

Lyxor Portfolio Strategy

Ein richtlinienkonformes
Sondervermögen deutschen Rechts.

Ungeprüfter Halbjahresbericht
zum 31. März 2022



Es können keine Anteile auf der Basis von Finanzberichten gezeichnet werden. Anteilszeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis des Verkaufsprospektes und den wesentlichen Anlegerinformationen mit dem letzten erhältlichen Jahresbericht und dem eventuell danach veröffentlichten Halbjahresbericht vorgenommen werden.

Inhaltsverzeichnis:

Lyxor Portfolio Strategy UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022.....	1
Vermögensaufstellung zum 31. März 2022.....	2
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV.....	4

Lyxor Portfolio Strategy Defensive UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022.....	5
Vermögensaufstellung zum 31. März 2022.....	6
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV.....	8

Lyxor Portfolio Strategy Offensive UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022.....	9
Vermögensaufstellung zum 31. März 2022.....	10
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV.....	12

Lyxor Portfolio Strategy UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonder- mögens
I. Vermögensgegenstände		165.184.566,19	100,21
1. Investmentanteile		164.862.954,53	100,01
- Deutschland	15.966.410,88		9,69
- Irland	15.678.783,21		9,51
- Luxemburg	133.217.760,44		80,82
2. Bankguthaben		321.611,66	0,20
II. Verbindlichkeiten		-345.391,34	-0,21
III. Wert des Teilsondervermögens		164.839.174,85	100,00 ¹⁾

Lyxor Portfolio Strategy UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
LU0419741177	Lyxor BBG Commo. ex Agric. ETF		ANT	103.334	15.923	43.212	EUR 159,044	16.434.673,36	9,97
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF		ANT	70.848	17.156	0	EUR 121,975	8.641.698,97	5,24
LU2329745918	Lyxor Core Euro Government Bond (DR) UCITS ETF		ANT	101.415	22.635	0	EUR 156,431	15.864.480,29	9,62
LU1033693638	Lyxor MDAX (DR) UCITS ETF		ANT	303.984	66.774	0	EUR 27,615	8.394.366,17	5,09
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF		ANT	350.833	74.639	0	EUR 45,445	15.943.675,85	9,67
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF		ANT	221.986	27.199	24.485	EUR 114,713	25.464.613,42	15,45
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF		ANT	278.833	48.533	0	EUR 59,880	16.696.631,57	10,13
LU0378434582	Lyxor STOXX Europe 600 ETF		ANT	274.345	39.571	0	EUR 93,961	25.777.620,81	15,64
Summe Gruppeneigene Investmentanteile							EUR	133.217.760,44	80,82
Gruppenfremde Investmentanteile									
IE00B1FZS798	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF		ANT	88.849	12.871	0	EUR 176,466	15.678.783,21	9,51
DE0002635265	iShar.Pfandbriefe UCITS ETF DE		ANT	159.936	34.528	0	EUR 99,830	15.966.410,88	9,69
Summe Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	31.645.194,09	19,20
Summe Wertpapiervermögen							EUR	164.862.954,53	100,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:							EUR	321.611,66	0,20
Verwahrstelle			EUR	321.611,66		% 100,000		321.611,66	0,20
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-345.391,34	-0,21
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen			EUR	-246.549,60				-246.549,60	-0,15
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-98.841,74				-98.841,74	-0,06
Wert des Teilsondervermögens							EUR	164.839.174,85	100,00¹⁾
Anteilwert							EUR	151,63	
Umlaufende Anteile							STK	1.087.100	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte:

Kurse per 31.03.2022

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 31.03.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Erträge aus Investmentanteilen		218.713,44	0,201
Summe der Erträge		218.713,44	0,201
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-204.322,21	-0,188
2. Sonstige Aufwendungen		-2.146,01	-0,002
davon: Negative Einlagenzinsen	-2.146,01		-0,002
Summe der Aufwendungen		-206.468,22	-0,190
III. Ordentlicher Nettoertrag		12.245,22	0,011
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		4.763.469,84	4,382
2. Realisierte Verluste		0,00	0,000
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		4.763.469,84	4,382
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		4.775.715,06	4,393
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.600.527,76	1,472
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-1.624.765,84	-1,495
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-24.238,08	-0,022
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.751.476,98	4,371

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Entwicklung des Teilsondervermögens

	EUR	2021 / 2022 EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		143.324.658,73
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.386.840,00
2. Mittelzufluss (netto)		18.197.192,04
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	18.197.192,04	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-47.312,90
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.751.476,98
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	1.600.527,76	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-1.624.765,84	
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		164.839.174,85

Lyxor Portfolio Strategy UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor Portfolio Strategy UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF7011
Anteilwert	EUR	151,63
Umlaufende Anteile	STK	1.087.100
Anleger		Private und institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	3,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	3,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,25
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

100,01

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	EUR	2.014,03
-------------------------	-----	----------

Das Teilsondervermögen hat im Geschäftsjahr folgende Investmentanteile mit ihren entsprechenden Verwaltungsvergütungen gehalten:

DE0002635265	iShar.Pfandbriefe UCITS ETF DE	0,10%
IE00B1FZS798	iShares \$ Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF	0,07%
LU0419741177	Lyxor BBG Commo. ex Agric. ETF	0,30%
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF	0,08%
LU2329745918	Lyxor Core Euro Government Bond (DR) UCITS ETF	0,07%
LU1033693638	Lyxor MDAX (DR) UCITS ETF	0,30%
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF	0,14%
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF	0,25%
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF	0,45%
LU0378434582	Lyxor STOXX Europe 600 ETF	0,20%

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

Lyxor Portfolio Strategy Defensive UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonder - vermögens
I. Vermögensgegenstände		26.043.510,50	100,06
1. Anleihen		2.591.862,63	9,96
- Deutschland	2.591.862,63		9,96
2. Investmentanteile		23.428.421,69	90,01
- Deutschland	3.593.767,04		13,81
- Frankreich	2.580.757,99		9,92
- Luxemburg	17.253.896,66		66,29
3. Bankguthaben		23.226,18	0,09
II. Verbindlichkeiten		-15.820,37	-0,06
III. Fondsvermögen		26.027.690,13	100,00 ¹⁾

Lyxor Portfolio Strategy Defensive UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Zertifikate									
Inland									
DE000EWG0LD1	Boerse Stuttgart Securities - Zertifikate		STK	5.655	5.655	0	EUR 56,210	317.867,55	1,22
DE000A0S9GB0	Deut. Börse Commodities GmbH - Zertifikate		STK	40.362	40.362	17.066	EUR 56,340	2.273.995,08	8,74
							EUR	2.591.862,63	9,96
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
DE000ETF9603	Lyxor 1 STOXX Europe 600 UCITS ETF		ANT	58.655	58.655	10.264	EUR 46,348	2.718.518,48	10,44
DE000ETF9074	Lyxor 1-Lyxor 1 MDAX UCITS ETF		ANT	6.524	6.524	906	EUR 163,102	1.064.074,84	4,09
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF		ANT	8.980	8.980	1.210	EUR 121,975	1.095.337,30	4,21
LU2329745918	Lyxor Core Euro Government Bond (DR) UCITS ETF		ANT	16.068	16.068	2.221	EUR 156,431	2.513.538,13	9,66
LU2082999306	Lyxor IF-Lyx.Sma.Overn.Return		ANT	26.160	26.160	3.772	EUR 99,445	2.601.475,97	10,00
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF		ANT	33.351	33.351	4.671	EUR 45,445	1.515.642,87	5,82
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF		ANT	23.447	23.447	8.109	EUR 114,713	2.689.668,68	10,33
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF		ANT	26.506	26.506	3.894	EUR 59,880	1.587.189,88	6,10
LU1650487926	MUL-LYX.EO Gov.Bd 1-3Y(DR)U.E.		ANT	20.948	20.948	2.935	EUR 123,198	2.580.757,99	9,92
	Summe Gruppeneigene Investmentanteile						EUR	18.366.204,14	70,56
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
DE0002635265	iShar.Pfandbriefe UCITS ETF DE		ANT	25.340	25.340	4.847	EUR 99,830	2.529.692,20	9,72
LU0321463506	Xtr.II iBoxx Ger.Cov.Bd Swap		ANT	13.370	13.370	1.661	EUR 189,419	2.532.525,35	9,73
	Summe Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	5.062.217,55	19,45
	Summe Wertpapiervermögen						EUR	26.020.284,32	99,97
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
	EUR-Guthaben bei:						EUR	23.226,18	0,09
	Verwahrstelle		EUR	23.226,18		%	100,000	23.226,18	0,09
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-15.820,37			EUR	-15.820,37	-0,06
	Fondsvermögen						EUR	26.027.690,13	100,00¹⁾
	Anteilwert						EUR	117,66	
	Umlaufende Anteile						STK	221.220	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte:

Kurse per 31.03.2022

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 31.03.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Erträge aus Investmentanteilen		29.293,95	0,132
Summe der Erträge		29.293,95	0,132
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-32.944,59	-0,149
2. Sonstige Aufwendungen		-374,62	-0,002
davon: Verwahrtgelt	-374,62		-0,002
Summe der Aufwendungen		-33.319,21	-0,151
III. Ordentlicher Nettoertrag		-4.025,26	-0,018
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		505.551,60	2,285
2. Realisierte Verluste		-54.626,47	-0,247
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		450.925,13	2,038
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		446.899,87	2,020
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-55.428,76	-0,251
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-492.648,68	-2,227
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-548.077,44	-2,478
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-101.177,57	-0,457

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Entwicklung des Teilsondervermögens

	EUR	2021 / 2022 EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		25.647.333,64
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-180.062,40
2. Mittelzufluss (netto)		693.507,50
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	4.585.587,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-3.892.080,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-31.911,04
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		-101.177,57
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-55.428,76	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-492.648,68	
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		26.027.690,13

Lyxor Portfolio Strategy Defensive UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor Portfolio Strategy Defensive UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

		DE000ETF7029
Anteilwert	EUR	117,66
Umlaufende Anteile	STK	221.220
Anleger		Private und institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	3,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	3,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,25
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		99,97
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	EUR	350,36
-------------------------	-----	--------

Das Teilsondervermögen hat im Geschäftsjahr folgende Investmentanteile mit ihren entsprechenden Verwaltungsvergütungen gehalten:

DE0002635265	iShar.Pfandbriefe UCITS ETF DE	0,10%
DE000ETF9603	Ly. I-Ly. I STOXX Europ.600 U.E.	0,19%
DE000ETF9074	Lyxor I-Lyxor I MDAX UCITS ETF	0,30%
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF	0,08%
LU2329745918	Lyxor Core Euro Government Bond (DR) UCITS ETF	0,07%
LU2082999306	Lyxor IF-Lyx.Sma.Overn.Return	0,05%
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF	0,14%
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF	0,25%
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF	0,45%
LU1650487926	MUL-LYX.EO Gov.Bd 1-3Y(DR)U.E.	0,17%
LU0321463506	Xtr.II iBoxx Ger.Cov.Bd Swap	0,15%

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

Lyxor Portfolio Strategy Offensive UCITS ETF

Vermögensübersicht zum 31. März 2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonder- vermöge
I. Vermögensgegenstände		16.744.152,59	100,06
1. Investmentanteile		16.710.248,17	99,85
- Deutschland	2.371.561,47		14,17
- Luxemburg	14.338.686,70		85,68
2. Bankguthaben		33.904,42	0,20
II. Verbindlichkeiten		-9.450,59	-0,06
III. Wert des Teilsondervermögens		16.734.702,00	100,00 ¹⁾

Lyxor Portfolio Strategy Offensive UCITS ETF

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF		ANT	33.326	33.326	0	EUR 59,880	1.995.574,21	11,92
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF		ANT	45.425	45.425	0	EUR 45,445	2.064.348,21	12,34
LU0419741177	Lyxor BBG Commo. ex Agric. ETF		ANT	10.292	10.292	3.982	EUR 159,044	1.636.882,91	9,78
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF		ANT	14.739	14.739	1.507	EUR 114,713	1.690.750,49	10,10
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF		ANT	8.467	8.467	0	EUR 121,975	1.032.764,02	6,17
DE000ETF9058	Lyxor 1-Lyxor 1 SDAX UCITS ETF		ANT	10.474	10.474	0	EUR 65,096	681.812,36	4,07
DE000ETF9074	Lyxor 1-Lyxor 1 MDAX UCITS ETF		ANT	6.152	6.152	0	EUR 163,102	1.003.401,04	6,00
DE000ETF9082	Lyxor 1-Lyxor 1 TecDAX UCLETF		ANT	26.981	26.981	0	EUR 25,438	686.348,07	4,10
DE000ETF9603	Lyxor 1 STOXX Europe 600 UCITS ETF		ANT	55.310	55.310	0	EUR 46,348	2.563.485,76	15,32
LU2197908721	M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF		ANT	12.254	12.254	1.352	EUR 140,371	1.720.108,68	10,28
Summe Gruppeneigene Investmentanteile							EUR	15.075.475,75	90,09
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
LU1109942653	Xtr.II EUR H.Yield Corp.Bond		ANT	101.562	101.562	0	EUR 16,096	1.634.772,42	9,77
Summe Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	1.634.772,42	9,77
Summe Wertpapiervermögen							EUR	16.710.248,17	99,85
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:							EUR	33.904,42	0,20
Verwahrstelle			EUR	33.904,42			% 100,000	33.904,42	0,20
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-9.450,59				-9.450,59	-0,06
Wert des Teilsondervermögens							EUR	16.734.702,00	100,00¹⁾
Anteilwert							EUR	140,75	
Umlaufende Anteile							STK	118.900	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte:

Kurse per 31.03.2022

Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich
für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 31.03.2022

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
1. Erträge aus Investmentanteilen		33.015,50	0,278
Summe der Erträge		33.015,50	0,278
II. Aufwendungen			
1. Verwaltungsvergütung		-20.780,29	-0,175
2. Sonstige Aufwendungen		-365,52	-0,003
davon: Negative Einlagenzinsen	-365,52		-0,003
Summe der Aufwendungen		-21.145,81	-0,178
III. Ordentlicher Nettoertrag		11.869,69	0,100
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		477.111,10	4,013
2. Realisierte Verluste		0,00	0,000
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		477.111,10	4,013
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		488.980,79	4,113
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		32.819,48	0,276
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-111.516,90	-0,938
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-78.697,42	-0,662
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		410.283,37	3,451

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

Entwicklung des Teilsondervermögens

	EUR	2021 / 2022 EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		12.151.876,36
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-156.585,00
2. Mittelzufluss (netto)		4.370.830,65
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	4.370.830,65	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-41.703,38
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		410.283,37
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	32.819,48	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-111.516,90	
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		16.734.702,00

Lyxor Portfolio Strategy Offensive UCITS ETF

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivatengeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

Lyxor Portfolio Strategy Offensive UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

	EUR	DE000ETF7037
Anteilwert	140,75	
Umlaufende Anteile	STK	118.900
Anleger		Private und institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	3,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	3,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,25
Ertragsverwendung		ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)		99,85
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 31.03.2022 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Negative Einlagenzinsen	EUR	312,78
-------------------------	-----	--------

Das Teilsondervermögen hat im Geschäftsjahr folgende Investmentanteile mit ihren entsprechenden Verwaltungsvergütungen gehalten:

DE000ETF9603	Lyxor 1 STOXX Europe 600 UCITS ETF	0,19%
DE000ETF9074	Lyxor 1-Lyxor 1 MDAX UCITS ETF	0,30%
DE000ETF9058	Lyxor 1-Lyxor 1 SDAX UCITS ETF	0,70%
DE000ETF9082	Lyxor 1-Lyxor 1 TecDAX UCLETF	0,40%
LU0419741177	Lyxor BBG Commo. ex Agric. ETF	0,30%
LU0378438732	Lyxor Core DAX (DR) UCITS ETF	0,08%
LU0635178014	Lyxor MSCI Emerg.Mkts U.ETF	0,14%
LU0392494992	Lyxor MSCI North America ETF	0,25%
LU0392495023	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF	0,45%
LU2197908721	M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF	0,22%
LU1109942653	Xtr.II EUR H.Yield Corp.Bond	0,20%

Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.