuwenden.

### **Universum der Indexkomponenten**

Nur börsennotierte Aktien von Unternehmen mit geschäftlichen Aktivitäten im Zusammenhang mit dem Anbau, der Produktion und / oder dem Vertrieb von Cannabis und / oder verwandten Produkten, sowie Bargeld

### **Indexkomponenten und ihre Auswahl**

Die Auswahl der Aktien zielt auf ein optimales Gleichgewicht zwischen Risiko und Rendite (Details sind im Abschnitt 2.2 *Indexkomponenten und ihre Auswahl* beschrieben).

### **Allokation der Indexkomponenten**

Die Allokation erfolgt über die Ergebnisse eines Mittelwert-Varianz-Algorithmus. Die Bestimmung der Gewichtungen der Indexkomponenten werden vom Index-Administrator innerhalb der hier beschriebenen Kriterien auf Empfehlung des Index-Allokators gemäß den Bedingungen eines Index-Allokationsvertrages ("**Index-Allokationsvertrag**") umgesetzt.

### **Methodik**

Die Methodik des Index ist in Abschnitt 2 (*Indexmethodik*) beschrieben.

### **Technische Daten**

Die Bezugswährung des Index ist USD, der Index wird täglich berechnet.

Der Index verwendet keinen Hebel (*Leverage*).

Der Index ist ein *Total Return Net Index*, d.h. Dividenden oder Kuponzahlungen werden nach Abzug von 35% Quellensteuer in das hypothetische Portfolio des Index reinvestiert.

<b>Datenzulieferer</b>
Die Bestimmung der Indexkomponenten und deren Gewichtung erfolgt auf Empfehlung des Index-Allokators.
Die Offizielle Bewertung ist der tägliche Schlusskurs der jeweiligen Indexkomponente.

## 1.2 Name und ISIN

Der Name des Index ist Cannabis Total Opportunity. Der Index wird unter der ISIN DE000A2LoQV1 geführt.

## 1.3 Anfänglicher Indexwert

Der Index wird am 27. November 2018 ("**Indexstarttag**") mit einem anfänglichen Stand von 100,00 Indexpunkten ("**Anfänglicher Indexwert**") festgelegt.

## 1.4 Distribution

Der Indexwert wird von LIXX auf einer Unterseite von lixxinnovation.com an jedem Indexbewertungstag, spätestens fünf Geschäftstage nach dem jeweiligen Indexbewertungstag, veröffentlicht.

## 1.5 Preise und Berechnungshäufigkeit

Der Index wird täglich an jedem Geschäftstag bis 11:00 Uhr (Düsseldorfer Zeit) berechnet (jeweils ein "**Indexbewertungstag**"). Wenn ein geplanter Indexbewertungstag kein Geschäftstag ist, ist der Indexbewertungstag der nächste Geschäftstag. Die Indexberechnung basiert auf der Offiziellen Bewertung der jeweiligen Indexkomponenten. Der Index-Administrator wird geeignete Maßnahmen ergreifen, um eine Unterbrechung des Prozesses der Bereitstellung des Index zu vermeiden. Falls jedoch keine relevanten Daten beschafft werden können, wird der Index-Administrator den Index nicht veröffentlichen. Fehlerhafte Berechnungen werden nachträglich korrigiert.

## 1.6 Index-Administrator und externe Dienstleister

In der Regel ernennt der Index-Administrator die Index-Berechnungsstelle und den Index-Allokator.

Anpassungen des Indexwertes werden von der Index-Berechnungsstelle unter Aufsicht des Index-Administrators festgelegt.

Der Index-Administrator folgt bei der Erfüllung seiner Aufgaben den auf seiner Webseite veröffentlichten Geschäftsgrundsätzen und den anwendbaren Bestimmungen der Benchmark-Verordnung und deren delegierten Regelungen.

Um die Ökonomie des Referenzmarktes und die Zielsetzung des Index, wie oben beschrieben, widerzuspiegeln, identifiziert der Index-Allokator geeignete Indexkomponenten und empfiehlt die Allokation und Gewichtung der Indexkomponenten innerhalb der hier beschriebenen Kriterien. Der Index-Administrator legt die Indexkomponenten auf der Grundlage der Empfehlungen des Index-Allokators fest.

Bei der Verwaltung des Index verwendet der Index-Administrator die hier beschriebene Methode, deren Anwendung zwingend und bindend ist. Es kann nicht garantiert werden, dass keine steuerlichen, marktbezogenen, regulatorischen, rechtlichen, finanziellen oder sonstigen Umstände eintreten, die nach Ansicht des Index-Administrators eine Anpassung oder Änderung dieser Methodik erforderlich machen oder wünschenswert machen würden; der Index-Administrator ist daher berechtigt, eine solche Anpassung oder Änderung der Bestimmungen des Index vorzunehmen, die in den allgemeinen Regeln des Index aufgeführt sind. Der Index-Administrator kann auch Änderungen an den Bedingungen des Index vornehmen, die er für notwendig oder wünschenswert hält, einschließlich (aber nicht beschränkt auf) der Korrektur offensichtlicher oder nachgewiesener Fehler zur Behebung, Korrektur oder Ergänzung von Unklarheiten oder fehlerhaften Bestimmungen in dieser Beschreibung des Index. Jede solche Anpassung oder Änderung wird entsprechend wirksam und gilt als Aktualisierung dieser allgemeinen Regeln des Index ab ihrem Gültigkeitsdatum.

### **1.7 Veröffentlichung**

Die für die Indexberechnung relevanten Spezifikationen und Informationen werden auf der Webseite <http://www.lixxinnovation.com> und den Unterseiten zur Verfügung gestellt.

### **1.8 Historische Daten**

Historische Daten werden gemäß Artikel 8 der Benchmark-Verordnung, soweit erforderlich, aufgezeichnet. Dies bedeutet, dass alle Eingabedaten und die Methodik mindestens fünf Jahre lang aufgezeichnet werden.

### **1.9 Lizenzierung**

Lizenzen zur Nutzung des Index als Benchmark für derivative Instrumente können vom Index-Administrator an Börsen, Banken, Finanzdienstleister und Investmenthäuser vergeben werden.

## **2. INDEX-METHODIK**

Der Index-Allokator empfiehlt dem Index-Administrator Indexkomponenten aus dem Universum der Indexkomponenten und die Gewichtung der Indexkomponenten, um den Referenzmarkt und das Ziel des Index möglichst genau widerzuspiegeln. Als solche gelten die Empfehlungen des Index-Allokators als Eingabedaten und der Index-Allokator gilt als Kontributor von Eingabedaten gemäß Artikel 11 der Benchmark-Verordnung, sofern anwendbar.

Bei der Ausführung der Empfehlung stellt der Index-Administrator sicher, dass (i) die Auswahl der Indexkomponenten und (ii) die Gewichtung mit dem Indexleitfaden übereinstimmt.

Der Index-Allokator wird die Zusammensetzung des Index nach seiner erstmaligen Zusammensetzung laufend überprüfen. Index-Administrator kann entsprechend der Empfehlung des Index-Allokators Indexkomponenten aus dem Universum der Indexkomponenten dem Index hinzufügen, wenn diese dem Indexleitfaden entsprechen. Darüber hinaus können Gewichtungen der Indexkomponenten entsprechend der Empfehlung des Index-Allokators angepasst werden. Die Anzahl der Indexkomponenten kann sich im Laufe der Zeit ändern.

Der Indexwert wird auf Basis der Offiziellen Bewertungen ermittelt.

### **2.1 Universum der Indexkomponenten**

Die Instrumente, die Teil des Index sein können, sind in **Anhang 2.1** dieses Indexleitfadens ("**Universum der Indexkomponenten**") aufgeführt.

### **2.2 Indexkomponenten und ihre Auswahl**

Aus dem Universum der Indexkomponenten können einzelne Finanzinstrumente nur dann als Indexkomponente zur Aufnahme in den Index verwendet werden, wenn sie die in **Anhang 2.2** dieses Indexleitfadens aufgeführten Auswahlkriterien erfüllen.

### **2.3 Allokation der Indexkomponenten**

Die Gewichtung der in Frage kommenden Indexkomponenten erfolgt durch den Index-Administrator auf Empfehlung des Index-Allokators innerhalb der in **Anhang 2.3** aufgeführten Allokationskriterien. Die Zuordnung der Indexkomponenten liegt im Rahmen des beschriebenen Rahmens im Ermessen des Index-Allokators als Kontributor von Eingangsdaten.

### **2.4 Änderungen der Indexkomponenten**

Eine Indexkomponente kann aus dem Index entfernt werden, wenn sie die Auswahlkriterien des Index nicht mehr erfüllt oder generell die Kriterien zur Aufnahme in den Index nicht erfüllt. Indexkomponenten können auch aus dem Index entfernt werden, um sicherzustellen, dass der Index zu jeder Zeit seine Ziele erfüllt und Beschränkungen im Hinblick auf seine Zusammensetzung einhält. Sobald die Zuordnung der entfernten Indexkomponenten festgelegt ist, kann die jeweilige Zuordnung einiger oder aller übrigen Indexkomponenten entsprechend angepasst werden. Wenn eine Indexkomponente aus dem Index entfernt wird, kann eine Ersatzindexkomponente für die



Aufnahme in den Index in Frage kommen und dem Index hinzugefügt werden. Es ist jedoch nicht erforderlich eine bestehende Indexkomponente zu entfernen, um eine neue geeignete Indexkomponente hinzuzufügen.

Eine Indexkomponente kann dem Index hinzugefügt werden, wenn sie für die Aufnahme in den Index geeignet ist. Indexkomponenten können dem Index hinzugefügt werden, um sicherzustellen, dass der Index jederzeit seine Ziele erfüllt und Beschränkungen im Hinblick auf seine Zusammensetzung einhält. Sobald die Zuordnung von neuen Indexkomponenten festgelegt ist, kann die jeweilige Zuordnung einiger oder aller vor den Zugängen vorhandenen Indexkomponenten entsprechend angepasst werden.

### 3. BERECHNUNG DES INDEX

#### 3.1 Index-Formel

Die Indexberechnungsstelle berechnet an jedem Indexbewertungstag den Indexwert. Diese Berechnung basiert auf der Offiziellen Bewertung der Indexkomponenten.

Die Indexberechnungsstelle berechnet den Indexwert nach der folgenden Formel:

$$Index_t = \frac{\sum_{ii} (W_{ii} \times P_{ii}) - A_t - F_t}{D_t}$$

$$D_t = \frac{\sum_{ii} (W_{ii} \times P_{ii}) - A_t - F_t}{100}$$

dabei gilt:

$Index_t$	ist der Indexwert zum Zeitpunkt t.
$W_{ii}$	ist die Anzahl der Anteile bzw. der Nominalwert einer Indexkomponente (als Anschaffungskosten) im Index zum Zeitpunkt t.
$P_{ii}$	ist die Offizielle Bewertung jeder Indexkomponente zum Zeitpunkt t > 0, gegebenenfalls umgerechnet in US-Dollar.
$A_t$	ist der Anpassungsfaktor, der nach billigem Ermessen der Indexberechnungsstelle zum Zeitpunkt t mit Bezug auf Anpassungen während der Laufzeit des Index, die aufgrund der unter 3.3 beschriebenen Anpassungen notwendig werden können, ermittelt wird.
$F_t$	ist die Höhe der angefallen Indexgebühren bis t. Für jede Änderung einer Indexkomponente wird eine Gebühr von 0,15% pro Indexkomponente und Nominalbetrag erhoben. Eine Änderung ist entweder das Hinzufügen oder Entfernen einer Indexkomponente. Die Anpassung der Gewichtung einer bestehenden Indexkomponente ist von der Gebühr ausgeschlossen.
$i$	repräsentiert eine einzelne Indexkomponente.
$D_t$	Divisor zum Zeitpunkt t.

#### 3.2 Genauigkeit

Der Wert des Index wird auf zwei Nachkommastellen gerundet.

### 3.3 Sonstige Anpassungen

Falls erforderlich, kann die Indexberechnungsstelle diesen Indexleitfaden nach billigem Ermessen ändern, um die Erreichung des in diesem Indexleitfaden definierten Ziels des Index sicherzustellen oder Fehler, Auslassungen oder Unklarheiten zu beseitigen. Solche Änderungen können Anpassungen der Auswahlkriterien für die Indexkomponenten oder der Regeln für die Zusammensetzung, Berechnung und Gewichtung des Index beinhalten.

### 3.4 Anpassungen an systematische Veränderungen

3.5.1 Dividenden, Zinsen und andere Ausschüttungen werden dem Index als Barmittel in der Währung der jeweiligen Indexkomponente zugeordnet. Es fällt eine Quellensteuer von 35% an, die abgezogen wird.

3.5.2 Im Falle einer Kapitalmaßnahme in Bezug auf eine Indexkomponente beurteilt die Indexberechnungsstelle, ob eine solche Kapitalmaßnahme einen Verwässerungseffekt oder eine andere Auswirkung auf den Preis der Indexkomponente hat. In einem solchen Fall nimmt die Indexberechnungsstelle die erforderlichen Anpassungen vor und bestimmt das Datum, an dem diese Anpassungen wirksam werden. Die Indexberechnungsstelle kann unter anderem Anpassungen berücksichtigen, die von einer Börse aufgrund der Kapitalmaßnahme in Bezug auf Optionen und Futures durchgeführt werden.

Splits erfordern die Neuberechnung des Parameters "W" unter der Annahme, dass das Splitverhältnis auf die Preisänderung wie folgt anwendbar ist:

$$W_{i,t+1} = W_{i,t} * S$$

dabei gilt:

$W_{i,t+1}$	ist die Anzahl der im Index zum Zeitpunkt t+1 betroffenen Einheiten / Notional
$W_{it}$	ist die Anzahl der im Index zum Zeitpunkt t betroffenen Einheiten / Notional
S	Einheiten / Notional nach dem Split für jede Einheit / Notional vor dem Split

Aktienzuteilungen erfordern die Neuberechnung des Parameters "W" unter der Annahme, dass das Ausschüttungsverhältnis auf die Kursveränderung wie folgt anwendbar ist:

$$W_{i,t+1} = W_{i,t} * (1 + S)$$

dabei gilt:

$W_{i,t+1}$	ist die Anzahl der im Index zum Zeitpunkt t+1 betroffenen Einheiten / Notional
$W_{it}$	ist die Anzahl der im Index zum Zeitpunkt t betroffenen Einheiten / Notional
S	Einheiten / Notional für jede Einheit / Notional vor der Zuteilungen

### **3.5 Rebalancing**

Indexanpassungen gemäß Abschnitt 2.3 und 2.4 dieses Indexleitfadens werden vom Index-Administrator rechtzeitig nach Erhalt der Empfehlung des Index-Allokators durchgeführt. Eventuelle Anpassungen basieren auf den Tagesendkursen der jeweiligen Indexkomponente. Nur in den Fällen, in denen eine solche Empfehlung nicht mit dem Indexziel übereinstimmt, wird sie vom Index-Administrator nicht berücksichtigt. Die Zusammensetzung des Index soll vierteljährlich nach Ermessen des Index-Allokators angepasst werden (Rebalancing).

### **3.6 Datenzulieferer**

Die Festlegung der Indexkomponenten und deren Gewichtung erfolgt auf Empfehlung des Index-Allokators.

Die Offizielle Bewertung ist der tägliche Tagesendkurs jeder Indexkomponente.

### **3.7 Index-Kontinuität**

Bei fehlenden, unzureichenden, ungenauen oder unzuverlässigen Eingabedaten oder bei Nichteinhaltung der unten aufgeführten Standards kann der Index-Administrator die Indexberechnung aussetzen und den Index nicht veröffentlichen. Die Entscheidung wird nach Ermessen des Index-Administrators getroffen. Falls die festgelegten Standards längere Zeit nicht erfüllt werden, wird der Index-Administrator zum Schutz der Nutzer des Index diese Informationen entweder durch Änderung des Indexleitfadens oder auf seiner Website veröffentlichen. Bei seiner Entscheidung wird der Index-Administrator gegebenenfalls Experten konsultieren.

Die Mindestanforderungen an die Menge der Eingabedaten sind:

- Ein Preis für jede Indexkomponente; und
- Ein berechneter Indexgebührenwert als Teil der Indexberechnungsformel gemäß Kapitel 3.1.

Die Mindestanforderungen an die Qualität der Eingabedaten sind:

- Daten müssen zuverlässig und konsistent sein;
- Daten müssen robust sein;
- Daten müssen überprüfbar sein;
- Daten müssen vor 10:00 Uhr an jedem Index-Bewertungstag verfügbar sein.

### **3.8 Interne Überprüfung und Genehmigung der Methodik**

Nach der Erstellung der indexbezogenen Dokumentation erfolgt eine Überprüfung, ob die Anforderungen der Benchmark-Verordnung berücksichtigt werden und ob eine operative Umsetzbarkeit gegeben ist. Anschließend erfolgt eine Überarbeitung und weitere Abstimmung mit den relevanten Parteien, unter anderem anhand einer speziellen LIXX-Checkliste, um die Einhaltung der Benchmark-Verordnung sicherzustellen. Die Checkliste enthält unter anderem Dokumentationsanforderungen der Benchmark-Verordnung. Nach erfolgreichem Abschluss der genannten

Schritte steht es dem Management von LIXX frei, einen Index freizugeben. Die Methodik wird jährlich überprüft.

### **3.9 Verfahren zur Konsultation und wesentliche Änderungen**

Im Falle einer vorgeschlagenen wesentlichen Änderung der Methodik liegt es in der Verantwortung des Vorschlagenden, sich mit LIXX in Verbindung zu setzen und den entsprechenden Antrag zu stellen. Diese Mitteilung muss in jedem Fall schriftlich oder per E-Mail erfolgen. LIXX wird den Fall anschließend hinsichtlich der angegebenen Gründe prüfen.

#### Wesentliche Änderungen

1. Wesentliche Änderungen sind Veränderungen, die zum Zeitpunkt der Umstellung zu einer Veränderung des Indexwertes um > 3% gegenüber dem Indexwert ohne die Änderung am letzten Indexbewertungstag führen.
2. Wesentliche Änderungen sind auch methodische Anpassungen, die längerfristig zu signifikanten Veränderungen der Indexwerte führen. Die Bestimmung der Signifikanz liegt im Ermessen von LIXX, die jederzeit die Interessen des Index-Sponsors und der Nutzer berücksichtigen muss.

#### Informationen für Anwender

Bei wesentlichen Änderungen stellt LIXX auf seiner Homepage den aktualisierten Indexleitfaden zur Verfügung. Sollte es Lizenznehmer des Index geben, werden die Lizenznehmer von LIXX über die Änderung informiert.

## **4. ÄNDERUNGSHISTORIE**

27.11.2018 – 1.0 – Initiale Version

01.06.2022 – 2.0 – Der Abschnitt 4 "Änderungshistorie" wurde hinzugefügt.

01.06.2022 – 2.0 – Die Definition des Begriffs "Offizielle Bewertung" in Abschnitt 6 wurde aus Gründen der Klarstellung von "Die offizielle Bewertung basiert auf dem Tagesendkurs jeder Indexkomponente ein Geschäftstag vor dem jeweiligen Indexbewertungstag in Übereinstimmung mit der Veröffentlichung einer relevanten Börse. [...]" in "Die offizielle Bewertung basiert auf dem Tagesendkurs jeder Indexkomponente am jeweiligen Indexbewertungstag in Übereinstimmung mit der Veröffentlichung einer relevanten Börse. [...]" geändert.

## **5. KONTAKTDATEN**

### **Informationen zum Index**

LIXX GmbH  
Bilker Allee 176 C  
40217 Düsseldorf

## 6. DEFINITIONEN

Geschäftstag	Tage, die weder in Zürich, Schweiz, noch in Düsseldorf, Deutschland, Feiertage sind
Datenzulieferer	Ein Kontributor, der Daten zur Berechnung oder Verwaltung des Index gemäß Artikel 11 der Benchmark-Verordnung zuliefert
Index	Cannabis Total Opportunity
Index-Administrator	LIXX
Index-Allokator	Swissquote Bank SA, eine Aktiengesellschaft nach schweizerischem Recht, eingetragen im Handelsregister des Amtsgerichts Gland unter CH-550.1.020.415-9 und Sitz in Gland, Schweiz
Index-Berechnungsstelle	LIXX
Indexkomponente	Ein bestimmtes Finanzinstrument, das aus dem Universum der Indexkomponenten ausgewählt wurde und Bestandteil des Index wird
Index-Sponsor	Swissquote Bank SA, eine Aktiengesellschaft nach schweizerischem Recht, eingetragen im Handelsregister des Amtsgerichts Gland unter CH-550.1.020.415-9 und Sitz in Gland, Schweiz
Indexbezogenes Produkt	Jedes auf dem Index basierende Investmentprodukt
Indexwert	Wert des Index am Indexbewertungstag
Indexbewertungstag	Wird in Abschnitt 1.5 definiert

LIXX	LIXX GmbH, eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung, eingetragen im Handelsregister des Amtsgerichts Düsseldorf unter HRB 81816 und Sitz Bilker Allee 176c, 40217 Düsseldorf
Offizielle Bewertung	Die offizielle Bewertung basiert auf dem Tagesendkurs jeder Indexkomponente am jeweiligen Indexbewertungstag in Übereinstimmung mit der Veröffentlichung einer relevanten Börse. Falls kein Wert an diesem Tag verfügbar ist, wird der letzte verfügbare Kurs, bis zu fünf Tage rückwirkend, berücksichtigt.
Total Return Netto-Index	Index berechnet auf der Basis von reinvestierten Dividenden- oder Kuponzahlungen, abzüglich einer Quellensteuer von 35%.
Universum der Indexkomponenten	Instrumente, die Teil des Index sein können

## **Anhang 2.1 Universum der Indexkomponenten**

- Börsennotierte Aktien von Unternehmen mit geschäftlichen Aktivitäten im Zusammenhang mit dem Anbau, der Produktion und/oder dem Vertrieb von Cannabis und / oder verwandten Produkten
- Cash in US-Dollar
- Cash in Kanadischen Dollar



## **Anhang 2.2: Auswahlkriterien für Indexkomponenten**

Mit Ausnahme von Cash muss jede Indexkomponente die folgenden Auswahlkriterien erfüllen, um für den Index in Frage zu kommen:

- Minimale Marktkapitalisierung von USD 50 Mio.
- Durchschnittliches tägliches Handelsvolumen von USD 100.000
- Aktienkurs, pro Indexkomponente, über USD 0,10
- Es existiert ein Preis, der regelmäßig festgelegt wird
- Es existiert ein Preis, der öffentlich zugänglich ist

Alle aufgeführten Kriterien gelten nur für eine bestimmte Komponente am Tag der Aufnahme in den Index.

## **Anhang 2.3: Allokationskriterien; Anfängliche Indexzusammensetzung**

### **Allokationskriterien:**

Es können maximal 20 Indexkomponenten gleichzeitig im Index enthalten sein.

Alle Aktien, die Teil des Universums sind und als Indexkomponenten gemäß den Auswahlkriterien für Indexkomponenten in Frage kommen, werden im Hinblick auf die Geschäftsstrategie eines Unternehmens in der Cannabisindustrie, die Mehrheit der Einnahmen, die direkt aus der Cannabisindustrie generiert werden und eine quantitative Analyse, analysiert. Ziel ist es, einen Index zu erstellen, der ein optimales Verhältnis zwischen Risiko und Ertrag aufweist.

Zur Unterstützung dieser Analyse wird ein Algorithmus verwendet, der das Mittelwert-Varianz-Framework verwendet. Der Optimierungsalgorithmus zielt darauf ab, die Rendite unter der Einschränkung des Portfoliorisikos zu maximieren, das als Standardabweichung der täglichen Renditen definiert ist. Die wichtigsten Inputfaktoren sind Rendite, Volatilität und Korrelation.

Mit den oben beschriebenen Methoden und Kriterien liegt die Zuordnung der Gewichtungen im Ermessen des Index-Allokators. Indexkomponenten mit einer Gewichtung von Null werden nicht in den Index aufgenommen, wobei Cashkomponenten hiervon ausgeschlossen sind.

### **Anfängliche Indexzusammensetzung:**

<b>ISIN</b>	<b>Name</b>	<b>Gewicht</b>
CA05156X1087	Aurora Cannabis Inc	5.00%
CA03765K1049	Aphria Inc	4.00%
CA29082J1084	Emblem Corp	5.00%
CA86860J1066	Supreme Cannabis Co Inc/The	4.00%
US36197T1034	GW Pharmaceuticals PLC	8.00%
CA4283041099	HEXO Corp	5.00%
US45824V2097	Insys Therapeutics Inc	6.00%
CA68620P1018	Organigram Holdings Inc	5.00%
CA1378002077	CannTrust Holdings Inc	5.00%
CA1380351009	Canopy Growth Corp	4.00%
US98986X1090	Zynerba Pharmaceuticals Inc	8.00%
CA64079L1058	Neptune Wellness Solutions Inc	7.00%
US88688T1007	Tilray Inc	5.00%
CA22717L1013	Cronos Group Inc	5.00%
US1407551092	Cara Therapeutics Inc	5.00%
CA16106R1091	Charlottes Web Holdings Inc	4.00%
CA4492341033	ICC Labs Inc	7.00%
CA5667241007	Maricann Group Inc	5.00%
CA29102R1064	Emerald Health Therapeutics Inc	3.00%
n/a	Cash in US Dollar (USD)	0.00%
n/a	Cash in Kanadischen Dollar (CAD)	0.00%