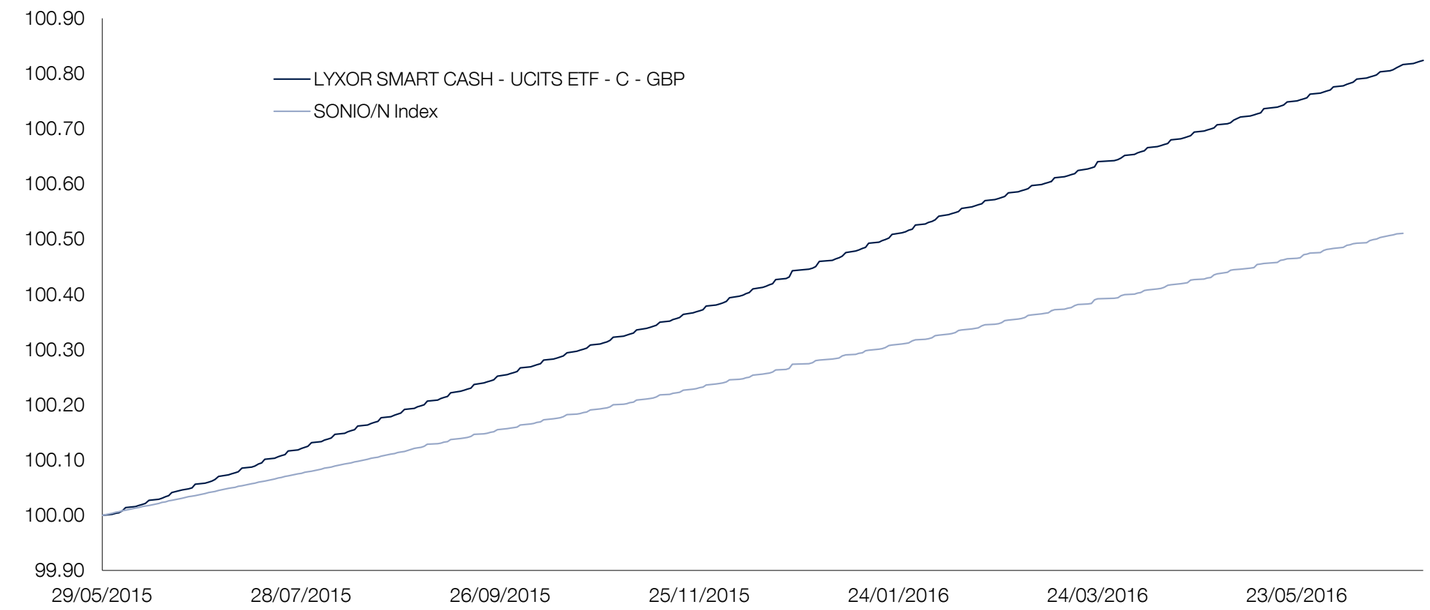
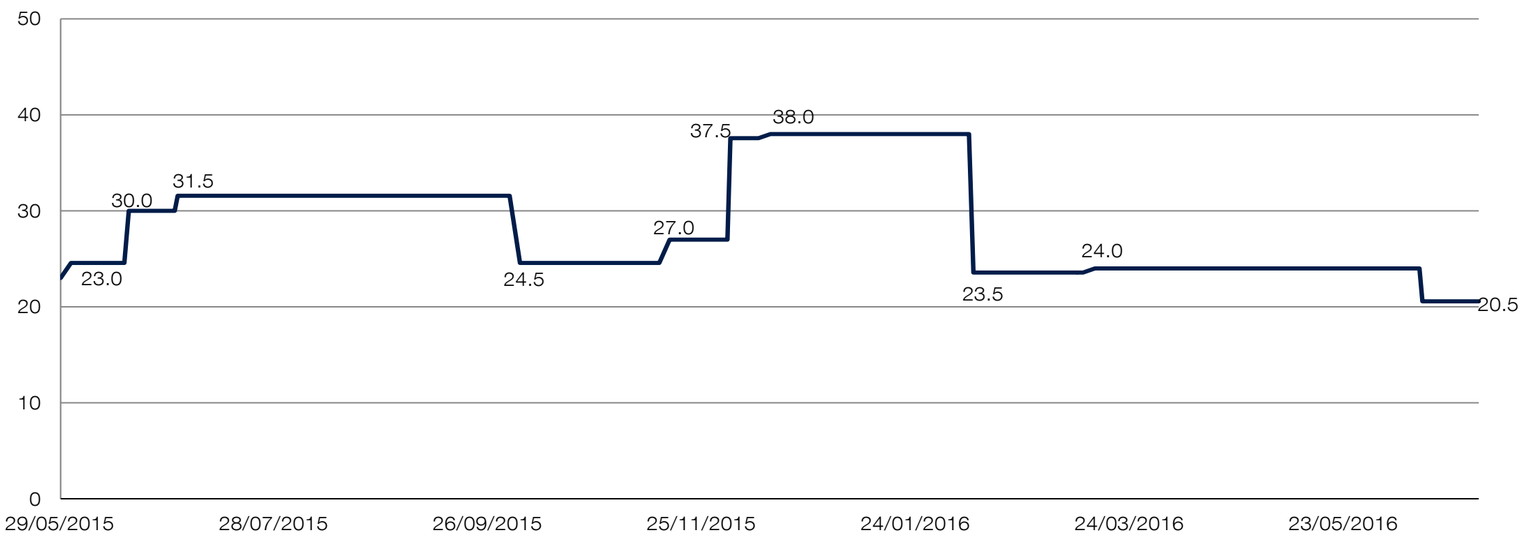
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - GBP

PERFORMANCE NETTE DEPUIS LE LANCEMENT



PRIME ANNUALISEE NETTE VS SONIO/N INDEX (bps)



PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT

	MTD	3 mois	6 mois	YTD	1 an	3 ans	Depuis le lancement
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - GBP	0.0567%	0.1758%	0.3622%	-	0.7628%	-	**0.8233%**
SONIO/N Index	0.0384%	0.1171%	0.2339%	-	0.4694%	-	**0.5103%**

Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

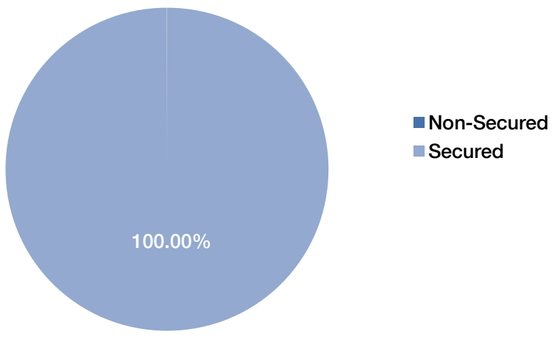
MONTHLY PERFORMANCES

	Jan	Fév	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	Annuel
2016	0.0655%	0.0597%	0.0607%	0.0604%	0.0586%	0.0567%							0.3622%
2015						0.0600%	0.0713%	0.0624%	0.0645%	0.0634%	0.0581%	0.0788%	0.4595%

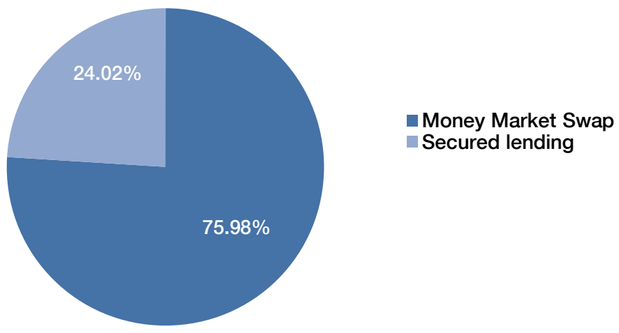
Les performances passées ne sauraient présager des performances futures.
Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

PORTFOLIO ANALYSIS BY INSTRUMENT TYPE

PRÊTS DE TITRES SÉCURISÉS VS NON SÉCURISÉS % DE L'ACTIF NET



TYPE D'INSTRUMENT % DE L'ACTIF NET



10 PRINCIPALES VALEURS

Nom	Poids	Pays	Secteur	Classe d'actifs
Nestle Sa Registered	4.58%	CH	Consommation Discrétionnaire	Actions
Fast Retailing Co Ltd	4.56%	JP	Biens de Consommation de Base	Actions
Total Sa	4.56%	FR	Energie	Actions
Geberit AG	4.17%	CH	Industries	Actions
Air Liquide SA	4.40%	FR	Matériaux de base	Actions
Safran SA	4.35%	FR	Industries	Actions
Danone	4.28%	FR	Consommation Discrétionnaire	Actions
Vinci SA	4.23%	FR	Industries	Actions
ACTELION N	3.96%	CH	Consommation Discrétionnaire	Actions
BNP Paribas	3.87%	FR	Sociétés financières	Actions
Banco Santander SA	3.32%	ES	Sociétés financières	Actions

Nombre total d'actions utilisées comme garantie 91

Ticker : CSH2 LN Equity

INFORMATIONS SUR LE FONDS

Code Bloomberg	CSH2 LN Equity
Structure du Fonds	SICAV
Domiciliation	Luxembourg
Conformité UCITS IV	Oui
Code ISIN :	LU1230136894
Méthode de Réplication	Indirect (Swap
Prêts de titres	Non
Pleine propriété des actifs	Oui
Devise de la part	GBP
Date de création de la part	2 Mars 2015
VL de Lancement (GBP)	1 000
TFE (frais / an)	0.095%
Risque de change	Non
Valeur liquidative (GBP)	1,008.2331
Actif net (M GBP)	3.4885
Actif Net du Fonds (M EUR)	612.86
Umbrella	-
Investissement minimum	1
Affectation des résultats	Capitalisation

Trading Information

Place	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters	Distribution
NYSE EuroneParis *	EUR	CSH2 FP	CHS2.PA	Non
Borsa Italiana (Milano)	EUR	SMART IM	LYSMART.MI	Non
LSE**	GBP	CSH2 LN	CSH2.L	Non
LSE**	USD	SMTC LN	SMTC.L	Non

* Première place de cotation pour cette classe de parts

** Cotation des autres classes de parts

INFORMATION SUR L'INDICE

Nom	-
Exposition	-
Classe d'actifs	-
Type de l'indice	-
Devise	-
Code Reuters de l'indice	-
Code Bloomberg de l'indice	-
Informations complémentaires	

CHIFFRES CLÉS

Actif Net du Fonds (M EUR):	612.8643
Valeur liquidative (GBP) :	1,008.2331
Performance Annualisée	0.755%
Volatilité Annualisée	0.029%

Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

Exposition à la contrepartie*	Effective	-4.91%
	Cible	0.00%
Expected Loss (Perte Attendue)**	Effective	0.026%
	Cible	< 0.05%

* La somme des engagements pris face à la contrepartie moins la somme des poids des titres pris comme garanties

** l'Expected loss est la perte attendue liée au risque de défaut de la contrepartie. La perte attendue dûe au défaut de la contrepartie concernée mesure la probabilité de défaut de la contrepartie. La perte effective peut être supérieure à la perte attendue.

Notation Minimale de la Contrepartie		A-
Sensibilité Taux		0
Maturité Moyenne Pondérée	Effective	1 Jour
Durée de Vie Moyenne Pondérée	Effective	2 mois

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

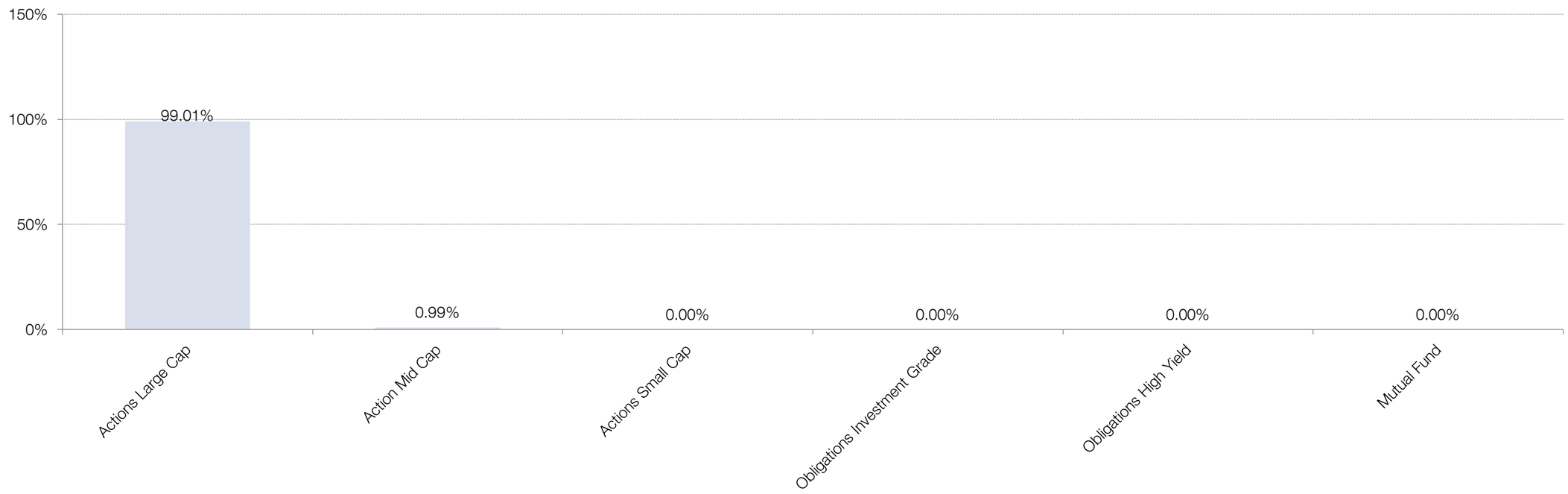
LYXOR SMART CASH est un fonds UCITS qui vise à réaliser, à court terme et avec une très faible volatilité, des rendements plus élevés que l'indice SONIA

Le fonds est géré de façon active et investit dans un portefeuille diversifié d'instruments financiers et de pensions livrées, avec une surveillance stricte du risque et de la liquidité du portefeuille.

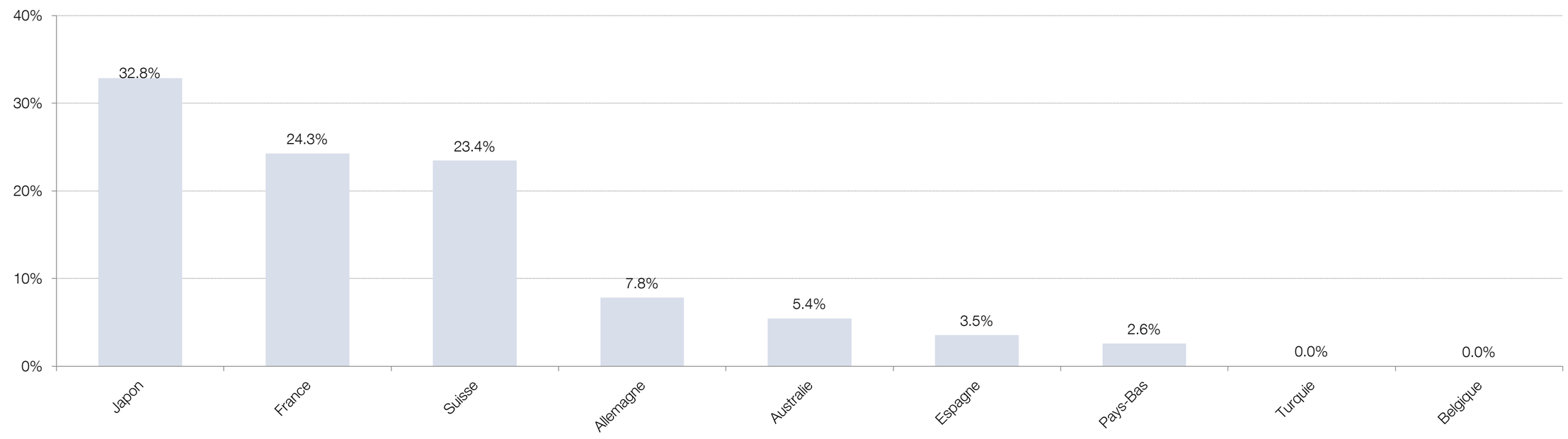
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - GBP

ANALYSE DU PANIER D'ACTIONS UTILISEES COMME GARANTIES

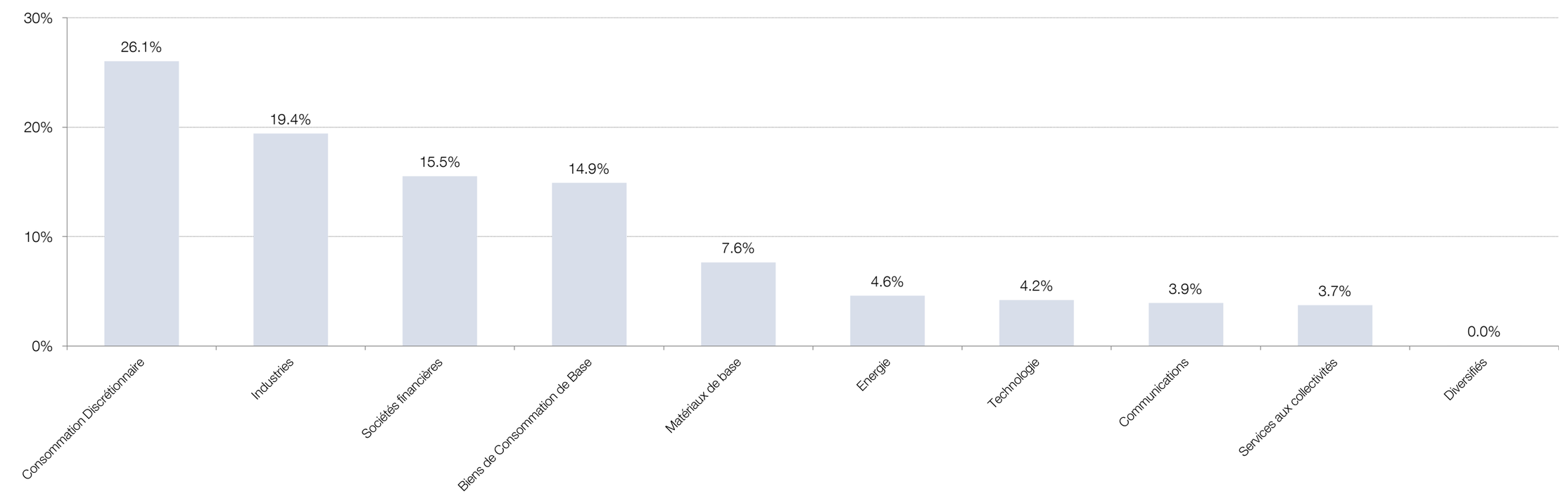
ALLOCATION CATÉGORIELLE DES TITRES



ALLOCATION GEOGRAPHIQUE DES TITRES



ALLOCATION SECTORIELLE DES TITRES



THIS DOCUMENT IS FOR THE EXCLUSIVE USE OF INVESTORS ACTING ON THEIR OWN ACCOUNT AND CATEGORISED EITHER AS “ELIGIBLE COUNTERPARTIES” OR “PROFESSIONAL CLIENTS” WITHIN THE MEANING OF MARKETS IN FINANCIAL INSTRUMENTS DIRECTIVE 2004/39/CE.

This material has been prepared for informational purposes only and does not constitute an offer, or a solicitation of an offer, to buy or sell any security or instrument, do not constitute an offer of purchase, sale or subscription of financial instruments nor is it a marketing proposal to participate in any investment strategy or an offer of financial services. Any such offer or solicitation may be made only pursuant to the Prospectus or Offering Memorandum. This product may be subject to restrictions with regard to certain persons or in certain countries under national regulations applicable to said persons or in said countries. Lyxor Asset Management and its subsidiaries may not be held responsible for the financial or other consequences that may arise from the investment in this product. The information presented in this document is based on market data at a given moment and may change from time to time. Past performances do not guarantee future results.