

# Lyxor ETF EuroMTS AAA Government Bond

Factsheet Januar 2011

## Exchange Traded Fund

### Lyxor ETF EuroMTS AAA Government Bond

Der Lyxor ETF EuroMTS AAA Government Bond ist ein OGAW I & III (UCITS I & III) konformer Investmentfonds, der den Anleihenindex EuroMTS AAA Government All Maturity nahezu eins zu eins abbildet. Der EuroMTS AAA Government All Maturity Index beinhaltet Staatsanleihen der Mitgliedstaaten der Eurozone, die ausnahmslos ein AAA Rating aufweisen.

## Exchange Traded Funds (ETFs)

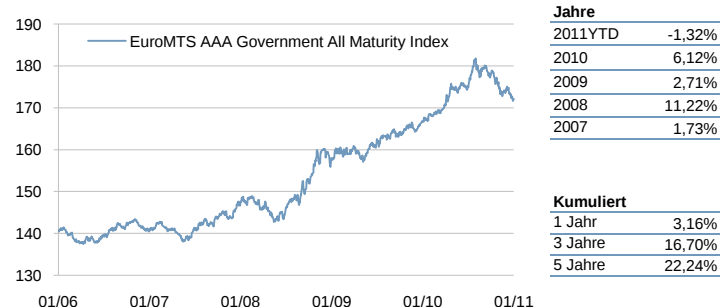
Exchange Traded Funds sind passiv gemanagte Investmentfonds, die Aktien-, Renten-, Rohstoffindizes oder den Geldmarkt nachbilden. An der Börse können sie wie eine Aktie fortlaufend gehandelt werden. Zahlreiche Market Maker verpflichten sich, während der Börsenzeiten Geld- und Brief Kurse zu stellen und gewährleisten somit eine hohe Liquidität. Mit ETFs lassen sich markt- oder themenbezogene Anlagestrategien umsetzen.

### Lyxor Asset Management

1998 als 100-prozentige Tochter der Société Générale gegründet, ist Lyxor AM dem Corporate & Investment Banking Bereich der Société Générale zugeordnet. Die drei Geschäftsfelder von Lyxor AM sind Index Tracking (ETFs), Strukturierte Fonds und Strukturierte Alternative Investments. Lyxor AM bietet global über 200 ETFs an. Mit einem Marktanteil von ca. 20% per Januar 2011 ist Lyxor AM einer der Marktführer auf dem europäischen ETF-Markt. Das Produktangebot deckt dabei die wichtigsten internationalen Aktien-, Renten-, Rohstoffindizes und den Geldmarkt ab.

## Indexüberblick

### Wertentwicklung



Diese Graphik zeigt die vergangene Wertentwicklung des zugrunde liegenden Indexes und nicht die des Lyxor ETFs. Der Lyxor ETF bildet die Performance des Indexes abzüglich der Verwaltungsgebühren nach. Grundsätzlich gilt, dass vergangene Performance keine Garantie für künftige Wertentwicklungen darstellt.

## Zusammensetzung

### Top Indexwerte

|              |       |
|--------------|-------|
| FR0010192997 | 1,49% |
| FR0000189151 | 1,48% |
| FR0010216481 | 1,46% |
| DE0001135200 | 1,40% |
| FR0000187361 | 1,36% |
| FR0010854182 | 1,35% |
| DE0001135259 | 1,32% |
| FR0010415331 | 1,31% |
| DE0001135242 | 1,29% |
| DE0001135218 | 1,27% |
| DE0001135374 | 1,26% |
| FR0010288357 | 1,26% |
| FR0000187635 | 1,24% |
| FR0000571218 | 1,23% |
| DE0001135267 | 1,22% |
| DE0001135267 | 1,22% |
| DE0001135309 | 1,21% |
| DE0001135382 | 1,21% |
| FR0010466938 | 1,21% |
| DE0001135291 | 1,20% |

### Ländergewichtung

|             |        |
|-------------|--------|
| Frankreich  | 40,91% |
| Deutschland | 38,44% |
| Niederlande | 10,35% |
| Österreich  | 7,72%  |
| Finnland    | 2,58%  |

### Kennzahlen

|                 |       |
|-----------------|-------|
| Durch. Kupon    | 3,94  |
| Durch. Laufzeit | 8,65  |
| Rendite         | 3,21  |
| Duration        | 6,49  |
| Mod. Duration   | 6,29  |
| Konvexität      | 80,87 |

Quelle: Bloomberg, 31.01.2011

## Lyxor ETF EuroMTS AAA Government Bond

Internet: [www.LyxorETF.de](http://www.LyxorETF.de)

Tel: +49 (0) 69 717 4444

E-Mail: [Info@LyxorETF.de](mailto:Info@LyxorETF.de)

## Eckdaten des Fonds

### Fondsinformationen

|                         |                                         |
|-------------------------|-----------------------------------------|
| Referenzindex           | EuroMTS AAA Government All Maturity     |
| Indextyp                | Performanceindex                        |
| Rechtsform              | Franz. FCP UCITS I&III (Sondervermögen) |
| Auflage                 | 16.11.09                                |
| Geschäftsjahresende     | 31. November                            |
| Verwaltungsgebühr p.a.  | 0,165%                                  |
| Ertragsverwendung       | thesaurierend                           |
| NAV (EUR)               | 108,14 EUR (Stand: 31.01.2011)          |
| Fondsvermögen (EUR)     | 616,4 Mio. EUR (Stand: 31.01.2011)      |
| ISIN                    | FR0010820258                            |
| WKN                     | LYX0FK                                  |
| Verhältnis ETF / Index  | ca. 6/10                                |
| Min. handelbare Einheit | 1 ETF                                   |

### Handelsinformationen

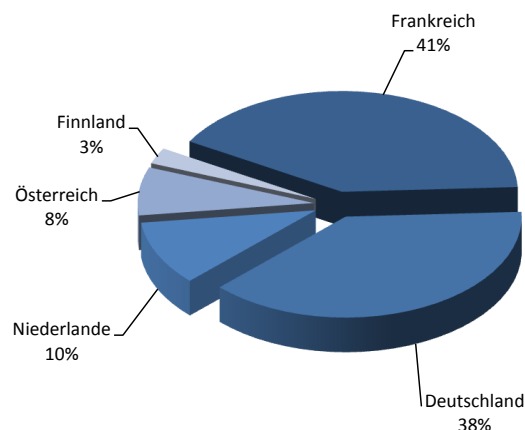
|                 | Reuters   | Bloomberg |
|-----------------|-----------|-----------|
| iNAV            | .INMAA    | INMAA     |
| Deutsche Boerse | LYXMAA.DE | LYXMAA GY |
| Borsa Italiana  | EMAAA.MI  | EMAAA IM  |
| Euronext Paris  | MAA.PA    | MAA FP    |

zusätzlich bei Bloomberg: <Equity> <Go>

## Indexeigenschaften

|                        |                                   |
|------------------------|-----------------------------------|
| Region                 | Eurozone                          |
| Anlageklasse           | Staatsanleihen                    |
| Anzahl der Komponenten | 112 (Quelle: EuroMTS, 31.01.2011) |
| Währung                | EUR                               |
| Bloomberg              | EM3AGR                            |
| Reuters                | EM3AGRT=                          |

Dieser Index wird von EuroMTS Ltd. berechnet. Nähere Informationen finden Sie unter [www.euromtsindex.com](http://www.euromtsindex.com)



## Lyxor ETF EuroMTS AAA Government Bond

Factsheet Januar 2011

**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; Lyxor Asset Management („LyxorAM“) und Société Générale S.A. („SG“) 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 Werbeinformation 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 WpHG 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 Verkaufsprospekt sowie die Jahres- und Halbjahresberichte des Fonds können online unter [www.lyxoretf.de](http://www.lyxoretf.de) heruntergeladen oder kostenlos bei der Société Générale S.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main, Neue Mainzer Straße 46-50, 60311 Frankfurt am Main 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.