

Weltweit nachhaltig anlegen

Lyxor MSCI World ESG Trend Leaders UCITS ETF

Sie möchten in globale Aktien investieren und gleichzeitig Nachhaltigkeitsaspekte berücksichtigen? Mit dem breit gefassten Lyxor MSCI World ESG Trend Leaders UCITS ETF können Sie diese Anlagestrategie umsetzen. ESG steht für Environmental, Social and Corporate Governance (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) und beschreibt den Beitrag der Wirtschaft zu einer nachhaltigen Entwicklung über die gesetzliche Anforderung hinausgehend. Das Besondere am Ansatz des hier vorgestellten ETFs: Der zugrunde liegende Index enthält auch die voraussichtlichen Gewinner von morgen, also die Unternehmen, die ihr ESG-Rating im Zeitverlauf verbessern.

Der ETF bezieht sich auf den MSCI World Select ESG Rating and Trend Leaders Net Return USD Index. Für sein Anlageuniversum werden rund 800 Unternehmen nach strengen Nachhaltigkeitskriterien aus dem übergeordneten MSCI World Index, der eine Grundgesamtheit von rund 1.650 Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung (Large und Mid Caps) aus 23 Industrieländern bietet, selektiert. Zudem werden die Entwicklung des ESG-Ratings (ESG Momentum, siehe unten) und die ESG-Werte der Unternehmen innerhalb des Gesamtsektors berücksichtigt. Um eine Übergewichtung eines bestimmten Sektors zu vermeiden, orientiert sich die Sektorallokation an der des größeren MSCI World Index. Einmal jährlich, jeweils Ende Mai, wird die Indexzusammensetzung überprüft und gegebenenfalls angepasst.

Fokus auf die besten ESG-Aktien

Auf Basis dieser Daten hat MSCI den zugrunde liegenden ESG Trend Leaders-Index des ETFs konzipiert, der sich ausschließlich auf die besten ESG-Aktien konzentriert. Daraus resultieren höhere Indexgewichtungen für Unternehmen mit den besten ESG-Wertungen. Der ESG Trend Leaders-Index geht außerdem noch einen Schritt weiter und berücksichtigt auch die Entwicklung der Ratings im Laufe der Zeit. So werden führende Unternehmen, die ihre Wertung verbessern, belohnt.

Der ETF auf einen Blick

- ▶ Breites Kerninvestment in globale Aktien unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien
- ▶ Auswahl der besten ESG-Aktien unter Berücksichtigung der Entwicklung des ESG-Ratings im Zeitverlauf
- ▶ Aktienausswahl auf Basis der über 40-jährigen ESG-Fachkompetenz von MSCI, einem der weltweit führenden Anbieter von Nachhaltigkeitsanalysen und ESG-Ratings

Informationen zum ETF und zum Index

Indexname	MSCI World Select ESG Rating and Trend Leaders Net Return USD Index
Indexpositionen	767
ETF-Name	Lyxor MSCI World ESG Trend Leaders (DR) UCITS ETF
WKN/ISIN	LYX0YL / LU1792117779
Auflegedatum	22.03.2018
Replikation	Direkt replizierend
Fondswährung	USD
Wertpapierleihe	nein
Gesamtkostenquote	0,18% p.a.
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Handelsplatz	Xetra
Währung	EUR

Wir wissen, dass sich Anleger Gedanken über die Art von Unternehmen machen, die sie in ihrem Portfolio halten. Deshalb schließt MSCI innerhalb seines World ESG Trend Leaders-Index Unternehmen aus, deren Aktivitäten ein hohes Potenzial negativer Auswirkungen auf die Gesellschaft oder die Umwelt haben. Dazu zählen unter anderem Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Kernenergie und Waffen sowie hochkontroverse Unternehmen.



Alkohol



Tabak



Glücksspiel



Kernenergie

Konventionelle
WaffenKontroverse
WaffenStarke
Kontroversen

Mehr erfahren:

www.lyxorETF.de

Wie die MSCI ESG Ratings und Trendindizes aufgebaut sind

Trend Gruppe	Trend	Trend Punktzahl
1	Upgrade	1.25
2	Neutral	1
3	Downgrade	0.75

Jedem Unternehmen wird ein kombinierter ESG-Score zugewiesen. Diese Punktzahl kombiniert die ESG-Bewertung (auf einer Skala von „AAA“ bis „CCC“) und die Entwicklung dieses Ratings – also die Veränderung von einem Bewertungszeitraum zum anderen. Der Trendwert eines Unternehmens steigt, wenn sein Rating hochgestuft wird oder fällt, wenn seine Punktzahl herabgestuft wird. Wertpapiere mit einer Punktzahl von weniger als 0,75 werden ausgeschlossen (es sei denn, es handelt sich um einen vorhandenen Indexbestandteil, in diesem Fall beträgt die Grenze 0,625).

Warum ESG „Trends“ wichtig sind



Die Trend Leader Indizes von MSCI gehen einen Schritt weiter als die Standard Leader Indizes, indem sie das „ESG-Momentum“ berücksichtigen



Ähnliche Abdeckung für die Top **50%** der Muttermarktkapitalisierung, basierend auf **kombinierten ESG Ratings** und **ESG Trend Punktzahlen**



Unternehmen, die ihr ESG-Rating im Vergleich zum Vorjahr verbessert haben, werden mit einer höheren Wahrscheinlichkeit der Aufnahme **belohnt** (und umgekehrt für diejenigen, deren ESG-Punktzahl sich verschlechtert hat)

Die Top 10 Titel des MSCI World ESG Trend Leaders Index

Unternehmen	Branche	Gewichtung (in %)
Microsoft	Informationstechnologie	7,02%
Alphabet (A)	Kommunikationsdienstleistungen	2,56%
Alphabet (C)	Kommunikationsdienstleistungen	2,54%
Tesla	Automobilindustrie	2,19%
Nvidia	Informationstechnologie	1,47%
Visa (A)	Finanzdienstleistung	1,41%
Home Depot	Zyklische Konsumgüter	1,30%
Procter & Gamble	Zyklische Konsumgüter	1,27%
Intel	Informationstechnologie	1,01%
ASML	Informationstechnologie	1,01%

Stand der Daten: 15. April 2021

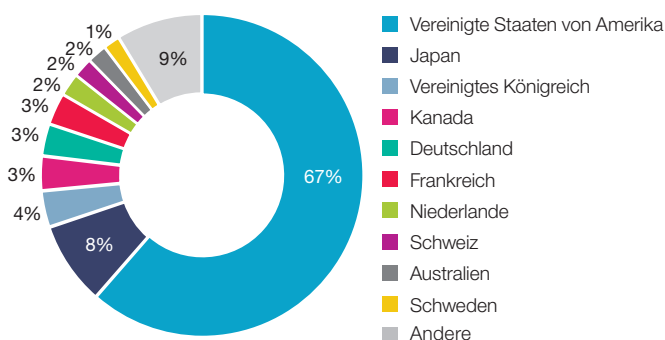
Wertentwicklung des MSCI World Select ESG Rating and Trend Leaders Index vs. MSCI World Index (indexiert, über 5 Jahre)



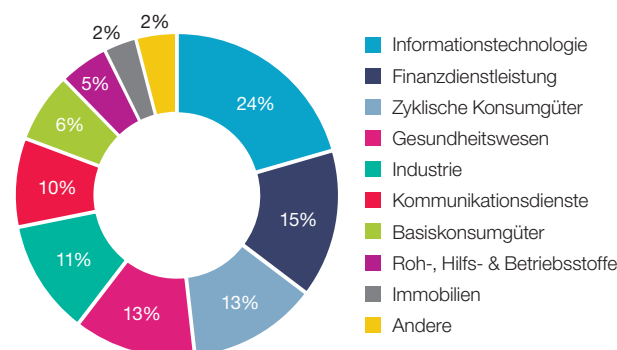
Quelle: Bloomberg. Stand der Daten: 15. April 2021. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für die künftige Entwicklung.

Indexzusammensetzung

Länderaufteilung



Branchenaufteilung



Stand der Daten: 15. April 2021

Die Risiken kennen

Es ist wichtig, dass potenzielle Anleger die folgenden sowie die in den Verkaufsprospekten, die unter www.lyxorETF.de abrufbar sind, beschriebenen Risiken berücksichtigen.

KAPITALRISIKO: ETFs sind nachbildende Instrumente: Ihr Risikoprofil ähnelt dem einer direkten Anlage in den zugrunde liegenden Index. Das Kapital der Anleger ist vollständig dem Risiko ausgesetzt und Anleger erhalten unter Umständen den ursprünglich investierten Betrag nicht zurück. Im schlimmsten Fall kann es zu einem Totalverlust kommen.

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.

KONTRAHENTENRISSIKO: Bei synthetisch replizierenden Fonds sind die Anleger Risiken infolge der Verwendung eines OTC-Swaps (over-the-counter) mit der Société Générale ausgesetzt. Gemäß den OGAW-Richtlinien darf das mit der Société Générale eingegangene Risiko 10 % des Gesamtvermögens des Fonds nicht übersteigen. Unter www.lyxorETF.de finden Sie nach Eingabe der WKN nähere Informationen darüber, ob es sich um einen synthetisch replizierenden (SWAP) oder um einen vollreplizierenden Fonds handelt.

KONZENTRATIONSRISSIKO: Bei Smart Beta-ETFs werden aus dem Benchmark-Index Aktien oder Anleihen für das Fondsportfolio ausgewählt. Ein komplexer Auswahlprozess kann im Ergebnis zu einem stärker konzentrierten Portfolio führen, mit einer höheren Risikokonzentration bei weniger Einzeltiteln als im Benchmark-Index.

Mehr erfahren:

www.lyxorETF.de

RISIKO IN VERBINDUNG MIT DEM BASISWERT: Der zugrunde liegende Index eines Lyxor ETFs kann komplex und volatil sein. Indizes, die sich auf Aktien (insbesondere aus den Emerging Markets) oder Rohstoffe beziehen, können einer erhöhten Volatilität unterliegen. 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.

FREMDWÄHRUNGSRISIKO: 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 nicht normalen Handelssituation bzw. Handelsereignisses beschränkt sein.

MSCI-Hinweis

Die MSCI-Indizes sind alleiniges Eigentum von MSCI. MSCI und die MSCI-Indexbezeichnungen sind Dienstleistungsmarken von MSCI oder ihren verbundenen Unternehmen und wurden für die Nutzung zu bestimmten Zwecken durch die Verwaltungsgesellschaft lizenziert. Keine der MSCI-Parteien übernimmt gegenüber der Emittentin oder den Inhabern des Teilfonds oder sonstigen natürlichen oder juristischen Personen weder ausdrücklich noch stillschweigend irgendeine Zusicherung oder Gewährleistung dafür, dass eine Anlage in Fonds im allgemeinen oder in den Teilfonds im speziellen empfehlenswert ist oder dass die MSCI-Indizes geeignet sind, die entsprechende Aktienmarkt-Entwicklung abzubilden. Die vollständigen Hinweise finden Sie auf www.msci.com/notice-and-disclaimer.

Wichtige Hinweise

Diese Veröffentlichung erfolgt durch Lyxor International Asset Management (LIAM), eine von der französischen Finanzmarktaufsicht Autorité des Marchés Financiers zugelassene und den Bestimmungen der OGAW-Richtlinie (2009/65/EG) und der AIFM-Richtlinie (2011/61/EU) unterliegende französische Verwaltungsgesellschaft. Société Générale ist ein von der französischen Aufsichtsbehörde Autorité de contrôle prudentiel et de résolution zugelassenes französisches Kreditinstitut (Bank). Einige der in dieser Broschüre beschriebenen Fonds sind entweder Teilfonds von Multi Units Luxembourg, Lyxor SICAV oder Lyxor Index Fund – Investmentgesellschaften mit variablem Kapital (SICAV) nach luxemburgischem Recht – und unterliegen der Aufsicht der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) oder Teilfonds von Lyxor 1, ein Sondervermögen nach deutschem Recht, und unterliegen der Aufsicht der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin). Alternativ dazu handelt es sich bei einigen der in diesem Dokument beschriebenen Fonds entweder um (i) französische FCPs (fonds commun de placement) oder (ii) Teilfonds von Multi Units France, einer französischen SICAV. Sowohl die französischen FCPs als auch die Teilfonds von Multi Units France wurden nach französischem Recht errichtet und von der Autorité des marchés financiers beaufsichtigt. Jeder Fonds erfüllt die Bedingungen der OGAW-Richtlinie (2009/65/EG) und wurde von der jeweiligen Aufsichtsbehörde genehmigt. Société Générale und Lyxor AM empfehlen Anlegern, den Abschnitt „Risikofaktoren“ im Prospekt und im Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) des Produkts sorgfältig zu lesen. Der Prospekt in englischer und/oder deutscher Sprache und das KIID in deutscher Sprache sind kostenfrei in Deutschland bei Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland, Neue Mainzer Straße 46-50, 60311 Frankfurt am Main; in Österreich bei Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Am Belvedere 1, A-1100 Wien, die als Zahlstelle und steuerlicher Vertreter agiert sowie unter lyxoretf.de erhältlich. Die Produkte sind Gegenstand von Market Making-Verträgen, deren Zweck darin besteht, unter der Voraussetzung normaler Marktbedingungen und normal funktionierender Computersysteme die Liquidität der Produkte an der NYSE Euronext Paris, der Deutschen Börse (Xetra) und der London Stock Exchange sicherzustellen. Anteile eines von einem Vermögensverwalter verwalteten OGAW-ETFs, die am Sekundärmarkt erworben wurden, können in der Regel nicht direkt an den Vermögensverwalter zurückverkauft werden. Anleger müssen Anteile am Sekundärmarkt mit Unterstützung eines Intermediärs (z. B. eines Brokers) kaufen und verkaufen, wobei hierfür Gebühren anfallen können. Darüber hinaus zahlen Anleger beim Kauf von Anteilen unter Umständen mehr als den aktuellen Nettoinventarwert und erhalten beim Verkauf der Anteile gegebenenfalls einen geringeren Betrag als den aktuellen Nettoinventarwert zurück. Die aktuelle Zusammensetzung des Anlageportfolios des Produkts ist auf www.lyxoretf.de verfügbar. Der indikative Nettoinventarwert wird zudem auf den entsprechenden Reuters- und Bloomberg-Seiten für das Produkt veröffentlicht und gegebenenfalls auch auf den Internetseiten der Börsen, an denen das Produkt notiert ist, angegeben. Vor einer Anlage in das Produkt sollten Anleger sich von unabhängiger Seite in finanziellen, steuerlichen, rechnungslegungsbezogenen und rechtlichen Fragen beraten lassen. Es liegt in der Verantwortung eines jeden Anlegers, sich zu vergewissern, dass er zur Zeichnung dieses Produkts oder zu einer Anlage in dieses Produkt berechtigt ist. Dieses Dokument stellt zusammen mit dem Prospekt und/oder allgemein jeglichen auf den Fonds bezogenen oder damit im Zusammenhang stehenden Informationen oder Dokumenten weder ein Verkaufsangebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Verkaufsangebots in einer Rechtsordnung, (i) in der ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung nicht zulässig ist, (ii) in der die Person, die ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung macht, nicht dazu befugt ist, oder (iii) gegenüber Personen, denen gegenüber ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung rechtswidrig ist, dar. Des Weiteren sind die Anteile nicht gemäß dem US-amerikanischen Securities Act von 1933 registriert und dürfen weder direkt noch indirekt in den Vereinigten Staaten (einschließlich US-Territorien oder Besitzungen) oder an bzw. zugunsten von US-Personen (d. h. eine „US-Person“ im Sinne von Regulation S des Securities Act von 1933 in der jeweils geltenden Fassung und/oder eine Person, die nicht unter die Definition einer „Nicht-US-Person“ im Sinne von Section 4.7 (a) (1) (iv) der Vorschriften der U.S. Commodity Futures Trading Commission fällt) angeboten oder verkauft werden. Dieses Dokument sowie allgemein jegliche auf den Fonds bezogenen oder damit im Zusammenhang stehenden Dokumente wurden nicht von einer US-amerikanischen Wertpapieraufsichtsbehörde auf nationaler oder bundesstaatlicher Ebene überprüft oder genehmigt. Gegenteilige Behauptungen sind strafbar. Dieses Dokument dient Informations- und nicht aufsichtsrechtlichen Zwecken und stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots von Société Générale, Lyxor Asset Management (zusammen mit seinen verbundenen Unternehmen „Lyxor“) oder einer ihrer jeweiligen Tochtergesellschaften zum Kauf oder Verkauf des in diesem Dokument genannten Fonds dar. Fonds sind mit dem Risiko eines Kapitalverlusts verbunden. Der Rücknahmewert der Anteile des Fonds kann geringer sein als der ursprüngliche investierte Betrag. Der Wert des Fonds kann sowohl steigen als auch fallen, daher wird die Anlagerendite unweigerlich schwanken. Im schlimmsten Fall könnten Anleger ihren gesamten Anlagebetrag verlieren. Dieses Dokument darf ohne vorherige schriftliche Zustimmung von Lyxor AM oder Société Générale weder ganz oder teilweise vervielfältigt werden. Die Anwendbarkeit der (gegebenenfalls) in diesem Dokument beschriebenen steuerlichen Vorteile bzw. Besteuerung hängt vom jeweiligen steuerlichen Status des Anlegers, der Rechtsordnung, von der aus er die Anlage tätigt, sowie vom anwendbaren Recht ab. Die Besteuerung kann sich jederzeit ändern. Anleger, die weitere Informationen zu ihrem steuerlichen Status erhalten möchten, sollten sich an ihren Steuerberater wenden. Anleger sollten beachten, dass der (gegebenenfalls) in diesem Dokument angegebene Nettoinventarwert nicht als Grundlage für Zeichnungen und/oder Rücknahmen verwendet werden kann. Die in diesem Dokument dargestellten Marktinformationen beruhen auf zu einem bestimmten Zeitpunkt vorliegenden Daten und können sich ändern. ©2021 Lyxor Asset Management. Alle Rechte vorbehalten. Stand: 19.4.2021

Mehr erfahren:

www.lyxorETF.de