First Trust

Festverzinsliche

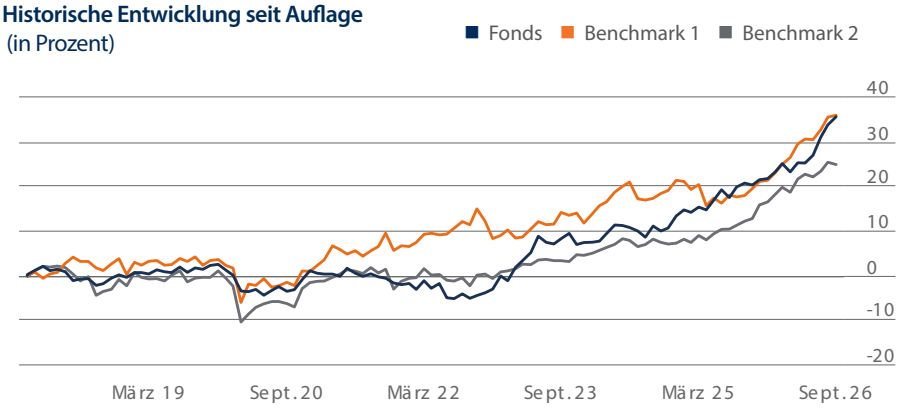
# First Trust FactorFX UCITS ETF

Ziel des Fonds ist Anlegern eine Gesamtrendite zu liefern, die durch die Allokation in globale Renten- und Devisenmärkte mittel- bis langfristig eine niedrige Korrelation zu konventionellen Aktien- und Rentenmärkten bietet. Der aktiv verwaltete Fonds allokiert in Industrie- und Schwellenländer und wendet innerhalb des Investmentprozesses einen regelbasierten Multi-Faktor-Ansatz an (Carry-, Value- und Momentum-Faktoren). Der Fonds investiert in festverzinsliche Staatsanleihen und währungsbezogene Finanzinstrumente.

## Wertentwicklung

**Die in der Vergangenheit erzielte Performance ist kein Hinweis auf zukünftige Ergebnisse**

**Historische Entwicklung seit Auflage**
(in Prozent)




| Historische Performance (in Prozent) | 1 Monat | 3 Monate | YTD | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | seit Auflage |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Fonds | 1,36 | 6,79 | 11,40 | 12,33 | 7,79 | 6,34 | 3,50 |
| Benchmark 1 | 0,31 | 4,19 | 12,01 | 15,26 | 6,00 | 5,00 | 3,49 |
| Benchmark 2 | -0,41 | 2,17 | 7,19 | 11,22 | 6,49 | 4,40 | 2,54 |

Die Performance wird für Perioden von weniger als einem Jahr kumulativ, für Perioden von mehr als einem Jahr annualisiert ausgewiesen.

| 12-Monats-Performance (in Prozent) | 30.09.21 30.09.22 | 30.09.22 30.09.23 | 30.09.23 30.09.24 | 30.09.24 30.09.25 | 30.09.25 30.09.26 |
|---|---|---|---|---|---|
| Fonds | -4,83 | 14,10 | 2,60 | 8,67 | 12,33 |
| Benchmark 1 | 4,58 | 2,49 | 2,76 | 0,54 | 15,26 |
| Benchmark 2 | -2,87 | 5,77 | 4,69 | 3,70 | 11,22 |

| Kennzahlen (3 Jahre) | Volatilität | Alpha | Beta | Korrelation | Downside Capture | Upside Capture |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fonds | 4,49% | 2,03 | 0,61 | 0,42 | -2,67% | 88,20% |
| Benchmark 1 | 4,88% | -0,16 | 0,88 | 0,56 | 118,32% | 99,22% |
| Benchmark 2 | 3,18% | 0,00 | 1,00 | 1,00 | 100,00% | 100,00% |

Die Fondsperformance ist die Performance der Anteilsklasse seit Auflegung, nach Abzug von Gebühren und Wiederanlage der Dividenden, in der Basiswährung der Anteilsklasse. Die Benchmark und der Mischindex lauten nicht auf die Basiswährung der Anteilsklasse. Die Performance kann sowohl steigen als auch sinken und Anleger können einen Teil ihres Kapitals oder das ganze Kapital verlieren. Die Renditen können aufgrund von Währungs- und Wechselkursschwankungen steigen oder sinken. Für weitere Angaben zu den mit einer Anlage im Fonds verbundenen Risiken wird auf den Abschnitt„Risiken“ auf Seite 3 verwiesen. Die Risikozahlen basieren auf monatlichen Daten.

Am 1. Dezember 2017 wurde die Benchmark des Fonds vom JP Morgan G10 FX Carry USD Index in den Bloomberg G10- Carry Index geändert.

Seit dem 22. Dezember 2022 wird zum Performancevergleich eine zweite Benchmark verwendet, die sich zu gleichen Teilen aus dem Bloomberg G10 Carry Index und dem Bloombeg Emerging Carry Index zusammensetzt.

**Diese Marketingmitteilung richtet sich ausschließlich an professionelle Anleger und ist nicht für Privatanleger geeignet. Bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen, lesen Sie bitte den Prospekt, die entsprechende Prospektergänzung und das Basisinformationsblatt.**

| FXGB | Acc GBP |
|---|---|
| ISIN | IE00BD5HBR05 |
| Anlagekategorie | Festverzinsliche |
| Auflagedatum | 27.07.2017 |
| Auflagedatum der Anteilsklasse | 29.11.2017 |
| Gesamtkostenquote (TER) | 0,75% |
| Basiswährung | USD |
| Handelswährung | GBP (Hedged) |
| Ertragsverwendung | Thesaurierend |
| Gesamtfondsvolumen | $6,12 Millionen |
| Anteile im Umlauf | 44.032 |
| OGAW/UCITS IV konform | Ja |
| Fondsdomizil | Irland |
| SFDR-Klassifizierung | Artikel 6 |
| Fondsmanager | First Trust Global Portfolios |
| Verwaltungsmethode | Aktive Verwaltung |

**Benchmark 1**
Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for Managed G10 Currencies (the "Bloomberg G10 Carry Index")

**Benchmark 2**
50% Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for Managed G10 Currencies und 50% Bloomberg Emerging Carry Index for 8 Emerging Market Currencies

Der Fonds verwendet den G10 Carry Index und den Bloomberg Emerging Carry Index lediglich zum Performancevergleich und wird nicht unter Bezugnahme auf die Benchmark verwaltet.

## Handelsinformationen

| Börse | Handelswährung | Ticker | WKN |
|---|---|---|---|
| London Stock Exchange | GBP | FXGB LN | A2AT6T |

**KONTAKTIEREN SIE UNS**

+353 (0)1 913 1339
info@ftgportfolios.com
Maximilianstrasse 35,
Eingang A, Munich
Bayern, 80539, Germany
www.ftglobalportfolios.com

# Zusammensetzung des Fonds

## DIE 10 GRÖSSTEN POSITIONEN (IN PROZENT)[1]

| | |
|---|---|
| U.S. Treasury Note, 4.625%, due 06/15/2027 | 8,15 |
| U.S. Treasury Note, 3.875%, due 10/15/2027 | 7,84 |
| U.S. Treasury Note, 4.50%, due 04/15/2027 | 7,74 |
| U.S. Treasury Note, 4.25%, due 03/15/2027 | 7,65 |
| U.S. Treasury Note, 4.375%, due 07/15/2027 | 7,56 |
| U.S. Treasury Note, 4%, due 01/15/2027 | 7,40 |
| U.S. Treasury Note, 4.125%, due 02/15/2027 | 7,40 |
| U.S. Treasury Note, 2.25%, due 08/15/2027 | 7,26 |
| U.S. Treasury Note, 4.50%, due 05/15/2027 | 7,08 |
| U.S. Treasury Note, 4.625%, due 11/15/2026 | 7,08 |

## FONDSINFORMATIONEN

| | |
|---|---|
| Implizite Rendite[2] | 9,41% |
| Anleihen-Rendite | 4,05% |
| Implizite Währungszinsdifferenz | 5,36% |
| Gew. durchschn. Duration (Jahre) | 0,5 |
| Anzahl Positionen | 41 |
| Durchschn. Long-Positionen | 7,08% |
| Durchschn. Short-Positionen | -12,33% |
| Allokation | 100,00% |
| Netto-Engagement in Fremdwährung | 42,91% |
| Netto-Engagement in USD | 57,09% |

## REPRÄSENTATIVES PORTFOLIOENGAGEMENT (IN PROZENT)

| FX | Devisenforward | Staatsanleihe | Fremdwährungsengagement |
|---|---|---|---|
| KRW | 18,32 | 0,00 | 18,32 |
| SGD | 12,92 | 0,00 | 12,92 |
| ZAR | 11,86 | 0,00 | 11,86 |
| NOK | 11,22 | 0,00 | 11,22 |
| IDR | 9,65 | 0,00 | 9,65 |
| BRL | 8,73 | 0,00 | 8,73 |
| RON | 8,67 | 0,00 | 8,67 |
| AUD | 8,47 | 0,00 | 8,47 |
| GBP | 7,40 | 0,00 | 7,40 |
| JPY | 6,48 | 0,00 | 6,48 |
| COP | 6,33 | 0,00 | 6,33 |
| INR | 6,15 | 0,00 | 6,15 |
| MXN | 5,97 | 0,00 | 5,97 |
| PHP | 4,89 | 0,00 | 4,89 |
| EUR | 4,76 | 0,00 | 4,76 |
| THB | 2,93 | 0,00 | 2,93 |
| PEN | 2,62 | 0,00 | 2,62 |
| OTHER | 4,15 | 0,00 | 4,15 |
| CLP | -0,44 | 0,00 | -0,44 |
| NZD | -0,55 | 0,00 | -0,55 |
| CNH | -2,81 | 0,00 | -2,81 |
| CAD | -3,76 | 0,00 | -3,76 |
| ILS | -6,06 | 0,00 | -6,06 |
| CZK | -8,57 | 0,00 | -8,57 |
| SEK | -29,70 | 0,00 | -29,70 |
| CHF | -46,73 | 0,00 | -46,73 |
| USD | 0,00 | 93,64 | |
| Netto Fremdw. | 42,91 | 0,00 | |
| Netto USD | -42,91 | 100,00 | |
| Netto Total | 100,00 | 0,00 | |

## AUFSCHLÜSSELUNG LAUFZEIT (IN PROZENT)

| | |
|---|---|
| 0-1 Jahr | 100,00 |
| 1-2 Jahre | 0,00 |
| 2-3 Jahre | 0,00 |
| 3-5 Jahre | 0,00 |
| 5-7 Jahre | 0,00 |
| 7-10 Jahre | 0,00 |



## AUFSCHLÜSSELUNG BONITÄT (IN PROZENT)[3]

| | |
|---|---|
| AAA | 93,64 |
| AA | 0,00 |
| A | 0,00 |
| BBB | 0,00 |
| BB | 0,00 |
| Liquide Mittel | 6,36 |



[1]Die 10 größten Positionen werden in Prozent des Gesamtnettovermögens angegeben. Die Portfoliobestände können sich jederzeit verändern. Hinweise auf bestimmte Anleihen sollten nicht als Empfehlung zum Kauf oder Verkauf oder als Aussage über deren Gewinnpotenzial verstanden werden. Gelegentlich können unter den größten Positionen weniger als 10 Positionen aufgeführt sein.

[2]Die implizite Rendite ist die Summe aus der Rendite bis Endfälligkeit des Staatsanleihenportfolios und der impliziten Zinsdifferenz („Carry") der Währungstermingeschäfte. Sie stellt die erwartete Rendite des Produkts dar unter der Annahme, dass sich Zinssätze und Kassakurse nicht ändern und ist vergleichbar mit der Rendite im schlechtesten Fall („Yield to Worst") bei inländischen festverzinslichen Produkten. Die implizite Zinsdifferenz bei Währungstermingeschäften entspricht der annualisierten Differenz zwischen Kassakurs und Terminkurs des Währungspaars. Sie ist die erwartete Rendite des Währungspaars unter der Annahme, dass sich der Kassakurs während der Laufzeit des Termingeschäfts nicht ändert.

[3]Die Kreditratings stammen von ICE Data Services und sind ein einfacher Durchschnitt der Anleiheratings von Moody's, S&P und Fitch. Für einen Index ist dies der Durchschnitt der zusammengesetzten Ratings der Wertpapiere, die Bestandteile des Index sind, gewichtet nach dem vollen Marktwert. Die angegebenen Kreditratings beziehen sich auf die Kreditwürdigkeit der Emittenten der zugrunde liegenden Wertpapiere des Fonds, und nicht auf den Fonds selbst oder dessen Anteile. Die Kreditratings können sich jederzeit ändern. Nur zu Veranschaulichungszwecken.

**Diese Marketingmitteilung richtet sich ausschließlich an professionelle Anleger und ist nicht für Privatanleger geeignet. Bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen, lesen Sie bitte den Prospekt, die entsprechende Prospektergänzung und das Basisinformationsblatt.**

## Indexbeschreibung

1. Der "Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for Managed G10 Currencies" bildet die Gesamtrendite eines "Buy-and-Hold Carry-Trade-Investmentansatzes" ab. Long-Positionen (Kauf; drei G10-Währungen mit der höchsten Verzinsung) werden durch Short-Positionen (Verkauf; G10-Währungen mit der niedrigsten Verzinsung) finanziert. Die Annahme ist, dass FX-Positionen in Geldmarktfinanzinstrumente mit einer Laufzeit von drei Monaten erfolgen, wobei jede der sechs G10- Währungen im Währungskorb die gleiche Gewichtung erhält. Der Währungskorb wird täglich neu gewichtet und besteht aus: US-Dollar, Euro, Japanischer Yen, Britisches Pfund, Kanadischer Dollar, Australischer Dollar, Neuseeland-Dollar, Schweizer Franken, Dänische Krone, Norwegische Krone und Schwedische Krone.
2. Der "Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies" bildet die Gesamtrendite eines "Buy-and-Hold Carry-Trade Investmentansatzes" ab. Long-Positionen (Kauf; acht Schwellenländerwährungen) werden durch Short-Positionen (Verkauf) in den U.S. Dollar finanziert. Der Währungskorb besteht aus: Brasilianischer Real, Mexikanischer Peso, Indische Rupie, Indonesische Rupiah, Südafrikanischer Rand, Türkische Lira, Ungarischer Forint, Polnischer Zloty. Die Annahme ist, dass FX-Positionen in Geldmarktfinanzinstrumente mit einer Laufzeit von drei Monaten erfolgen, wobei jede der acht Schwellenländerwährungen im Währungskorb die gleiche Gewichtung erhält.

## Risiken

- **Es kann sein, dass der Fonds sein Anlageziel nicht erreicht und der Wert seiner Anteile sinkt.**
- Weder First Trust Global Portfolios Management Limited („FTGPM") noch ihre Tochtergesellschaften garantieren die Performance oder die zukünftigen Renditen des Fonds.
- Obschon der Fonds einen erheblichen Teil seines Vermögens in Bareinlagen, Barmitteläquivalente, Einlagenzertifikate und/oder Geldmarktinstrumente investieren kann, um den Handel mit Derivaten, deren Basiswerte vorwiegend Währungen sind, zu erleichtern, sind die Anteile des Teilfonds keine Einlagen und unterscheiden sich naturgemäß dadurch von einer Einlage, dass die Anlage nicht garantiert ist und der Wert der Anlage Schwankungen unterliegen kann. Eine Anlage im Fonds ist mit bestimmten Anlagerisiken verbunden, einschließlich des möglichen Kapitalverlusts.
- Obschon der Fonds einen erheblichen Teil seines Vermögens in Bareinlagen, Barmitteläquivalente, Einlagenzertifikate und/oder Geldmarktinstrumente investieren kann, um den Handel mit Derivaten, deren Basiswerte vorwiegend Währungen sind, zu erleichtern, sind die Anteile des Teilfonds keine Einlagen und unterscheiden sich naturgemäß dadurch von einer Einlage, dass die Anlage nicht garantiert ist und der Wert der Anlage Schwankungen unterliegen kann. Eine Anlage im Fonds ist mit bestimmten Anlagerisiken verbunden, einschließlich des möglichen Kapitalverlusts.
- Bitte beachten Sie die Beschreibung der für den Fonds geltenden Risiken im Abschnitt„Risikofaktoren" des Prospekts.

## Wichtige Informationen

Diese Marketingmitteilung wird von First Trust Global Portfolios Management Limited („FTGPM"), 24 Saint Stephen's Green, Dublin 2, D02 EK82 herausgegeben. FTGPM wurde von der irischen Zentralbank („CBI") zugelassen und untersteht deren Aufsicht (C185737). Der Fonds untersteht ebenfalls der Aufsicht der CBI.

Der Inhalt dieses Dokuments stellt keine Anlage-, Rechts-, Steuerberatung oder Beratung sonstiger Art dar und sollte nicht als einzige Grundlage für eine Anlage- oder andere Entscheidung verwendet werden. Ferner enthält dieses Dokument keine impliziten oder expliziten Empfehlungen einer Anlagestrategie, keine Schlussfolgerungen in Bezug auf eine Anlagestrategie für den Leser und auch keine Stellungnahme zum gegenwärtigen oder zukünftigen Wert oder Preis eines Fonds. Das Dokument ist weder eine Einladung, ein Angebot oder eine Aufforderung zur Anlage in diesen Fonds, noch stellen die darin enthaltenen Informationen, Empfehlungen oder Stellungnahmen ein Verkaufsangebot für den Fonds dar.

Der Fonds ist ein offener Teilfonds des First Trust Global Funds ICAV (das „ICAV"), eines offenen irischen Vehikels für die gemeinsame Vermögensverwaltung, das als Umbrella-Fonds mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen den Teilfonds nach irischem Recht gegründet wurde und als OGAW mit der Nummer C99076 registriert ist.

Diese Marketingmitteilung ist inhaltlich nicht erschöpfend und muss deswegen in Verbindung mit dem Fondsprospekt, der entsprechenden Prospektergänzung und dem Basisinformationsblatt („BiB") gelesen werden. Diese enthalten wesentliche Informationen, die dem vorliegenden Dokument nicht zu entnehmen sind, darunter die Anlagebedingungen und Informationen über Anlagerisiken und -beschränkungen, Gebühren und Kosten und Interessenkonflikte. Potentielle Anleger sollten den Risikohinweisen im Abschnitt „Risikofaktoren" des Fondsprospekts (auf Englisch verfügbar) und in den BiB (verfügbar für alle Anteilsklassen aller Teilfonds der Gesellschaft, in einer der offiziellen Sprachen der EU-Mitgliedstaaten, in denen der entsprechende Teilfonds gemäß Richtlinie 2009/65/EC (OGAW-Richtlinie) angeboten werden darf, besondere Aufmerksamkeit schenken. Es kann nicht zugesichert werden, dass die Anlageziele des Fonds erreicht werden oder dass der Fonds eine positive Rendite erwirtschaftet. Wenden Sie sich an FTGPM oder besuchen Sie die Website www. ftglobalportfolios.com, wenn Sie einen Prospekt, die entsprechende Prospektergänzung und/oder ein BiB erhalten möchten. Anleger und potentielle Anleger finden unter folgendem Link eine Zusammenfassung auf Englisch zu den Anlegerrechten mit Informationen zum Zugang zu kollektiven Rechtsdurchsetzungsverfahren im Falle eines Rechtsstreits: https://www.ftglobalportfolios.com/Content/SUMMARY_OF_INVESTOR_RIGHTS.

Der Fonds ist aktuell in mehreren EU-Mitgliedstaaten gemäss OGAW-Richtlinie zum Vertrieb gemeldet. Das ICAV kann jedoch jederzeit beschliessen, die Vereinbarungen zur Vermarktung jeglicher Anteilsklassen des Fonds gemäß dem in der OGAW-Richtlinie aufgeführten Verfahren zurückzuziehen.

ETFs die auf dem Sekundärmarkt gekauft werden, können in der Regel nicht direkt an die UCITS ETFs zurückverkauft werden. Anleger müssen Anteile auf einem Sekundärmarkt über einen Intermediär (z. B. einen Börsenmakler) kaufen und verkaufen – hierfür können Gebühren anfallen. Außerdem ist es möglich, dass Anleger beim Kauf von Anteilen mehr als den aktuellen Nettoinventarwert bezahlen und beim Verkauf von Anteilen weniger als den aktuellen Nettoinventarwert erhalten.

Die Politik des ICAV in Bezug auf die Portfoliobestände ist auf Transparenz ausgelegt und ist zugleich im besten Interesse des Fonds und schützt die Vertraulichkeit der Portfoliobestände jedes Fonds. Der gesamte Portfoliobestand des Fonds wird in der Regel täglich mit einer Verzögerung von einem Tag auf www.ftglobalportfolios.com veröffentlicht. Informationen zu einzelnen Portfoliobeständen, die gegebenenfalls auf Anfrage mitgeteilt werden, sind vertraulich zu behandeln.

**Für Anleger in Österreich**

Der Fonds ist in Österreich zum öffentlichen Vertrieb zugelassen. Der Verkaufsprospekt und die Prospektergänzung, das Basisinformationsblatt ("BIB") und die anderen gesetzlich vorgeschriebenen Fondsdokumente sowie die Jahres- und Halbjahresberichte wurden in Österreich publiziert und sind kostenlos bei der österreichischen Zahl- und Informationsstelle, Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Graben 21, A-1010 Wien, erhältlich.

**Für Anleger in Deutschland**

Dieses Dokument richtet sich ausschließlich an „professionelle" Anleger im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente („MiFID-Richtlinie"), Anbieter von Wertpapierdienstleistungen und andere Fachleute der Finanzbranche. Die Gesellschaft hat den Vertrieb der OGAW ETFs bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) gemäß § 310 Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) angezeigt. Potenzielle Anleger können das Basisinformationsblatt in deutscher Sprache und den aktuellen Prospekt, die Prospektergänzung, die Satzung sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht in englischer Sprache mit einer E-Mail an fa_gfr@fefundinfo.com kostenlos bei FE Fundinfo beziehen.

**Für Anleger in Schweiz**

Die Anteile sind in der Schweiz ausschliesslich zum Vertrieb an qualifizierte Anlegerinnen und Anleger („qualifizierte Anlegerinnen und Anleger") im Sinne des Schweizer Kollektivanlagengesetzes vom 23. Juni 2006 in seiner jeweils gültigen Fassung und der zugehörigen Verordnung bestimmt und werden nur solchen Anlegerinnen und Anlegern angeboten. Entsprechend ist der Fonds nicht genehmigungspflichtig und es wurde und wird auch in Zukunft keine Vertriebsgenehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) eingeholt. Dieses Dokument sowie alle sonstigen den Fonds betreffenden Vertriebsunterlagen dürfen in der Schweiz nur an qualifizierte Anleger abgegeben werden. Der Fonds hat die nachfolgend aufgeführte Gesellschaft zu seinem Vertreter in der Schweiz bestellt: Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Schweiz, Tel: +41 21 311 17 77, E-Mail: switzerland@waystone.com. Als Schweizer Zahlstelle des Fonds fungiert die Genfer Kantonalbank (BCGe). Die Fondsunterlagen können beim Schweizer Vertreter in Lausanne kostenlos bezogen werden. Die Angaben in diesem Dokument dienen ausschliesslich Informationszwecken. Die in der Vergangenheit erzielte Performance liefert keinen Hinweis auf die gegenwärtige oder zukünftige Wertentwicklung.