

Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc

Ticker: AAA35 IM

1. FONDSINFORMATIONEN

Beschreibung

Anlageziel

Der Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc ist ein OGAW-konformer börsenhandelter Fonds mit dem Ziel, den Referenzindex MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR) so genau wie möglich abzubilden.
Der MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR) bietet ein ungehebeltes Exposure auf den AAA und AA Staatsanleihen Markt der Eurozone. Der Index wird in Euro gehandelt und umfasst Anleihen der Eurozone mit den höchsten Ratings (mit "AAA" und "AA" bewertet), während die Ländergewichtung basierend auf makroökonomischen Indikatoren berechnet wird.

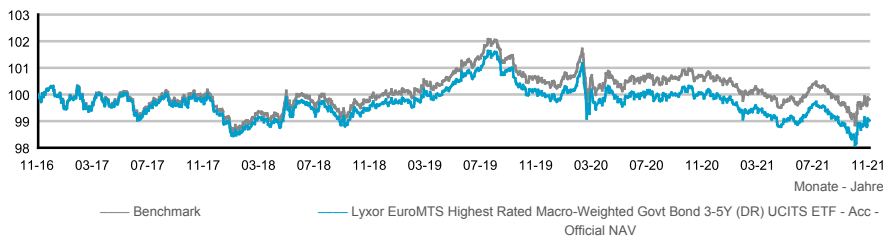
Risikoprofil

Potenzielle Anleger müssen die folgenden, im Prospekt des Fonds, der unter www.lyxoretf.de abrufbar ist, beschriebenen Risiken berücksichtigen.
KAPITALRISIKO: ETF sind nachbildende Instrumente: Ihr Risikoprofil ähnelt dem einer direkten Anlage in dem zugrunde liegenden Index. Das Kapital der Anleger ist vollständig dem Risiko ausgesetzt und Anleger erhalten unter Umständen den ursprünglich investierten Betrag nicht zurück.
REPLIKATIONSRISSIKO: Die Anlageziele des Fonds werden aufgrund unerwarteter Ereignisse an den zugrunde liegenden Märkten, die die Indexberechnung und die effiziente Fondsnachbildung behindern, unter Umständen nicht erreicht.
RISIKO IN VERBINDUNG MIT DEM BASISWERT: Der zugrunde liegende Index eines Lyxor-ETF kann komplex und volatil sein. Bei Anlagen in Rohstoffen wird der zugrunde liegende Index mit Bezug zu Rohstoff-Futures-Kontrakten berechnet, die den Anleger einem Liquiditätsrisiko in Verbindung mit den Kosten, wie zum Beispiel Fracht- und Transportkosten, aussetzen können. ETFs mit einem Engagement an Schwellenmärkten sind mit einem größeren Risiko möglicher Verluste verbunden als eine Anlage in Industrieländern, da sie vielfältigen und unvorhersehbaren Schwellenländerisiken ausgesetzt sind.
WÄHRUNGSRISSIKO: ETFs können einem Währungsrisiko unterliegen, wenn der ETF auf eine andere Währung als die Währung des nachgebildeten zugrunde liegenden Index lautet. Das bedeutet, dass die Wechselkursschwankungen die Renditen negativ oder positiv beeinflussen können.
LIQUIDITÄTSRISSIKO: Die Liquidität wird durch zugelassene Market-Maker an der jeweiligen Börse, an der der ETF notiert ist, einschließlich der Société Générale, zur Verfügung gestellt. Die Liquidität an der jeweiligen Börse kann infolge einer Unterbrechung am Markt, der durch den vom ETF nachgebildeten zugrunde liegenden Index repräsentiert wird, eines Ausfalls der Systeme einer der relevanten Börsen, der Société Générale oder anderer Market-Maker-Systeme oder einer unnormalen Handlungssituation bzw. eines unnormalen Handelsereignisses beschränkt sein.

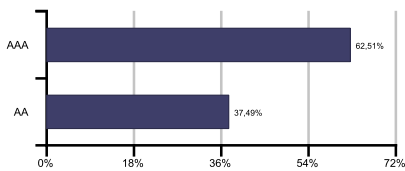
2. Indexinformationen

Performance auf Basis 100

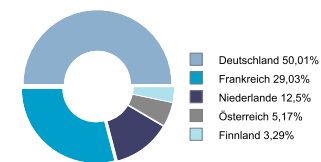
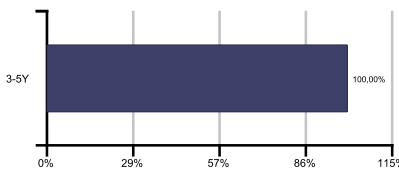
Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 30 November 2021



Ratinggliederung



Fristgliederung



3. ETF-Wertentwicklung

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	3 Jahre	5 Jahre
Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc	0,96%	-0,25%	0,02%	-0,55%	-0,97%
Benchmark	0,98%	-0,22%	0,08%	-0,08%	-0,18%
Wertentwicklungsunterschied	-0,01%	-0,03%	-0,07%	-0,48%	-0,79%

	YTD	2020	2019	2018	2017
Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc	-1,01%	0,27%	0,12%	0,38%	-1,00%
Benchmark	-0,88%	0,44%	0,29%	0,54%	-0,85%
Wertentwicklungsunterschied	-0,12%	-0,17%	-0,17%	-0,17%	-0,15%
Tracking Error	-	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

	30/11/2021	30/11/2020	29/11/2019	30/11/2018	30/11/2017
Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc	-0,97%	-0,14%	0,55%	-0,09%	-0,34%
Benchmark	-0,83%	0,04%	0,72%	0,08%	-0,18%
Wertentwicklungsunterschied	-0,14%	-0,17%	-0,17%	-0,17%	-0,15%

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 30 November 2021

Die Daten (zu früheren Wertentwicklungen/SIMULIERTEN FRÜHEREN WERTENTWICKLUNGEN/FRÜHEREN UND SIMULIERTEN FRÜHEREN WERTENTWICKLUNGEN) BEZIEHEN SICH AUF DIE VERGANGENHEIT UND SIND KEIN VERLÄSSLICHER INDIKATOR FÜR ZUKÜNFTIGE RENDITEN. DASSELBE GILT FÜR DIE HISTORISCHEN MARKTENTWICKLUNGEN.

Ticker	AAA35 IM
Rechtsform	SICAV
UCITS-Konform	Ja
ISIN	LU1829219713
Osterreich Steuer	Ja
Replikationsmethode	Direkt (physisch)
Sampling	Nein
Wertpapierleihe	Nein
Währung der Anteilsklasse	EUR
Aufgagedatum	25/11/2011
Nettoinventarwert pro Anteil zum Zeitpunkt der Auflage (EUR)	111,9829
Gesamtkostenquote (TER)	0,165%
Fremdwährungsrisiko	Nein
Nettoinventarwert pro Anteil (EUR)	111,80
AuM der Anteilsklasse (Mio EUR)	133,06
Gesamtfondsvermögen (Mio EUR)	133,06
Umbrella-Fonds (Mio EUR)	56.324,37
Mindestanlagebetrag (Anteil)	1
Ertragsverwendung	Thesaurierend

Handelsinformationen

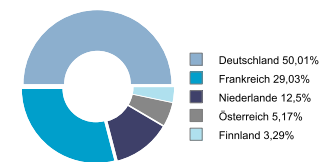
Handelsplatz	Öffnungszeiten (GMT)	Währung	Bloomberg Ticker	Reuters RIC
Borsa Italiana (Milano)*	08:00 / 16:30	EUR	AAA35 IM	AAA35.MI
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	EUR	LYMA35 SW	LYMA35.S
Deutsche Boerse (Xetra)	08:00 / 19:00	EUR	LYS5 GY	LYS5.DE
NYSE Euronext Paris	08:00 / 16:30	EUR	MA35 FP	MA35.PA
BERNE STOCK EXCHANGE	08:00 / 16:30	EUR	LYMA35 BW	LYMA35.BN

* Handelsplatz der Erstzulassung dieser Anteilsklasse

Name	MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR)
Klassifizierung	Eurozone
Anlageklasse	Festverzinst
Indexart	Bruttogesamtrendite
Währung	EUR
Index Reuters RIC	-
Index Bloomberg Ticker	FMMPHRB5
Weitere Informationen	-
Coupon	0,69
Rendite	-0,63
Duration (Jahre)	4,01
Modifizierte Duration	4,04
Fristigkeit (Jahre)	4,06
Konvexität	20,76

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 30 November 2021

Index Geographische Zuordnung



Die Performance ausschüttender ETF wird mit Wiederanlage der Dividenden in die ETF-Performance berechnet.
Performance-Gap steht für die Performanceunterschiede zwischen dem ETF und dem Index.
Der Tracking-Error stellt die annualisierte Volatilität der Performanceunterschiede zwischen dem ETF und der Benchmark dar.
Die Benchmark kann Veränderungen unterliegen. Zum Vergleich der Entwicklung des ETF mit der Entwicklung seiner Benchmark verwenden wir nachstehende Indizes:

	Vom	bis zum
EuroMTS AAA Eurozone MacroWeighted Index 3-5yr 1730	25/11/2011	13/11/2014
MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR)	13/11/2014	

Performanceabweichung = Simul. Perf. - [(1+Perf. Index)/(1+Wechselkursperf.) - 1]

** Bis zum 08/11/2018 entspricht die historische Performance des Fonds Lyxor EUROMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF jener des Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF. Dieser Fonds wurde am 08/11/2018 durch den Lyxor EUROMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF aufgenommen.

	Seit Auflegung		
	1Y	3Y	5Y
Sharpe Ratio	0,83		
Volatilität des Fonds	1,30%	1,43%	1,40%
Benchmark-Volatilität	1,30%	1,43%	1,40%
Sharpe Ratio	-0,32	0,20	0,17

WICHTIGE INFORMATIONEN FÜR INVESTOREN

Parteien, die an Transaktionen (z. B. Derivat- oder Finanzierungstransaktionen) beteiligt sind oder in Finanzinstrumenten anlegen, die einen Index oder einen variablen Zinssatz (Benchmark) verwenden, sind folgenden Risiken ausgesetzt:

(1) Die Benchmark kann methodischen und anderen Änderungen unterliegen, die den Wert der betroffenen Transaktion beeinflussen können; oder

(2) (i) entspricht eventuell nicht mehr den geltenden Gesetzen und Vorschriften (z. B. EU Referenzwerte-Verordnung), (ii) wird eventuell nicht mehr veröffentlicht (nach Dezember 2021 wird der LIBOR möglicherweise nicht mehr veröffentlicht und die Einstellung von EONIA ist geplant), oder (iii) es kann durch die für die Benchmark zuständige Aufsichtsbehörde oder den Verwalter beschlossen werden, dass der betroffene Referenzwert nicht länger repräsentativ ist, so dass die entsprechende Benchmark durch eine andere Benchmark ersetzt werden kann, was eine starke Beeinträchtigung des wirtschaftlichen Aspekts der betroffenen Transaktionen zur Folge haben könnte.

Wir empfehlen Ihnen, eine eigene, unabhängige Untersuchung und Analyse der potenziellen Folgen aller relevanten Risiken wie den oben erwähnten vorzunehmen, besonders angesichts der laufenden Brancheninitiativen im Zusammenhang mit der Entwicklung alternativer Referenz-Zinssätze und der Aktualisierung der relevanten Marktstandard-Dokumentation.

HINWEIS

** Die Gesamtkostenquote (TER) deckt alle Kosten ab, die der Managementgesellschaft beim Management der zugrunde liegenden Vermögenswerte entstehen. Sie enthält Managementgebühren und strukturelle Kosten wie nachstehend beschrieben. Mit den Managementgebühren werden die Dienstleistungen der Verwaltungsgesellschaft vergütet. Die strukturellen Kosten bestehen aus den Depotbankgebühren, den Verwaltungsgebühren, den Prüfgebühren und allen anderen operativen Kosten, die von der Verwaltungsgesellschaft beim Betrieb der Fonds gezahlt werden.

Hinweis: Dieses Factsheet ist ausschließlich zur Verbreitung an Empfänger bestimmt, bei denen es sich um erfahrene Anleger handelt, die die erforderlichen Erfahrungen und Kenntnisse im Hinblick auf die hierin beschriebenen Anlagen besitzen und die damit verbundenen Chancen und Risiken verstehen; Societe Generale und Lyxor International Asset Management S.A.S. übernehmen keine, wie auch immer geartete Haftung dafür, dass die Empfänger diese Voraussetzungen auch tatsächlich erfüllen. Deshalb stehen die hierin beschriebenen Anlagen ausschließlich dieser Personengruppe zur Verfügung. Dieses Factsheet ist nicht zur Verbreitung an Staatsbürger der USA oder Kanada oder in diesen Ländern ansässige Personen bestimmt. Es darf daher weder in seiner Gesamtheit noch in Auszügen im Original oder in Kopie in die USA oder nach Kanada übermittelt noch dort verteilt werden. Dieses Dokument wurde von LyxorAM erstellt und stellt eine unverbindliche Werbefinformation dar. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen sowie die benutzten Zahlen und Beispiele haben einen rein indikativen und informativen Charakter. Diese Zahlen sind keine Zukunftsvorhersagen und stellen in keiner Weise eine Verpflichtung oder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots, seitens der SG und/oder LyxorAM zum Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen dar. Demnach stellt dieses Factsheet weder eine Anlageberatung im Sinne des WAG noch eine verbindliche Auskunft dar. Darüber hinaus ist dieses Factsheet auch keine persönliche Aufforderung an den Empfänger, eine Anlageentscheidung zu treffen. Angaben zu früheren Wertentwicklungen, Simulationen oder Prognosen und/oder Angaben mit Bezug auf die vergangene Wertentwicklung lassen keinerlei Rückschlüsse auf die zukünftige Wertentwicklung zu. SG und LyxorAM übernehmen keinerlei treuhänderische Verantwortung oder wie auch immer geartete Haftung für finanzielle oder anderweitige Konsequenzen, die sich durch die Zeichnung oder den Erwerb eines in diesem Dokument beschriebenen Anlageinstrumentes ergeben. Weiterhin übernehmen SG und LyxorAM keine wie immer geartete Verantwortung für die Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der in diesem Dokument enthaltenen Informationen. Schließlich übernehmen SG und LyxorAM keinerlei Verpflichtung die in diesem Dokument enthaltenen Informationen zu aktualisieren. Für die Korrektheit, Vollständigkeit oder Relevanz der hierin bereitgestellten Informationen kann von SG und LyxorAM keine, wie auch immer geartete Haftung übernommen werden, obwohl diese aus vertrauenswürdigen Quellen stammen und sorgfältig recherchiert und geprüft wurden. Anleger sollten sich vor Zeichnung oder Erwerb der in diesem Dokument beschriebenen Fondsanteile einen eigenen Eindruck über die Risiken bilden und für zusätzliche Auskünfte ein Bezug auf eine Zeichnung oder einen Erwerb einen professionellen Berater konsultieren. Vor allem sollten sich Anleger bei Zeichnung und Kauf von Fondsanteilen bewusst sein, dass dieses Produkt Risiken beinhaltet und eine Rückzahlung auch unter dem Wert des eingesetzten Kapitals liegen kann. Der Wert oder der Kurs einer Anlage kann Schwankungen unterliegen. Im schlimmsten Fall kann es zu einem Totalverlust des eingesetzten Kapitals kommen. SG agiert als Market Maker für die genannten Fondsanteile oder handelt mit Finanzinstrumenten, die mit Fondsanteilen oder Derivaten wirtschaftlich verbunden sind. Handels- und/oder Hedgingaktivitäten der SG können Auswirkungen auf die Preisbildung in Bezug auf Transaktionen in den Fondsanteilen haben. Dieses Produkt ist den Marktrisiken des zugrundeliegenden Index unterworfen. Der Fonds bildet die Performance des Index abzüglich der Verwaltungsgebühren nach. Es besteht das Risiko, dass das Anlageziel des Fonds nicht erreicht wird und der Fonds den zugrundeliegenden Index nicht exakt abbilden kann. Da der Fonds Finanzinstrumente einsetzt, die mit einem Kreditinstitut abgeschlossen werden, besteht ein Kontrahentenrisiko. Sofern der zugrunde liegende Index in ausländischer Währung berechnet wird, besteht ein Wechselkursrisiko. Sofern der zugrunde liegende Index ein Leverage-Index ist, sind die Risiken aus dem Leverage-Effekt zu beachten. Die Angaben in diesem Dokument sind unverbindlich, einzig die Angaben im Verkaufsprospekt - der auch eine Darstellung, der mit der Zeichnung oder dem Erwerb verbundenen Risiken enthält - sind verbindlich. Der Prospekt sowie die Kundeninformationsdokumente des zum öffentlichen Vertrieb in Österreich zugelassenen und in diesem Dokument genannten Fonds sowie die Informationen im Sinne des § 142 InvFG 2011 können online unter www.lyxoretf.at heruntergeladen oder kostenlos in englischer Sprache bei der Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Am Belvedere 1, A-1100 Wien, Telefon 0043 (0) 50100 12139 bezogen werden. Es wird jedem Anleger vor Zeichnung oder Erwerb dringend empfohlen, den allein rechtsverbindlichen Verkaufsprospekt zu lesen. Der jeweilige Index und seine Marken sind geistiges Eigentum des jeweiligen Index-Sponsors und sind für bestimmte Verwendungen an die SG bzw. LyxorAM lizenziert worden. Die Fondsanteile werden vom jeweiligen Index-Sponsor weder gesponsert, gefördert, beworben, verkauft noch auf eine andere Art und Weise unterstützt. Der Index-Sponsor übernimmt keine wie immer geartete Verantwortung für die Ergebnisse, die aus der Nutzung bzw. dem Gebrauch des Index erlangt werden, für ein bestimmtes Index-Niveau an einem bestimmten Tag oder für sonstige Tatsachen und Faktoren im Zusammenhang mit dem Index. Der jeweilige Index wird allein durch den Index-Sponsor zusammengestellt und berechnet. Der Index-Sponsor übernimmt ferner keine wie immer geartete Verantwortung für irgendwelche Fehler bei der Zusammenstellung oder Berechnung des Index und der Index-Sponsor unterliegt darüber hinaus auch keiner Verpflichtung irgendeine Person einschließlich des Käufers bzw. des Verkäufers der Fondsanteile auf einen diesbezüglichen Fehler hinzuweisen. Darüber hinaus gibt der Index-Sponsor keine Versicherung hinsichtlich einer Änderung oder eines Wechsels in der Methodologie bei der Berechnung des Index ab. Der Index-Sponsor unterliegt auch keiner Verpflichtung, den Index fortlaufend weiterzuberechnen, ihn zu veröffentlichen und wiederzugeben."