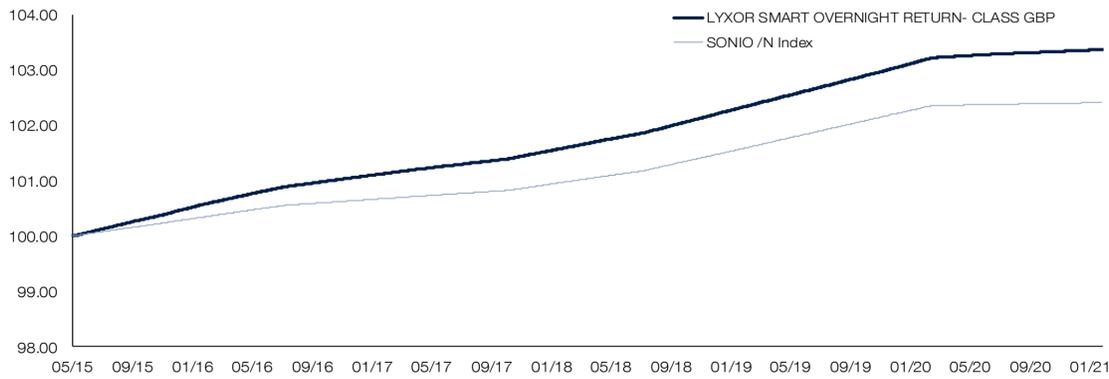
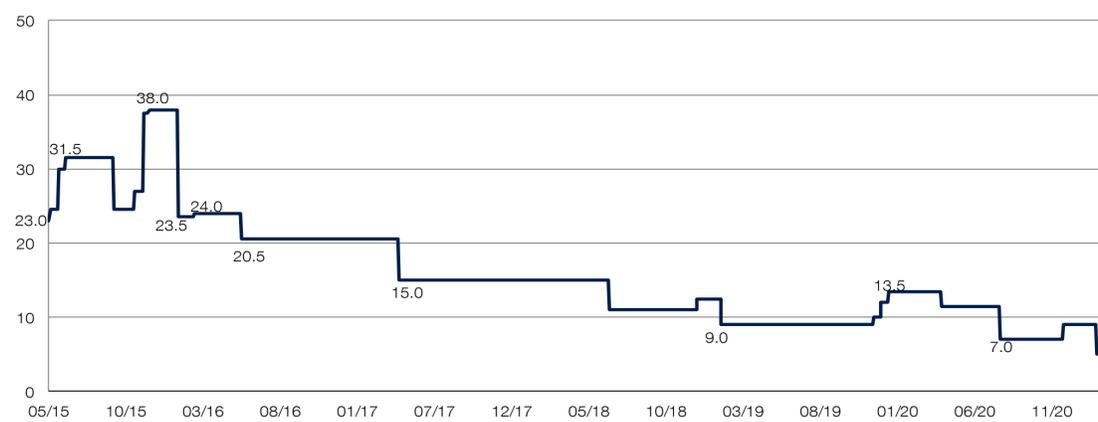


LYXOR OVERNIGHT RETURN - UCITS ETF - C - GBP

NETTO WERTENTWICKLUNGEN AUFLAGEDATUM



NETTO JAHRESRENDITE UBER SONIO/N INDEX (bps)



WERTENTWICKLUNG AUFLAGEDATUM

| | MTD | 3 Monate | 6 Monate | YTD | 1 Jahr | 3 Jahre | Auflagedatum |
|--|-------|----------|----------|-------|--------|---------|--------------|
| LYXOR OVERNIGHT RETURN - UCITS ETF - C - GBP | 0.01% | 0.03% | 0.06% | 0.02% | 0.18% | 1.74% | 3.37% |
| SONIO/N Index | 0.00% | 0.01% | 0.03% | 0.01% | 0.08% | 1.42% | 2.41% |

Alle Wertentwicklungen basieren auf offiziellen NAV Werten nach Gebühren.

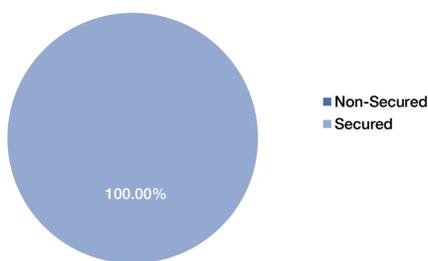
MONTHLY PERFORMANCES

| | Jan | Feb | März | April | Mai | Juni | Juli | Augu | Sept | Okt | Nov | Dez | Jährlich |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| 2021 | 0.01% | 0.01% | | | | | | | | | | | 0.02% |
| 2020 | 0.08% | 0.07% | 0.04% | 0.02% | 0.01% | 0.01% | 0.02% | 0.01% | 0.01% | 0.01% | 0.01% | 0.01% | 0.30% |
| 2019 | 0.07% | 0.06% | 0.07% | 0.07% | 0.07% | 0.06% | 0.07% | 0.07% | 0.06% | 0.08% | 0.06% | 0.07% | 0.82% |
| 2018 | 0.05% | 0.05% | 0.06% | 0.05% | 0.05% | 0.05% | 0.05% | 0.07% | 0.06% | 0.07% | 0.07% | 0.07% | 0.70% |
| 2017 | 0.03% | 0.03% | 0.04% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.03% | 0.05% | 0.05% | 0.43% |
| 2016 | 0.07% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.04% | 0.04% | 0.03% | 0.03% | 0.04% | 0.60% |
| 2015 | | | | | | 0.06% | 0.07% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.08% | 0.46% |

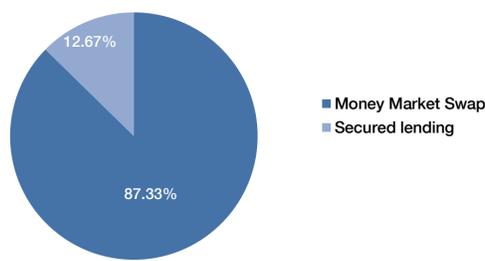
Die Daten zu [früheren Wertentwicklungen/simulierten früheren Wertentwicklungen/früheren und simulierten früheren Wertentwicklungen] beziehen sich auf die Vergangenheit und sind kein verlässlicher Indikator für z. B. zukünftige Wertentwicklungen. Alle Wertentwicklungen basieren auf offiziellen NAV Werten nach Gebühren.

PORTFOLIO ANALYSIS BY INSTRUMENT TYPE

GESICHERTE VS UNGESICHERTE LEIHQUOTE IN PROZENT DER NETTOVERMÖGEN IN % DES NETTOVERMÖGENS



INSTRUMENTENTYP IN % DES NETTOVERMÖGENS



| | | |
|--|--------|----|
| Minimumrating der Gegenpartei | | A- |
| Zinssensitivität | | 0 |
| Gewichtete durchschnittliche Maturität | Actual | - |
| Gewichtete Durchschnittslaufzeit | Actual | - |

TOP 10 BESTANDTEILE

| Name | Gewichtung | Land | Sektoren | Anlagenklasse |
|-------------------------|------------|------|--------------------------------|---------------|
| BNP Paribas | 7.69% | FR | Finanzwesen | Aktien |
| Total Sa | 7.66% | FR | Energie | Aktien |
| Sanofi | 7.38% | FR | Nicht-Basiskonsumgüter | Aktien |
| Softbank Corp | 5.84% | JP | Telekommunikationsdienste | Aktien |
| ENGIE | 5.53% | FR | Versorgungsbetriebe | Aktien |
| Facebook Inc | 4.29% | US | Telekommunikationsdienste | Aktien |
| APPLE COMP INC | 4.23% | US | Hardware Technologie, Speicher | Aktien |
| Veolia Environnement SA | 4.03% | FR | Versorgungsbetriebe | Aktien |
| CREDIT AGRICOLE | 3.60% | FR | Finanzwesen | Aktien |
| ALPHABET INC-CL C | 3.59% | US | Telekommunikationsdienste | Aktien |

Gesamtzahl der als Garantie verwendeten Wertpapiere 200

Ticker : CSH2 LN Equity

WESENTLICHE MERKMALE

| | |
|--|-------------------------|
| Bloomberg Ticker | CSH2 LN Equity |
| Rechtsform | SICAV |
| Domizilierung | Luxemburg |
| UCITS-Konform | Ja |
| ISIN : | LU1230136894 |
| Replikationsmethode | Indirekt (Swap-basiert) |
| Wertpapierleihe | Nein |
| Voller Besitz der Vermögenswerte | Ja |
| Währung der Anteilsklasse | GBP |
| Auflagedatum | 2. März 2015 |
| Nettoinventarwert pro Anteil zum Zeitpunkt der Auflagerung | 1 000 |
| Gesamtkostenquote (TER) | 0.050% |
| Fremdwährungsrisiko | Nein |
| Nettoinventarwert pro Anteil (GBP) | 1,033.6751 |
| AuM der Anteilsklasse (M GBP) | 14.2802 |
| Gesamtfondsvermögen (M EUR) | 1,166.23 |
| Umbrella-Fonds | - |
| Mindestanlagebetrag | 1 |
| Ertragsverwendung | Thesaurierend |

Handelsinformationen

| Handelsplatz | Währung | Bloomberg Ticker | Reuters RIC | Distribution |
|-------------------------|---------|------------------|-------------|--------------|
| NYSE EuroneParis * | EUR | CSH2 FP | CHS2.PA | Nein |
| Borsa Italiana (Milano) | EUR | SMART IM | LYSMART.MI | Nein |
| LSE** | GBP | CSH2 LN | CSH2.L | Nein |
| LSE** | USD | SMTCL LN | SMTCL.L | Nein |

* Handelsplatz der Erstzulassung dieser Anteilsklasse
** Zulassung anderer Anteilsklassen

HANDELSINFORMATIONEN

| | |
|------------------------|--|
| Name | SONIO/N Index |
| Risiko | SONIO/N Index |
| Anlagenklasse | Geldmarkt |
| Indextyp | - |
| Währung | GBP |
| Index Reuters RIC : | - |
| Index Bloomberg Ticker | - |
| Weitere Informationen | www.mtsindices.com |

SCHLÜSSELKENNZAHLEN

| | |
|---------------------------------|------------|
| Gesamtfondsvermögen (Mio. EUR): | 1,166.2261 |
| Nettoliquidationswert (GBP) : | 1,033.6751 |
| Annualisierte Performance | 0.5773% |
| Annualisierte Volatilität | 0.0284% |

Alle Wertentwicklungen basieren auf offiziellen NAV Werten nach Gebühren.

| | | |
|------------------------|--------|---------|
| Kontrahenten-Exposure* | Actual | -7.47% |
| | Ziel | < 0.00% |
| Expected Loss** | Actual | -0.003% |
| | Ziel | < 0.05% |

* Die Summe der mit dem Fond gehandelten Gegenparteiverbindlichkeiten abzüglich des Wertes des Wertpapierkorbs der als Garantie gebraucht wird.
** Der Expected Loss ist der durchschnittliche erwartete Verlust in Relation zum Gegenparteiausfallrisiko. Das heisst der Loss Given Default für die betroffene Gegenpartei multipliziert mit der Ausfallwahrscheinlichkeit dieser Gegenpartei. Der tatsächliche Verlust kann höher als der Expected Loss sein.

ANLAGEZIEL

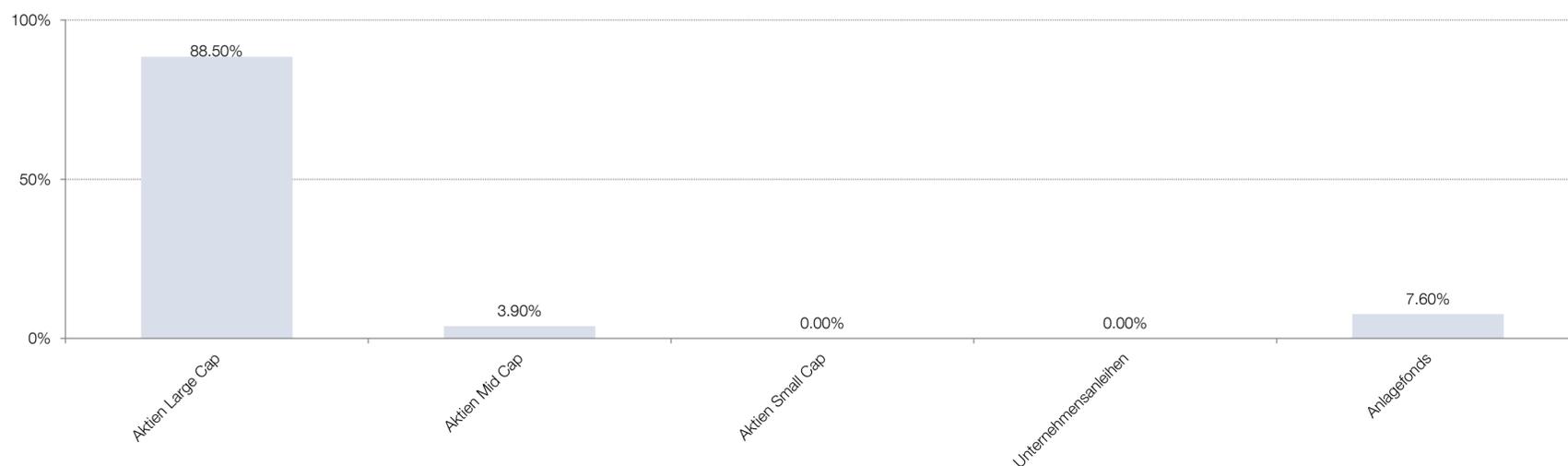
Der Lyxor Smart Overnight Return ETF ist ein UCITS konformer Fonds mit dem Ziel kurzfristige Erträge über dem Benchmark Index SONIA. Der Fond wird aktiv verwaltet und investiert in ein diversifiziertes Portfolio von Finanzprodukten und Repo-Geschäften im Rahmen eines strikten Risiko- und Liquiditätsmonitoring

Diese Unterlagen wurden ausschließlich zu Informationszwecken erstellt. Sie stellen kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder Finanzinstrumenten, kein Angebot zum Kauf oder Verkauf oder zur Zeichnung von Finanzinstrumenten dar, und es handelt sich hierbei nicht um ein Marketingangebot zur Beteiligung an Anlagestrategien oder ein Angebot von Finanzdienstleistungen. Derartige Angebote oder Aufforderungen erfolgen ausschließlich nach Maßgabe des Verkaufs- oder Emissionsprospekts. Dieses Produkt kann Einschränkungen im Hinblick auf bestimmte Personen oder in bestimmten Ländern im Rahmen von für diese Personen oder Länder geltenden nationalen Vorschriften unterworfen sein. Lyxor Asset Management und seine Tochtergesellschaften können nicht für finanzielle oder andere Konsequenzen zur Verantwortung gezogen werden, die möglicherweise aus der Anlage in dieses Produkt entstehen. Die Informationen in diesem Dokument basieren auf Marktdaten eines bestimmten Zeitpunkts und können sich von Zeit zu Zeit ändern. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.

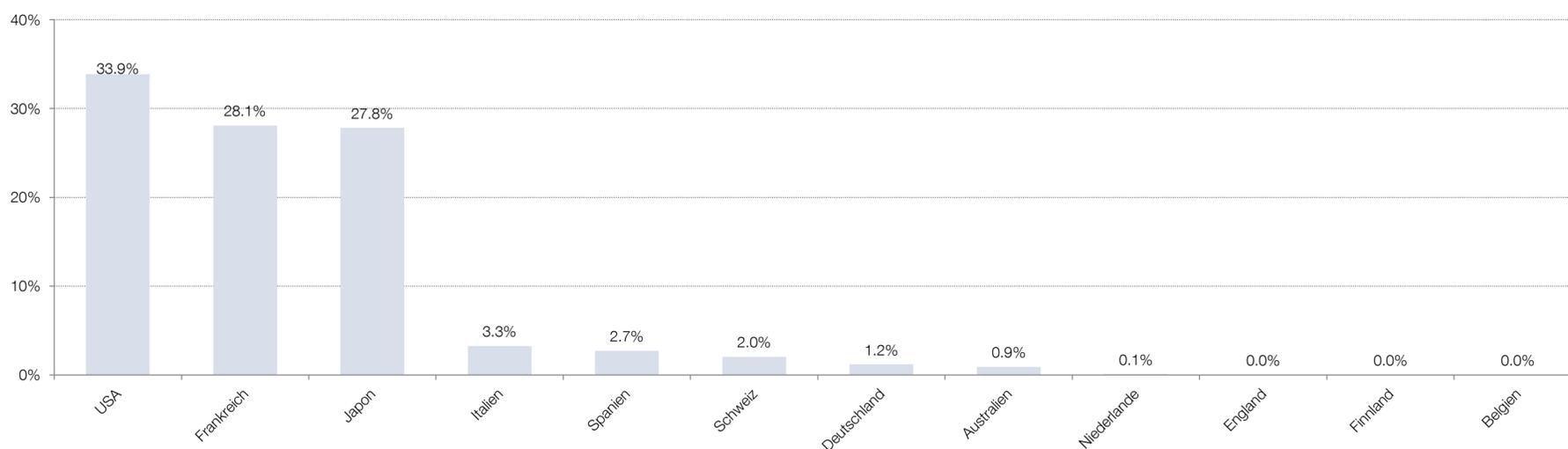
LYXOR OVERNIGHT RETURN - UCITS ETF - C - GBP

ANALYSE DES ALS GARANTIE HINTERLEGTEN WERTPAPIERKORBES

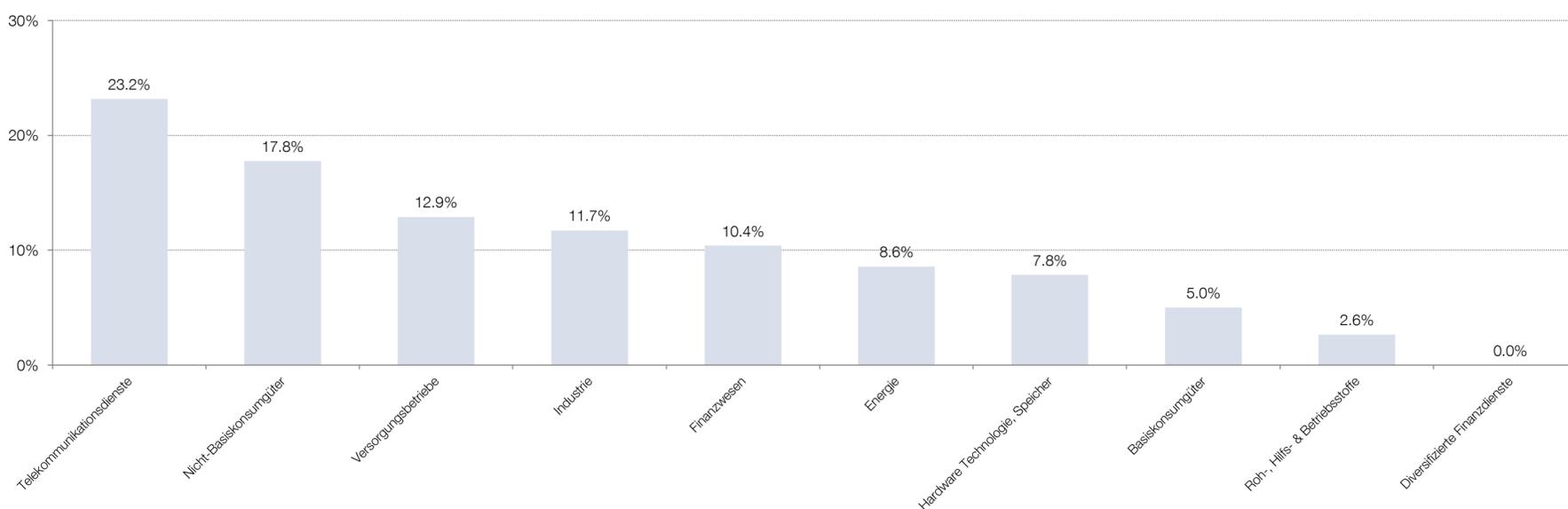
AUFSCHLÜSSELUNG NACH ANLAGEKATEGORIEN



GEOGRAPHISCHE AUFSCHLÜSSELUNG DER WERTPAPIERE



AUFSCHLÜSSELUNG DER WERTPAPIERE NACH SEKTOREN



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.