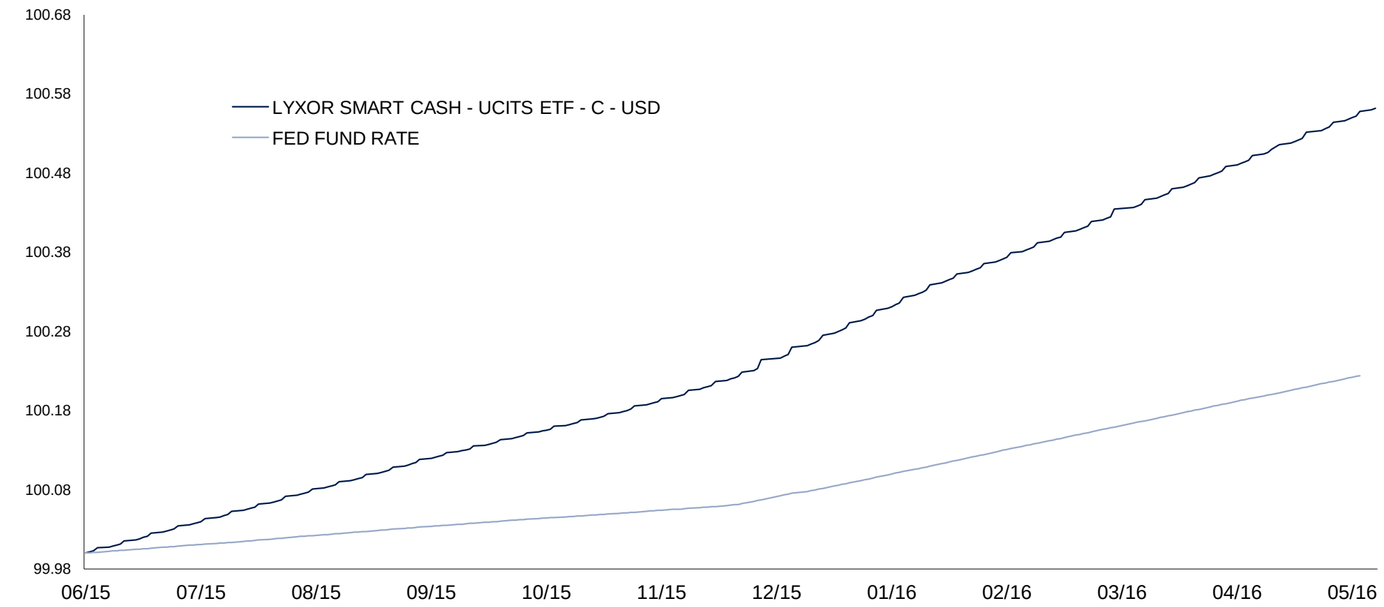
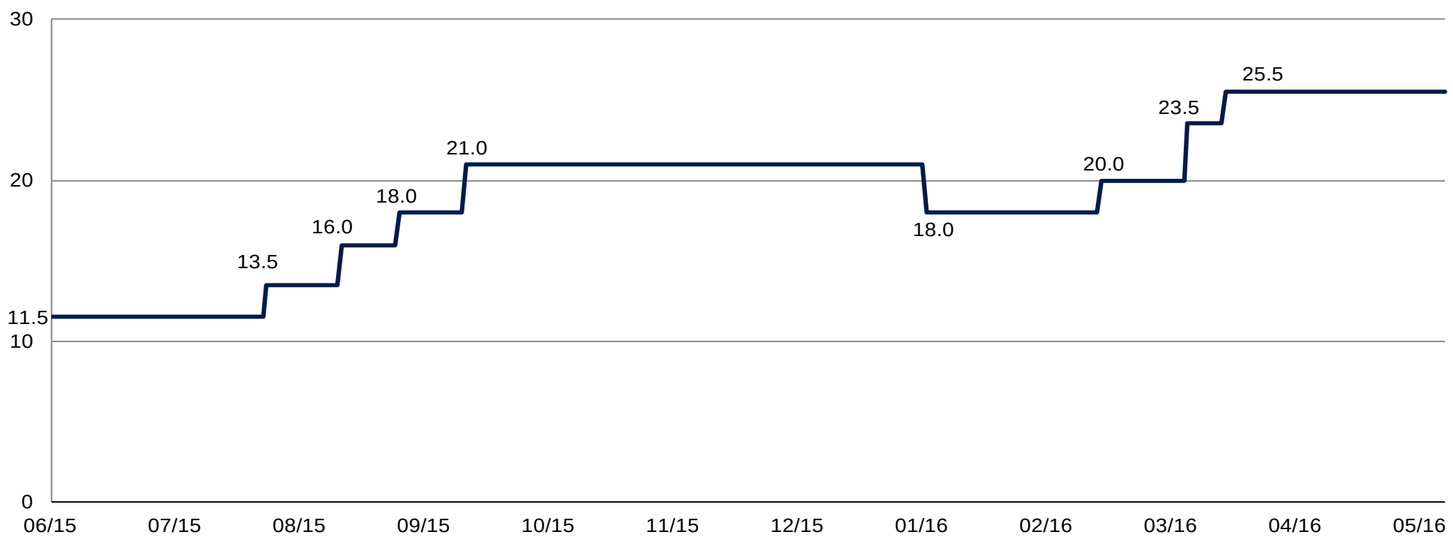
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - USD

Ticker : SMTC LN

PERFORMANCE NETTE DEPUIS LE LANCEMENT



PRIME ANNUALISEE NETTE VS FED FUND RATE (bps)



PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT

	MTD	3 mois	6 mois	YTD	1 an	3 ans	Depuis le lancement
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - USD	0.0594%	0.1802%	0.3648%	-	-	-	**0.5618%**
FED FUND RATE	0.0282%	0.0890%	0.1690%	-	-	-	**0.2240%**

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

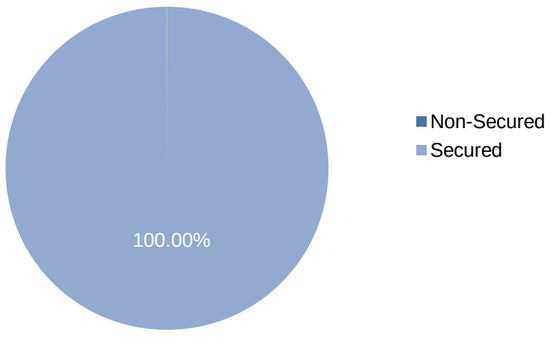
MONTHLY PERFORMANCES

	Jan	Fév	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	Annuel
2016	0.0630%	0.0578%	0.0595%	0.0613%	0.0594%								0.3012%
2015							0.0432%	0.0389%	0.0398%	0.0380%	0.0363%	0.0634%	0.2598%

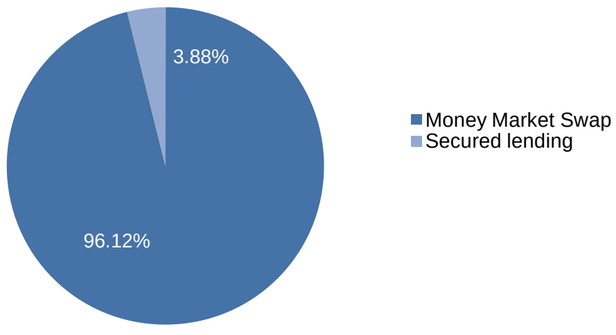
Les performances passées ne sauraient présager des performances futures.
Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

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
Anheuser-Busch Inbev Nv	4.57%	BE	Consommation Discrétionnaire	Actions
Novartis-Registered	4.51%	CH	Consommation Discrétionnaire	Actions
Softbank Corp	4.47%	JP	Communications	Actions
Geberit AG	4.36%	CH	Industries	Actions
Zurich Insurance Group Ag	4.34%	CH	Sociétés financières	Actions
Banco Santander SA	4.19%	ES	Sociétés financières	Actions
ENAGAS	4.18%	ES	Services aux collectivités	Actions
Fast Retailing Co Ltd	3.98%	JP	Biens de Consommation de Base	Actions
ORANGE SA	4.15%	FR	Communications	Actions
Roche Holding Ag	3.14%	CH	Consommation Discrétionnaire	Actions
SONIC HEALTHCARE	2.91%	AU	Consommation Discrétionnaire	Actions

Nombre total d'actions utilisées comme garanties **91**

INFORMATIONS SUR LE FONDS

Code Bloomberg	**SMTC LN**
Structure du Fonds	**SICAV**
Domiciliation	**Luxembourg**
Conformité UCITS IV	**Oui**
Code ISIN :	**LU1248511575**
Méthode de Réplication	**Indirect (Swap**
Prêts de titres	**Non**
Pleine propriété des actifs	**Oui**
Devise de la part	**USD**
Date de création de la part	**2 Mars 2015**
VL de Lancement (USD)	**1 000**
TFE (frais / an)	**0.155%**
Risque de change	**Non**
Valeur liquidative (USD)	**1,005.6178**
Actif net (M USD)	**68.7440**
Actif Net du Fonds (M EUR)	**581.70**
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	**FED FUND RATE**
Exposition	**Fed Fund**
Classe d'actifs	**Marché Monétaire**
Type de l'indice	**-**
Devise	**USD**
Code Reuters de l'indice	**-**
Code Bloomberg de l'indice	**-**
Informations complémentaires	www.mtsindices.com

CHIFFRES CLÉS

Actif Net du Fonds (M EUR):	**581.7000**
Valeur liquidative (USD) :	**1,005.6178**
Performance Annualisée	**--**
Volatilité Annualisée	**--**

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

Exposition à la contrepartie*	Effective	**-6.11%**
	Cible	**0.00%**
Expected Loss (Perte Attendue)**	Effective	**0.016%**
	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 FED FUND Rate.

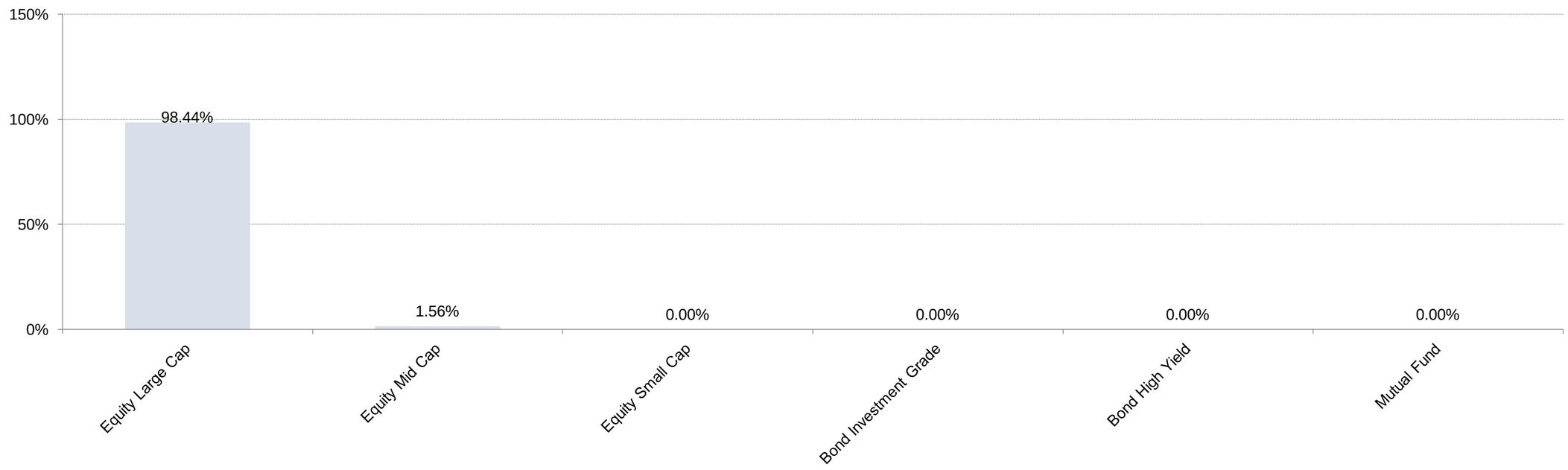
Le fonds est géré de façon active et investit dans un portefeuille diversifié d'instruments financiers et de pensions livrées, avec une surveillance stricte du risque et de la liquidité du portefeuille.

CE DOCUMENT EST DESTINÉ À L'USAGE EXCLUSIF D'INVESTISSEURS AGISSANT POUR LEUR PROPRE COMPTE ET CATÉGORISÉS COMME « CONTREPARTIES ÉLIGIBLES » OU « CLIENTS PROFESSIONNELS » SELON LA DEFINITION DES MARCHES DE LA DIRECTIVE 2004/39/CE RELATIVE AUX INSTRUMENTS FINANCIERS.
Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Lyxor Asset Management Luxembourg ou Lyxor Asset Management déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché.

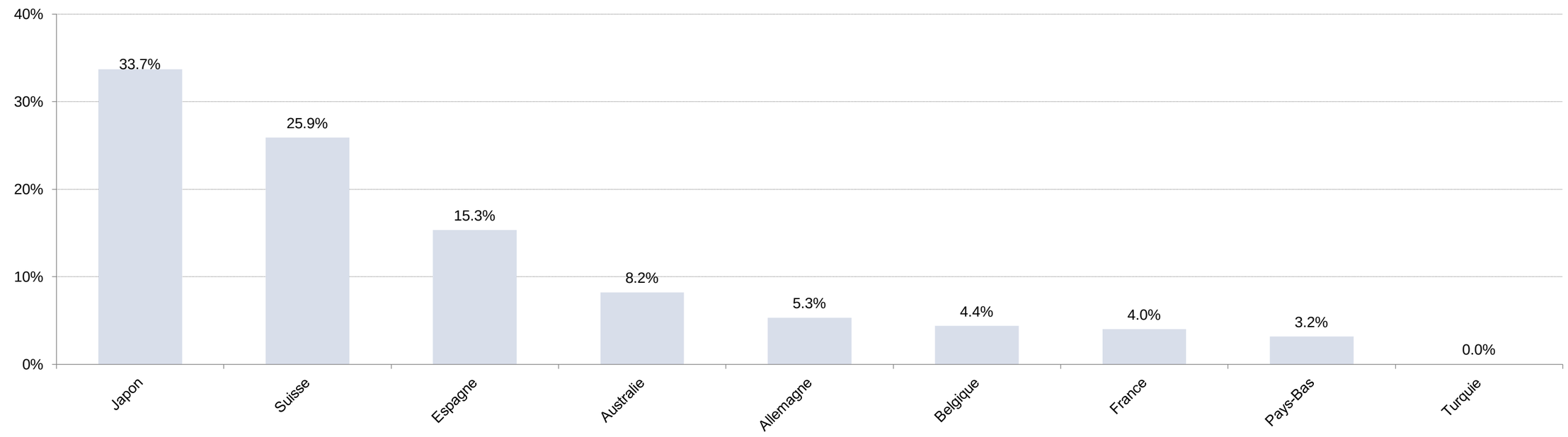
LYXOR SMART CASH - UCITS ETF - C - USD

ANALYSE DU PANIER D'ACTIONS UTILISEES COMME GARANTIES

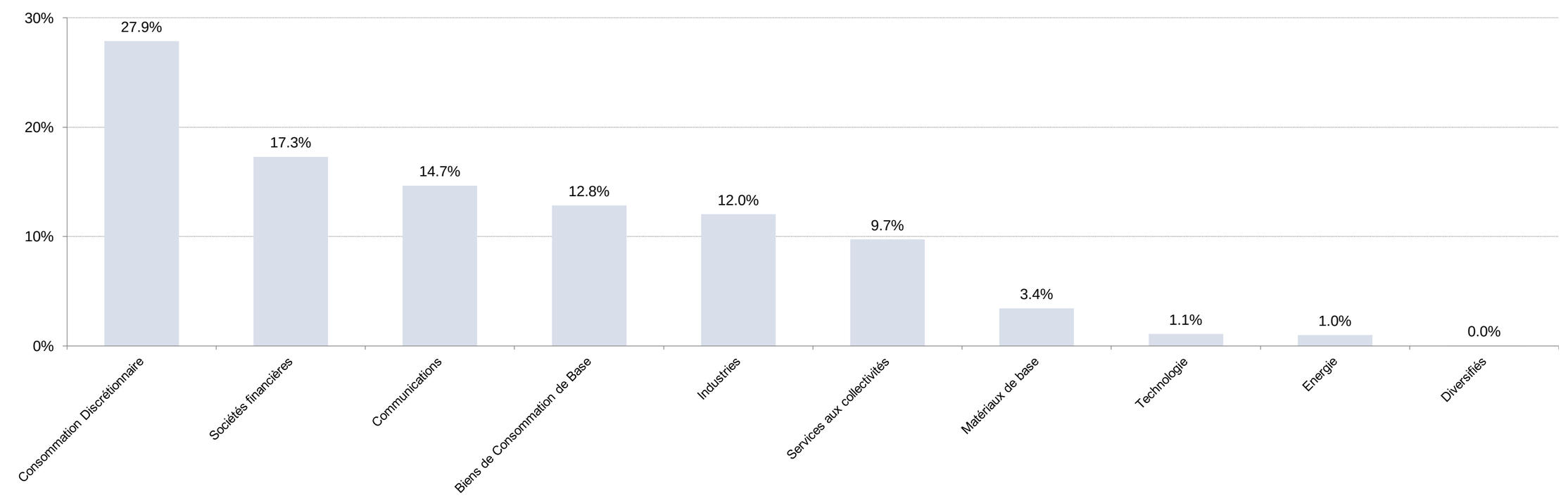
ALLOCATION CATÉGORIELLE DES TITRES



ALLOCATION GEOGRAPHIQUE DES TITRES



ALLOCATION SECTORIELLE DES TITRES



CE DOCUMENT EST DESTINÉ À L'USAGE EXCLUSIF D'INVESTISSEURS AGISSANT POUR LEUR PROPRE COMPTE ET CATÉGORISÉS COMME « CONTREPARTIES ÉLIGIBLES » OU « CLIENTS PROFESSIONNELS » SELON LA DÉFINITION DES MARCHÉS DE LA DIRECTIVE 2004/39/CE RELATIVE AUX INSTRUMENTS FINANCIERS.

Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Lyxor Asset Management Luxembourg ou Lyxor Asset Management déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché.