



Dies ist eine Marketingkommunikation. Bitte lesen Sie den Fondsprospekt und das KIID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Anleger sollten beachten, dass sie mit einer Anlage Anteile an dem Fonds und nicht die zugrunde liegenden Vermögenswerte besitzen werden.

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

EUR I Thesaurierende Klasse

28. Februar 2022

ANLAGEZIEL DES FONDS

Der Fonds strebt durch Zeichnung von Verkaufsoptionen auf breit aufgestellte Indizes (z. B. S&P500 / Russell 2000) und die Anlage von Sicherheiten in ein abgestuftes, qualitativ hochwertiges kurzfristiges Portfolio aus Rentenwerten die Erzielung langfristiger, aktienähnlicher Renditen mit geringerer Volatilität als die breiter gefassten Aktienmärkte an.

MANAGEMENTTEAM

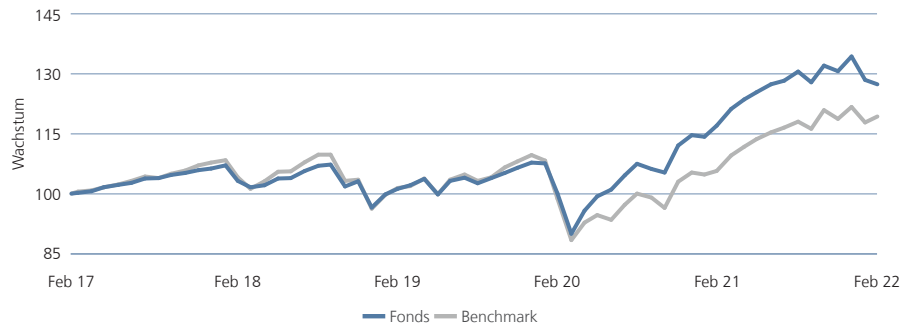
Derek Devens
Senior Portfoliomanager

FONDSDATEN

Auflegungsdatum (Fonds)	30. Dezember 2016
Auflegungsdatum (Anteilsklasse)	13. Februar 2017
Basiswährung (Fonds)	USD
Währung (Anteilsklasse)	EUR
Veraltetes Vermögen im Fonds (Mio. USD)	547,12
Nettoinventarwert (Währung der Anteilsklasse)	12,75
Domizil	Irland
Vehikel	OGAW
Bewertung	Täglich
Abwicklung (Zeichnung)	T+3
Annahmeschluss	15:00 (Zeit in Dublin)
Aufsichtsbehörde	Central Bank of Ireland
Managementgebühr	0,60%
Laufende Kosten*	0,77%
Ausgabeaufschlag (Max.)	0,00%
Bloomberg	NBPWIEA ID
ISIN	IE00BYX7LW42
Morningstar Kategorie™	Alternative Inv Optionshandel
Benchmark	Ein gemischter Maßstab bestehend aus 42.5% CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index, 42.5% CBOE S&P 500 PutWrite Index, 7.5% CBOE Russell 2000 One-Week PutWrite Index, 7.5% CBOE Russell 2000 PutWrite Index.

KUMULIERTE PERFORMANCE

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit sagt nichts über zukünftige Erträge aus.



Dieses Diagramm zeigt, wie sich der Wert einer Anlage von EUR 100 im Teilfonds an dessen Auflegungsdatum im Vergleich zu einer hypothetischen Anlage von USD 100 in einem oder mehreren Referenzwerten entwickelt hätte.

RENDITE (%) ¹	1 Mt. ²	3 Mt. ²	lfd. Jahr ²	1 Jahr ²	3 Jahre ³	5 Jahre ³	10 Jahre ³	Seit Auflage ^{3,4}
Fonds	-0,86	-2,52	-5,20	8,88	8,00	4,94	-	4,93
Benchmark	1,30	0,50	-1,98	13,01	5,59	3,51	-	3,58

12-MONATS-ZEITRÄUME (%)	Feb12	Feb13	Feb14	Feb15	Feb16	Feb17	Feb18	Feb19	Feb20	Feb21	Feb22
	Feb13	Feb14	Feb15	Feb16	Feb17	Feb18	Feb19	Feb20	Feb21	Feb22	
Fonds	-	-	-	-	-	2,99	-1,94	-1,09	16,98	8,88	
Benchmark	-	-	-	-	-	3,58	-2,55	-2,66	7,03	13,01	

KALENDERJAHREN %	2013	2014	2015	2016	2017 ⁵	2018	2019	2020	2021	2022 ⁶
Fonds	-	-	-	-	6,30	-9,22	11,71	6,40	17,26	-5,20
Benchmark	-	-	-	-	7,76	-10,73	14,01	-3,97	15,69	-1,98

Der Fonds wird aktiv verwaltet, was bedeutet, dass die Anlagen nach dem Ermessen des Anlageverwalters ausgewählt werden. Der Fonds ist nicht an seine Benchmark gebunden, die nur zu Vergleichszwecken herangezogen wird.

- ¹Performance bis zum letzten Monatsende. lfd. Jahr - laufendes Jahr. Mt. - Monat
- ²Renditen für diese Zeiträume sind kumulativ.
- ³Renditen werden für Zeiträume von mehr als einem Jahr annualisiert.
- ⁴Rücklauf vom 13. Februar 2017 bis zum letzten Monatsende.
- ⁵Die Daten werden seit dem Auflegungsdatum der Anteilsklasse angezeigt.
- ⁶Die Leistung für das laufende Kalenderjahr ist das laufende Jahr bis heute.

Die Wertentwicklung des Fonds ist repräsentativ für die EUR I Thesaurierende Klasse und wurde nach Abzug von Gebühren berechnet. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sollten beachten, dass die Renditen aufgrund von Währungsschwankungen steigen oder sinken können. **Die Fondspersone berücksichtigt keine Provisionen oder Kosten, die den Anlegern bei der Zeichnung oder Rücknahme von Anteilen entstehen.** Wo ein Benchmark angezeigt wird, die gezeigte Benchmark wird in der Basiswährung des Fonds bereitgestellt und ist daher möglicherweise kein angemessener repräsentativer Vergleich mit der gezeigten abgesicherten Währungsanteilsklasse. Die Differenz beim Währungsengagement und Währungsschwankungen bei einer nicht abgesicherten Benchmark können eine unbeabsichtigte Differenz bei einem Performance- oder Risikovergleich hervorrufen.

RENDITE (%) ¹	1 Mt. ²	3 Mt. ²	lfd. Jahr ²	1 Jahr ²	3 Jahre ³	5 Jahre ³	10 Jahre ³	Seit Auflage ^{3,4}
Referenzindex	-2,38	-4,28	-8,09	12,81	17,16	14,39	-	14,16

12-MONATS-ZEITRÄUME (%)	Feb12	Feb13	Feb14	Feb15	Feb16	Feb17	Feb18	Feb19	Feb20	Feb21	Feb22
	Feb13	Feb14	Feb15	Feb16	Feb17	Feb18	Feb19	Feb20	Feb21	Feb22	
Referenzindex	-	-	-	-	-	16,13	4,87	6,14	34,31	12,81	

KALENDERJAHREN %	2013	2014	2015	2016	2017 ⁵	2018	2019	2020	2021	2022 ⁶
Referenzindex	-	-	-	-	14,09	-5,36	30,61	18,81	26,63	-8,09

Der Fonds zeichnet Puts auf zwei verschiedene Indizes (S&P 500 und Russell 2000), und wir haben die folgenden Indexniveau-Renditedetails (85% S&P 500 Index, 15% Russell 2000 Index) bereitgestellt, um zu veranschaulichen, wie sich diese Indizes in ähnlichen Zeiträumen entwickelt haben.

KONTAKT

Client Services: +44 (0)20 3214 9096
 Client Services: +353 1 571 9646
 E-Mail: Clientservices@nb.com
 Website: www.nb.com
 Anrufe werden aufgezeichnet
 Seite 1 von 5

*Die Zahl der laufenden Kosten basiert auf den jährlichen Ausgaben für die Periode, die am 31. Dezember endet.
Nur für professionelle Kunden



Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

EUR I Thesaurierende Klasse

28. Februar 2022

RISIKEN

Marktrisiko: Das Risiko einer Änderung des Werts einer Position aufgrund zugrunde liegender Marktfaktoren, darunter unter anderem die allgemeine Performance von Unternehmen und die Marktwahrnehmung der Weltwirtschaft.

Liquiditätsrisiko: Das Risiko, dass der Fonds einen Vermögenswert nicht ohne Weiteres zu seinem angemessenen Marktwert verkaufen kann. Unter extremen Marktbedingungen kann dies die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, Rücknahmeanträgen auf Nachfrage nachzukommen.

Derivaterisiko: Der Fonds darf bestimmte Arten von derivativen Finanzinstrumenten verwenden (einschließlich bestimmter komplexer Instrumente). Dadurch wird die Hebelung des Fonds deutlich gesteigert, was zu großen Schwankungen beim Anteilswert führen kann. Der Einsatz von DFI durch den Fonds kann mit erheblichen Verlustrisiken verbunden sein. Anleger sollten beachten, dass der Fonds sein Anlageziel ggf. hauptsächlich durch derivative Finanzinstrumente (DFI) erreicht. Es bestehen einige Anlagerisiken im Zusammenhang mit der Verwendung von DFI.

Zinsrisiko: Das Risiko von Zinsschwankungen, die den Wert festverzinslicher Anleihen beeinflussen.

Kontrahentenrisiko: Das Risiko, dass eine Gegenpartei ihre im Rahmen eines Handelsgeschäfts, eines Vertrags oder eines anderen Geschäfts bestehenden Zahlungsverpflichtungen zum Fälligkeitstag nicht erfüllt.

Operationalles Risiko: Das Risiko eines direkten oder indirekten Verlusts aufgrund unzureichender oder fehlerhafter Prozesse und Systeme oder menschlicher Fehler, darunter jene, die mit der Verwahrung von Vermögenswerten zusammenhängen, oder aufgrund externer Ereignisse.

Währungsrisiko: Anleger, die in einer Währung zeichnen, die nicht der Basiswährung des Fonds entspricht, sind dem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen der betreffenden Wechselkurse können die Kapitalrenditen beeinträchtigen. Wo vergangene Leistung gezeigt wird es basiert auf der Aktiengattung, auf die sich dieses Factsheet bezieht. **Wenn sich die Währung dieser Anteilsklasse von Ihrer lokalen Währung unterscheidet, sollten Sie sich darüber im Klaren sein, dass die dargestellte Wertentwicklung aufgrund von Wechselkursschwankungen höher oder niedriger sein kann, wenn sie in Ihre Landeswährung umgerechnet wird.**

Ausführliche Informationen zu den Risiken sind dem Fondsprospekt und dem KIID zu entnehmen.

PORTFOLIOMERKMALE

Portfoliovermögen (Mio. USD)	547,12
% des Portfolios engagiert im S&P 500 Index	85,00
% of Portfolio exposed to Russell 2000 Index	15,00

RISIKOKENNZAHLEN

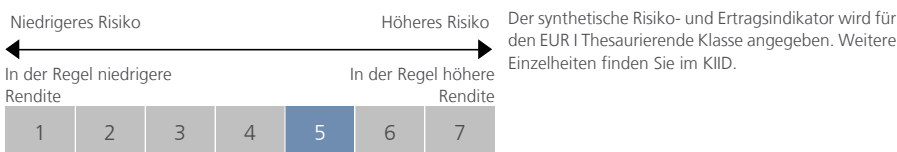
	3 Jahre
Alpha (%)	2,64
Tracking Error (%)	3,43
Sharpe Ratio	0,66
Information Ratio	0,70
Standardabweichung	11,36

OPTIONENSTATISTIK

Fiktiver Prozentsatz der Sicherheiten (%)	99,71
Gewichteter durchschnittlicher Prozentsatz der Moneyness (%)	99,20
Gewichtetes durchschnittliches Breakeven (%)	96,36
Gewichtete durchschnittliche Tage bis zur Fälligkeit	16,40
Gewichtetes durchschnittliches Delta	0,45
Anzahl der Positionen	50

MERKMALE VON SICHERHEITEN

Gewichtete Duration (Jahre)	0,82
Gewichtete durchschnittliche Rückzahlungsrendite (%)	0,86
Anzahl der Positionen	9
Kollateral-Investitionen	
Barmittel (%)	17,14
US-Staatsanleihen (Treasuries) %	82,86
<i>Weniger als 1 Jahr (%)</i>	36,39
<i>1 Jahr bis 3 Jahre (%)</i>	46,46
<i>Größer als 3 Jahre (%)</i>	0,00





Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

EUR I Thesaurierende Klasse

28. Februar 2022

I ANTEILSKLASSENDATEN

Anteilsklasse	Währung	Auflegungsdatum (Anteilsklasse)	ISIN	Bloomberg	VALOR Nummer	Mindestanlage
EUR I Thesaurierende Klasse	EUR	13-02-2017	IE00BYX7LW42	NBPWIEA ID	35476096	2.500.000
GBP I Thesaurierende Klasse - nicht abgesichert	GBP	02-03-2017	IE00BYWPKN37	NBPWIAU ID	35767960	2.500.000
USD I Thesaurierende Klasse	USD	30-12-2016	IE00BDDWG831	NBPWUIA ID	34907032	2.500.000
USD I (Monatlich) ausschüttende Klasse	USD	18-05-2017	IE00BD461232	NBPWIMD ID	36620913	2.500.000

Einige aufgeführte Anteilsklassen unterliegen Beschränkungen. Weitere Details entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt des Fonds.

Anleger, die in einer anderen Währung als ihrer Landeswährung zeichnen, sollten beachten, dass die Kosten aufgrund von Währungs- und Wechselkursschwankungen steigen oder sinken können.



Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund

EUR I Thesaurierende Klasse

28. Februar 2022

ESG DISCLOSURES

Der Fonds hält die Sustainable Finance Disclosure Regulation (die "SFDR") vollständig ein.

Neuberger Berman nimmt Nachhaltigkeit und die Förderung von Environmental, Social, Governance ("ESG") sehr ernst. Die ESG-Risiken werden bei der Auswahl von Wertpapieren berücksichtigt, sind aber nicht das Hauptkriterium für die Auswahl. Weitere Informationen zu nachhaltigkeitsbezogenen Aspekten im Sinne der SFDR finden Sie im Bereich ESG-Investing auf www.nb.com/europe/. Bei der Entscheidung für eine sollten Anleger alle Merkmale oder Ziele des beworbenen Fonds, wie sie in den rechtlichen Dokumenten beschrieben sind, berücksichtigen.

WICHTIGE INFORMATIONEN

Abgesehen von der Performance sind die ausgewiesenen Daten auf den Fonds und nicht auf eine bestimmte Anteilsklasse bezogen und wurden nicht entsprechend angepasst, um die unterschiedlichen Gebühren und Aufwendungen der Anteilsklassen widerzuspiegeln. Aufgrund der unterschiedlichen Gebühren, Aufwendungen und Währungen kann die Performance einer Anteilsklasse von den ausgewiesenen Angaben abweichen.

Quelle: Neuberger Berman, Bloomberg und Morningstar.

Die unterberatender Managers (sub-investment manager) des Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund sind Neuberger Berman Investment Advisers LLC und Neuberger Berman Europe Limited.

Dieses Dokument richtet sich ausschließlich an professionelle Kunden/qualifizierte Anleger.

Europäischer Wirtschaftsraum (EWR): Dieses Dokument dient Marketingzwecken und wird von Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited herausgegeben, eine von der Zentralbank in Irland regulierte Gesellschaft, die in Irland unter MFD Secretaries Limited, 32 Molesworth Street, Dublin 2, eingetragen ist.

Vereinigtes Königreich und außerhalb des EWR: Dieses Dokument dient der Bewerbung eines Finanzprodukts und wird von Neuberger Berman Europe Limited herausgegeben, eine von der Financial Conduct Authority zugelassene und regulierte Gesellschaft mit Sitz in England und Wales, The Zig Zag Building, 70 Victoria Street, London, SW1E 6SQ.

Neuberger Berman Europe Limited ist auch bei der Securities and Exchange Commission in den USA als Anlageberater registriert und die Zweigstelle in Dubai wird von der Dubai Financial Services Authority im Dubai International Financial Centre beaufsichtigt.

Dieser Fonds ist ein Teilfonds von Neuberger Berman Investment Funds PLC., der von der Zentralbank von Irland gemäß der European Communities (Undertaking for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 in der jeweils gültigen Fassung zugelassen ist. Die Informationen in diesem Dokument stellen keine Anlageberatung oder Anlageempfehlung dar und sind nur eine Kurzzusammenfassung einiger wichtiger Aspekte des Fonds. **Anleger sollten den Verkaufsprospekt und das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) lesen**, die auf unserer Website verfügbar sind: www.nb.com/europe/literature. Weitere Informationen zu Risiken, Anlagezielen, Gebühren und Aufwendungen sowie andere wichtige Informationen zum Fonds sind dem Prospekt zu entnehmen. Die vom Fonds gezahlten Gebühren und Kosten verringern die Rendite Ihrer Anlage. Bestimmte vom Fonds gezahlte Kosten können in USD, EUR, GBP, CHF, CNY, HKD, DKK, SGD oder anderen Währungen erhoben werden, und Wechselkurschwankungen können dazu führen, dass diese Kosten bei der Umrechnung in Ihre Landeswährung steigen oder fallen.

Das KIID ist kostenlos in Dänisch, Niederländisch, Englisch, Finnisch, Französisch, Deutsch, Griechisch, Isländisch, Italienisch, Norwegisch, Portugiesisch, Spanisch und Schwedisch erhältlich (je nachdem, wo der entsprechende Teilfonds für den Vertrieb registriert wurde), und der Prospekt sowie die Ergänzungen zum Prospekt sind kostenlos in Englisch, Französisch, Deutsch, Italienisch und Spanisch www.nb.com/europe/literature bei den lokalen Zahlstellen (eine Liste der Zahlstellen finden Sie in Anhang III des Prospekts) oder per Schreiben an Neuberger Berman Investment Funds plc, c/o Brown Brothers Harriman Fund Administration Service (Ireland) Ltd, 30 Herbert Street, Dublin 2, Irland, erhältlich.

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited kann beschließen, die für den Vertrieb seiner Fonds getroffenen Vereinbarungen in allen oder einem bestimmten Land zu beenden.

Eine Zusammenfassung der Rechte der Anleger ist in englischer Sprache unter www.nb.com/europe/literature verfügbar.

Hinweis für Anleger in der Schweiz: Dies ist ein Werbeprospekt. Neuberger Berman Investment Funds plc wurde in Irland als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und mit beschränkter Haftung unter irischem Recht gegründet und die Teilfonds wurden zudem durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA) für den Vertrieb an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz und von der Schweiz aus zugelassen. Die Schweizer Vertretung und Zahlstelle ist BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zurich, Schweiz. Der Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung und die Jahres- und Halbjahresberichte stehen alle beim Vertreter in der Schweiz kostenlos zur Verfügung.

Hinweis für Anleger in Spanien: Neuberger Berman Investment Fund plc ist bei der Comisión Nacional del Mercado de Valores ("CNMV") unter der Registrierungsnummer 295 in Spanien registriert.

Dieses Dokument wird nur zu Informationszwecken bereitgestellt und stellt keine Anlage-, Rechts-, Finanz- oder Steuerberatung und keine Empfehlung zum Kauf, Verkauf oder zum Halten von Wertpapieren dar.

Wir gewährleisten nicht, dass diese Informationen, einschließlich jeglicher von Dritten gelieferter Informationen, vollständig sind und dementsprechend darf sich darauf nicht verlassen werden.

Wir geben keine Empfehlung oder Beratung in Bezug darauf ab, ob eine Anlage oder Strategie für einen bestimmten Anleger geeignet ist. Jeder Empfänger dieses Dokument sollte die Recherchen durchführen, die er als erforderliche erachtet, um zu einer unabhängigen Beurteilung einer Anlage fähig zu sein, und er sollte sich mit seinen eigenen Anwälten und Beratern für finanzielle, versicherungsmathematische, rechnungslegungsbezogene, aufsichtsrechtliche und steuerliche Fragen beraten, um eine solche Anlage zu beurteilen.

Es ist nicht davon auszugehen, dass Kapitalanlagen in den ausgewiesenen oder beschriebenen Wertpapieren, Unternehmen, Sektoren oder Märkten rentabel sind oder waren. Anleger erhalten den investierten Betrag möglicherweise nicht in voller Höhe zurück.

Die geäußerten Ansichten oder Meinungen geben nicht unbedingt die Meinung der Firma als Ganzes wieder.

Alle Informationen sind zum Datum dieses Schriftstücks aktuell und können sich ohne vorherige Ankündigung ändern.

Der in diesem Dokument beschriebene Fonds darf nur in Rechtsordnungen zum Kauf angeboten oder verkauft werden, in denen ein solches Angebot oder ein solcher Verkauf zulässig ist, bzw. nur Personen, denen gegenüber ein solches Angebot oder ein solcher Verkauf zulässig ist. Der Fonds darf nur vertrieben werden, wenn ein solcher Vertrieb in Übereinstimmung mit den geltenden Regeln und Verordnungen der Rechtsordnung erfolgt. Dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen dürfen nicht in den USA weitergegeben werden.

Indizes werden nicht verwaltet und stehen nicht für Direktinvestitionen zur Verfügung.

Eine Anlage in dem Fonds ist mit Risiken verbunden, möglicherweise mit einem überdurchschnittlichen Risiko, und ist nur für Personen geeignet, die in der Lage sind, solche Risiken einzugehen.

Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Prospekt, der auf unserer Website unter www.nb.com/europe/literature zu finden ist.

Die frühere Wertentwicklung ist kein zuverlässiger Anhaltspunkt für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Der Wert der Anlagen könnte fallen oder steigen und die Anleger können eventuell die angelegten Beträge nicht zurückerhalten. In den Performanceangaben sind die Provisionen und Kosten, die den Anlegern im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen entstehen, nicht berücksichtigt.

Der Wert von Anlagen, die auf eine andere Währung lauten, kann aufgrund von Währungsschwankungen bezüglich der betreffenden Währungen steigen oder fallen. Ungünstige Devisenbewegungen können eine verminderte Rendite und Kapitalverlust zur Folge haben.

Die steuerliche Behandlung ist von den jeweiligen Umständen des einzelnen Anlegers abhängig und kann sich ändern. Daher wird Anlegern empfohlen, eine unabhängige Steuerberatung in Anspruch zu nehmen.

Die Anlage in den Fonds sollte keinen wesentlichen Bestandteil des Investment-Portfolios eines Anlegers ausmachen und ist möglicherweise für manche Anleger nicht geeignet. Diversifizierung und die Allokation in bestimmten Anlageklassen garantieren keinen Gewinn und schützen nicht vor Verlust.

© 2022 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen sind (1) Eigentum von Morningstar und/oder seinen Inhalt Lieferanten, (2) dürfen weder kopiert noch verbreitet werden und (3) es gibt keine Garantie, dass sie vollständig, korrekt oder aktuell sind. Weder Morningstar noch seine Contentprovider übernehmen die Verantwortung für Schäden oder Verluste, die durch eine Nutzung dieser Informationen entstehen. Die Performance der Vergangenheit ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Für ausführlichere Informationen über das Morningstar-Rating, einschließlich der Methodik für die kategorische Bewertung, finden Sie unter <https://shareholders.morningstar.com/investorrelations/governance/Compliance-Offenlegung/Standard.aspx>

Dieses Dokument darf weder ganz noch teilweise ohne vorherige schriftliche Genehmigung durch Neuberger Berman reproduziert werden.

Der Name „Neuberger Berman“ und das Logo sind eingetragene Servicemarken der Neuberger Berman Group LLC.

Kontakt: NB Europe – German Branch, **Tel:** +4969 36507 5900, **E-mail:** info-germany@nb.com

© 2022 Neuberger Berman Group LLC. Alle Rechte vorbehalten.



Glossar

CBOE Russell 2000 PutWrite Index (PUTR)

Dieser Index soll eine vorgeschlagene hypothetische Short-Put-Strategie darstellen, die eine monatliche Am-Geld-Put-Option auf den Russell 2000 Index verkauft. Die beschriebene Put-Option auf den Russell 2000 wird durch ein Geldmarktkonto besichert, das in einmonatige Schatzwechsel investiert ist.

CBOE S&P 500 PutWrite Index (PUT)

Dieser Index soll eine vorgeschlagene hypothetische Short-Put-Strategie darstellen. PUT ist ein preisgekrönter Benchmarkindex, der die Performance eines hypothetischen Portfolios misst, das Put-Optionen auf den S&P 500 Index gegen besicherte Barreserven, die in einem Geldmarktkonto gehalten werden, verkauft. Die PUT zielt auf den Verkauf einer Reihe von einmonatigen Am-Geld-Put-Optionen auf den S&P 500 Index und die Anlage von Barmitteln zu den Zinssätzen ein- und dreimonatiger Schatzwechsel ab.

Fiktiver Prozentsatz der Sicherheiten (%)

Der fiktive Wert von Optionen (Ausübungspreis x Kontrakte x Multiplikator), dividiert durch die Summe der Sicherheitenanlagen.

Russell 2000® Index

Dieser Index ist ein nicht verwalteter Index, der aus den Wertpapieren von etwa 2.000 Emittenten mit der geringsten Marktkapitalisierung im Russell 3000® Index besteht, was etwa 10 % der Gesamt-Marktkapitalisierung des Russell 3000 entspricht. Die Marktkapitalisierung des kleinsten Unternehmens beträgt ungefähr 78 Millionen US-Dollar. Der Russell 2000® Value Index misst die Performance jener Russell-2000®-Unternehmen mit geringeren Kurs-Buchwert-Verhältnissen und einem geringeren prognostizierten Wachstum.

S&P 500 Index

Dieser marktkapitalisierungsgewichtete Index besteht aus 500 Aktienwerten, die nach Marktgröße, Liquidität und ihrem für die Branche repräsentativen Charakter ausgewählt werden. Der S&P 500 Index zielt darauf ab, ein breites Spektrum von Industrie-segmenten der US-Wirtschaft abzubilden. Der S&P 500 konzentriert sich auf das Large-Cap-Segment des Marktes und deckt dabei über 80 % der US-Aktien ab. Zu den Aufnahmekriterien zählen finanzielle Stabilität (Minimierung des Wertpapierumschlags im Index), die Überprüfung der Stammaktien, um Unternehmen mit geringem Streubesitz zu vermeiden, und eine Handelsaktivität, die auf eine hohe Liquidität und einen effizienten Aktienkurs hinweist. Unternehmen, die sich in Fusion, Übernahme, Leveraged Buy-outs, Konkurs (Chapter-11-Antrag oder eine Aktionärsgenehmigung zur Rekapitalisierung, durch die sich die Eigenkapitalüberdeckung des Unternehmens ändert) bzw. Umstrukturierung befinden oder ihre jeweilige Branche nicht ausreichend repräsentieren, werden aus dem Index ausgeschlossen.

Gewichtetes durchschnittliches Breakeven (%)

Die durchschnittliche prozentuale Abnahme/Zunahme, die erforderlich wäre, damit das zugrunde liegende Kursniveau unter das Breakeven-Kursniveau sinkt/steigt (Ausübungspreis abzüglich/zuzüglich der vereinnahmten Prämie).

Gewichtete durchschnittliche Tage bis zur Fälligkeit

Die durchschnittliche Anzahl an Tagen bis zur Fälligkeit (gewichtet nach fiktiven Engagements).

Gewichtetes durchschnittliches Delta

Die ungefähre prozentuale Änderung des Fondspreises bei einer entsprechenden einprozentigen Änderung des Preises des zugrunde liegenden Index bzw. der zugrunde liegenden Indizes.

Gewichteter durchschnittlicher Prozentsatz der Moneyness (%)

Der durchschnittliche Ausübungspreis von Optionen als Prozentsatz des aktuellen zugrunde liegenden Index/ETF-Preises.

Gewichtete Duration (Jahre)

Die gewichtete durchschnittliche Menge an Zeit, bis ein Portfolio von Schuldtiteln die Fälligkeit erreicht. Dieser Wert wird auch genutzt, um die prozentuale Preisänderung bei einer Zinsänderung um 100 Basispunkte zu messen.

Gewichtete durchschnittliche Rückzahlungsrendite (%)

Die marktwertgewichtete durchschnittliche Rendite für einzelne Wertpapiere im Portfolio. Die Rückzahlungsrendite eines Wertpapiers ist der Diskontsatz, bei dessen Anwendung der aktuelle Wert zukünftiger Cashflows seinem aktuellen Marktkurs zuzüglich abgegrenzter Zinsen entspricht, wobei davon ausgegangen wird, dass das Wertpapier bis zur Fälligkeit gehalten wird. Bei der Berechnung der Rückzahlungsrendite werden der aktuelle Marktkurs, der Nominalwert, die Kuponrate und die Laufzeit berücksichtigt. Es wird dabei angenommen, dass alle Kupons zum Satz der Rückzahlungsrendite wiederangelegt werden.