Lyxor EuroMTS Covered Bond Aggregate UCITS ETF

Ticker: LYXECB GY

1. FONDSINFORMATIONEN

Anlageziel

Der Lyxor EuroMTS Covered Bond Aggregate UCITS ETF ist ein OGAW-konformer börsengehandelter Fonds mit dem Ziel, den Referenzindex MTS Mid Price Covered Bond Agg All Maturity (EUR) so genau wie möglich abzubilden.
Der MTS Mid Price Covered Bond Agg All Maturity (EUR) misst die Performance der in Euro gehandelten Covered Bonds von nicht-staatlichen EU Herausgebern, die auf den MTS Handelsplattformen gelistet sind und mehr als ein Jahr bis zur Fälligkeit haben.
ETFs von Lyxor Asset Management sind effiziente, börsennotierte Anlageinstrumente, die Anlegern einen transparenten, liquiden und kostengünstigen Zugang zum Exposure des zugrundeliegenden Referenzindex bieten.

Handelsinformationen

Handelsplatz	Öffnungs-zeiten (GMT)	Währung	Bloomberg Ticker	Reuters RIC	Aus-schüttend
Deutsche Boerse (Xetra)	08:00 / 19:00	EUR	LYXECB GY	LYXECB.DE	Ja
NYSE Euronext Paris*	08:00 / 16:30	EUR	ECB FP	ECB.PA	Ja

* Handelsplatz der Erstzulassung dieser Anteilsklasse

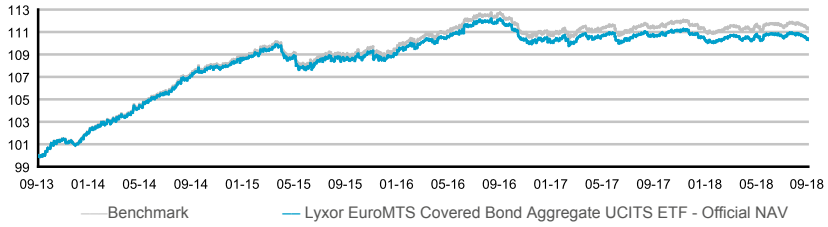
Hauptmerkmale des Fonds

Ticker	LYXECB GY
Rechtsform	FCP
Domizilierung	Frankreich
UCITS-Konform	Ja
ISIN	FR0010481127
Replikationsmethode	Indirekt (Swap-basiert)
Wertpapierleihe	Nein
Voller Besitz der Vermögenswerte	Ja
Währung der Anteilsklasse	EUR
Auflagedatum	19/06/2007
Nettoinventarwert pro Anteil zum Zeitpunkt der Auflage (EUR)	100
Gesamtkostenquote (TER)	0,165%
Fremdwährungsrisiko	Nein
Nettoinventarwert pro Anteil (EUR)	138,09
AuM der Anteilsklasse (M EUR)	124,84
Gesamtfondsvermögen (M EUR)	124,84
Mindestanlagebetrag	1
Ertragsverwendung	Ausschüttend
Ausschüttungsdatum	Dezember
Letzte Ausschüttung (EUR)	1,49

Quelle: Lyxor AM, 28 September 2018

2. Indexinformationen

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 28 September 2018

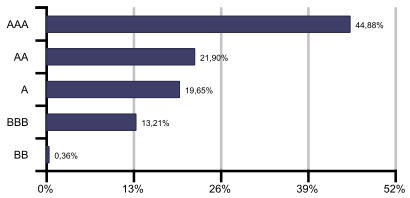


Name	MTS Mid Price Covered Bond Agg All Maturity (EUR)
Klassifizierung	Eurozone
Anlageklasse	Festverzinst
Indexart	Bruttogesamtrendite
Währung	EUR
Index Reuters RIC	-
Index Bloomberg Ticker	FMMPCOG5
Weitere Informationen	-
Coupon	2,08
Rendite	0,47
Duration (Jahre)	4,03
Modifizierte Duration	4,01
Fristigkeit (Jahre)	4,23
Konvexität	26,30

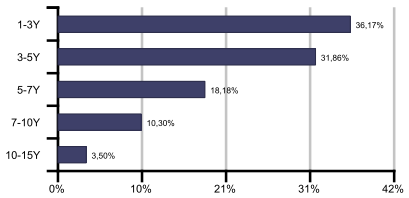
Top 10 Komponenten

Cff 2 3/8 11/21/22	2,09%	Bpcecb 1 1/2 01/30/20	1,42%
Crh 3.3 09/23/22	1,86%	Abnanv 1 1/2 09/30/30	1,41%
Cff 3 1/2 11/05/20	1,51%	Cff 4 10/24/25	1,38%
Dnbno 0 1/4 04/18/23	1,47%	Acacb 4 01/17/22	1,25%
Crh 3.9 01/18/21	1,47%	Caffil 5 3/8 07/08/24	1,22%
Anzahl der Indexkomponenten	216		

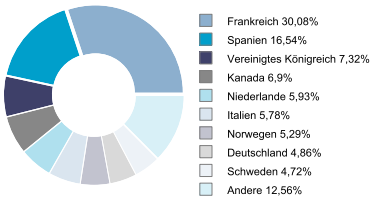
Ratinggliederung



Fristgliederung



Index Geographische Zuordnung



3. ETF-Wertentwicklung

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	3 Jahre	5 Jahre
Lyxor EuroMTS Covered Bond Aggregate UCITS ETF	**-0,40%**	**-0,35%**	**-0,25%**	**1,72%**	**10,42%**
Benchmark	-0,38%	-0,30%	-0,15%	2,27%	11,38%
Wertentwicklungsunterschied	-0,01%	-0,05%	-0,09%	-0,55%	-0,96%

	YTD	2017	2016	2015	2014
Lyxor EuroMTS Covered Bond Aggregate UCITS ETF	**-0,33%**	**0,39%**	**1,69%**	**0,36%**	**7,06%**
Benchmark	-0,19%	0,57%	1,87%	0,53%	7,23%
Wertentwicklungsunterschied	-0,14%	-0,19%	-0,18%	-0,17%	-0,17%
Tracking Error	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

Quelle: Bloomberg, Lyxor AM, bis zum 28 September 2018

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.

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 Covered Bonds	20/06/2007	06/06/2011
FTSE MTS Covered Bond (Mid Price) Index	06/06/2011	14/11/2014
MTS Mid Price Covered Bond Agg All Maturity (EUR)	14/11/2014	

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.
REPLIKATIONSRISIKO: 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.
KONTRAHENTENRISIKO: Die Anleger sind Risiken infolge der Verwendung eines OTC-Swap mit der Société Générale ausgesetzt. Gemäß den OGAW-Richtlinien darf das mit der Société Générale eingegangene Risiko 10% des Gesamtvermögens des Fonds nicht übersteigen.
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 Schwellenländerrisiken ausgesetzt sind.
WÄHRUNGSRISIKO: 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.
LIQUIDITÄTSRISIKO: 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 an dem Markt, der durch den von dem 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 Handelssituation bzw. eines unnormalen Handelsereignisses beschränkt sein.

Hinweis

Rechtliche Hinweise: Bei den Inhalten dieses Factsheets handelt es sich um eine reine Werbemitteilung. 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; Lyxor Asset Management ("LyxorAM") und Société Générale S.A. ("SG") übernehmen keine 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 Werbeinformation dar. SG und LyxorAM sprechen dabei keine direkte oder indirekte Empfehlung für die in diesem Dokument genannten Finanzinstrumente aus. Daher kommen die Vorschriften zur Analyse von Finanzinstrumenten nach § 34b WpHG nicht zur Anwendung. 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 Lyxor AM zum Kauf oder Verkauf der hier aufgeführten Fondsanteile dar. Dieses Factsheet stellt weder eine Anlageberatung im Sinne des WpHG noch eine verbindliche Auskunft dar, sondern gibt lediglich eine zusammenfassende Kurzdarstellung wesentlicher Merkmale des Fonds wieder. 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 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 Fondsanteils ergeben. Weiterhin übernehmen SG und LyxorAM keine 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 Richtigkeit, Vollständigkeit und Angemessenheit der hierin bereitgestellten Informationen übernehmen Lyxor AM und SG keine Haftung, auch wenn 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 in 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 der Fondsanteile kann Schwankungen unterliegen. Im schlimmsten Fall kann es zu einem Totalverlust des eingesetzten Kapitals kommen. Es ist ferner zu beachten, dass der in diesem Factsheet dargestellte Fonds aufgrund seiner Zusammensetzung/der von dem Fondsmanagement verwendeten Techniken eine erhöhte Volatilität aufweist. Sein Anteilpreis kann daher auch innerhalb kurzer Zeiträume stärkeren Schwankungen nach unten oder nach oben unterworfen sein. 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 der hierin beschriebenen Fondsanteile verbundenen Risiken enthält - sind verbindlich. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie die Jahres- und Halbjahresberichte des Fonds können online unter www.lyxoretf.de heruntergeladen oder kostenlos elektronisch oder in gedruckter Form bei der Société Générale S.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main, Neue Mainzer Straße 46-50, 60311 Frankfurt am Main bezogen werden. Die vorgenannten Dokumente sind in englischer Sprache erhältlich, mit Ausnahme der wesentlichen Anlegerinformationen, die in deutscher Sprache erhältlich sind. Es wird jedem Anleger vor Zeichnung oder Erwerb dringend empfohlen, den allein rechtsverbindlichen Verkaufsprospekt zu lesen.

Der von dem Fonds nachgebildete 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, ebenso wenig 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 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.