Lyxor (vormals ComStage)

Société d'Investissement à Capital Variable

R.C.S. Luxembourg N° B 140.772

Geprüfter Jahresbericht zum 30. Juni 2021

Ungeprüfter Auszug aus dem geprüften Jahresbericht zum 30. Juni 2021 für Anleger in der Schweiz, ergänzt um ungeprüfte zusätzliche Informationen für Anleger in der Schweiz

LYXOR
Asset Management
GROUPE SOCIETE GENERALE

Es können keine Anteile auf der Basis von Finanzberichten gezeichnet werden. Anteilzeichnungen 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

Management und Verwaltung 7

Bericht des Verwaltungsrats 9

Prüfungsvermerk 11

Statistische Angaben 14

Konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 19

Konsolidierte Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr / den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 19

Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF*

- Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 20
- Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 20
- Veränderung der Anzahl der Anteile 20
- Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 21
- Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 22

Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF*

- Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 23
- Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 23
- Veränderung der Anzahl der Anteile 23
- Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 24
- Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 25

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF*

- Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 26
- Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 26
- Veränderung der Anzahl der Anteile 26
- Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 27
- Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 27
- Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 28

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF*

- Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 29
- Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 29
- Veränderung der Anzahl der Anteile 29
- Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 30
- Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 30
- Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 31

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF*

- Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 32
- Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 32
- Veränderung der Anzahl der Anteile 32
- Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 33
- Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 33
- Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 34

Inhaltsverzeichnis

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 35

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 35

Veränderung der Anzahl der Anteile 35

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 36

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 36

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 37

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 38

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 38

Veränderung der Anzahl der Anteile 38

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 39

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 40

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 41

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 42

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 42

Veränderung der Anzahl der Anteile 42

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 43

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 43

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 44

Lyxor MSCI North America UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 45

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 45

Veränderung der Anzahl der Anteile 45

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 46

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 46

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 47

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 48

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 48

Veränderung der Anzahl der Anteile 48

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 49

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 49

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 50

Inhaltsverzeichnis

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 51

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 51

Veränderung der Anzahl der Anteile 51

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 52

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 52

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 53

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 54

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 54

Veränderung der Anzahl der Anteile 54

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 55

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 55

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 56

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 57

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 57

Veränderung der Anzahl der Anteile 57

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 58

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 58

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 59

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 60

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 60

Veränderung der Anzahl der Anteile 60

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 61

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 61

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 62

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 63

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 63

Veränderung der Anzahl der Anteile 63

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 64

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 64

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 65

Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 66

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 66

Veränderung der Anzahl der Anteile 66

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 67

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 68

Inhaltsverzeichnis

Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 69

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 69

Veränderung der Anzahl der Anteile 69

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 70

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 71

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 72

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 72

Veränderung der Anzahl der Anteile 72

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 73

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 73

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 74

Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 75

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 75

Veränderung der Anzahl der Anteile 75

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 76

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 77

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 78

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 78

Veränderung der Anzahl der Anteile 78

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 79

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 79

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 80

Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 81

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 81

Veränderung der Anzahl der Anteile 81

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 82

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 83

Lyxor SPI® UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 84

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 84

Veränderung der Anzahl der Anteile 84

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 85

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 85

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 86

Inhaltsverzeichnis

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 87

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 87

Veränderung der Anzahl der Anteile 87

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 88

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 88

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 89

Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 90

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 90

Veränderung der Anzahl der Anteile 90

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 91

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 92

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 93

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 93

Veränderung der Anzahl der Anteile 93

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 94

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 94

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 95

Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 96

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 96

Veränderung der Anzahl der Anteile 96

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 97

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 98

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF*

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021 99

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021 99

Veränderung der Anzahl der Anteile 99

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021 100

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021 100

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands 101

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 102

Informationen für Anleger in der Schweiz zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) 111

Wertentwicklung zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) 112

Tracking Error zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) 113

Vergütungspolitik (ungeprüft) 114

Inhaltsverzeichnis

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) 115

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Management und Verwaltung

Gesellschaftssitz

ComStage, ab dem 11. November 2020 umbennant in Lyxor
22, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat der Gesellschaft

Arnaud Llinas, Vorsitzender des Verwaltungsrats
Lyxor International Asset Management S.A.S., Tours Société Générale, 17 Cours Valmy, F-92967 Paris La Défense, Frankreich

Alexandre Cegarra
Société Générale Private Wealth Management S.A., 11 Avenue Emile Reuter, L-2420 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Thomas Meyer zu Drewer
Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland, Neue Mainzer Straße 46-50, D-60311 Frankfurt am Main, Deutschland

Mathias Turra
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft

Lyxor Funds Solutions S.A.
22, Boulevard Royal
L-2449 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Lionel Paquin, Vorsitzender des Verwaltungsrats (bis zum 3. Februar 2021)
Lyxor International Asset Management S.A.S., Tours Société Générale, 17 Cours Valmy, F-92967 Paris La Défense, Frankreich

Edouard Auché, Vorsitzender des Verwaltungsrats (seit dem 3. Februar 2021)
Lyxor International Asset Management S.A.S., Tours Société Générale, 17 Cours Valmy, F-92967 Paris La Défense, Frankreich

Guillaume de Martel, Direktor (bis zum 3. Februar 2021)
Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland, Neue Mainzer Straße 46-50, D-60311 Frankfurt am Main, Deutschland (bis zum 5. Oktober 2020)
SG 29 Haussmann, 29, Boulevard Haussmann CS 614, F-75421 Paris Cedex 09, Frankreich (seit dem 5. Oktober 2020)

Heike Fürpaß-Peter, Direktorin (seit dem 3. Februar 2021)
Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland, Neue Mainzer Straße 46-50, D-60311 Frankfurt am Main, Deutschland

Alexandre Cegarra, Direktor
Société Générale Private Wealth Management S.A., 11 Avenue Emile Reuter, L-2420 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Mathias Turra, Direktor
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Geschäftsführung

Mathias Turra
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Martine Capus
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Martin Rausch
Lyxor Funds Solutions S.A., 22, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter der Teilfonds
Der oder die Anlageverwalter eines Teilfonds sind im jeweiligen Anhang des Verkaufsprospektes benannt.

Management und Verwaltung (Fortsetzung)

Verwahr- und Zahlstelle

BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg
60, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Register- und Transferstelle der Gesellschaft

BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg
60, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsstelle

BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg
60, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft

Ernst & Young, Société anonyme
35E, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Market Maker und Rückkaufgesellschaft

Société Générale S.A.
29, boulevard Haussmann
F-75008 Paris
Frankreich

Vertriebsstellen

Lyxor Asset Management S.A.S. sowie Lyxor International Asset Management S.A.S. beide mit Sitz in

Tours Société Générale
17 Cours Valmy
F-92967 Paris La Défense
Frankreich

und ihre Zweigniederlassungen sowie in Deutschland

Lyxor International Asset Management S.A.S. Deutschland
Neue Mainzer Straße 46-50
D-60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Bericht des Verwaltungsrats

Das Berichtsjahr des Fonds (1. Juli 2020 bis 30. Juni 2021) war geprägt vom weiteren Verlauf der COVID-19 Pandemie und der Reaktion vieler Regierungen mit entsprechenden Konjunkturprogrammen sowie der US-Präsidentschaftswahl. Die weltweiten Aktienmärkte verzeichneten im Berichtszeitraum einen deutlichen Anstieg. Bereits im September wurden über weite Strecken die Niveaus vor Pandemieausbruch wieder erreicht. Nach der US-Wahl und gemeldeten Erfolgen bei der Impfstoffentwicklung im November konnten die Aktienmärkte ihren Aufwärtstrend weiter fortsetzen.

Wertentwicklung bekannter Aktienindizes

MSCI World Preis-Index (in USD):	37,04%
EuroStoxx 50 Preis-Index (in EUR):	25,67%
Dax 30 Performance-Index (in EUR):	26,16%
Topix Preis-Index (in JPY):	24,69%
S&P 500 Preis-Index (in USD):	38,62%

An den Rohstoffmärkten führten Erwartungen an eine deutliche Erholung der Konjunktur sowie die Ankündigung staatlicher Investitionsprogramme insbesondere nach der US-Wahl zu deutlich steigenden Notierungen für Rohöl und Industriemetalle. Der Goldpreis konsolidierte hingegen und notierte in USD in etwa auf dem Niveau zu Beginn des Berichtszeitraums.

Wertentwicklung wichtiger Rohstoffe in USD

Rohöl (Sorte Brent):	82,04%
Kupfer:	58,34%
Gold:	-1,61%

Der Euro hat im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar an Wert gewonnen (+5,55%), was umgekehrt bedeutet, dass Anlagen in US-Dollar um denselben Prozentsatz an Wert verloren haben. Ebenfalls an Wert gewonnen hat der Euro gegenüber dem japanischen Yen (+8,67%).

Zum 30. Juni 2020 notierte die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen bei -0,45%. Im Verlauf des Betrachtungszeitraums stieg die Rendite dieser langlaufenden Schulden der Bundesrepublik Deutschland um 24 Basispunkte auf -0,21% per 30. Juni 2021.
Im Berichtszeitraum wurde kein neuer Teilfonds aufgelegt.

Risikomanagement

Gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512 über das Risikomanagement von OGAW wird das Gesamtrisiko aller bestehenden Lyxor Teilfonds mit Hilfe des Commitment Approach berechnet, der für Fonds mit weniger, oder weniger komplexen derivativen Finanzinstrumenten, oder mit derivativen Finanzinstrumenten, die nur für Hedging-Zwecke verwendet werden, eingesetzt wird.

COVID-19

Seit dem Jahreswechsel 2019 / 2020 beobachten wir die globalen Entwicklungen der COVID-19-Pandemie. Die Auswirkungen von COVID-19 haben den weltweiten Reiseverkehr und die Lieferketten nachteilig geprägt sowie die globalen Handelsaktivitäten, die Transportindustrie und die Rohstoffpreise im Energiesektor negativ beeinflusst. Aufgrund der raschen Entwicklung und der Unbeständigkeit dieser Situation war eine Vorhersage der endgültigen Auswirkungen nicht möglich. Die Auswirkungen von COVID-19 wurden im Jahr 2020 in verschiedenen Branchen, Sektoren oder Regionen beobachtet und können sich auch in Zukunft auf die operative Performance der Anlageportfolios unserer verwalteten Investmentpläne auswirken. Auch in Zukunft wird der Investmentmanager die Auswirkungen der Pandemie auf die Wirtschaft und die Ertragsaussichten sowie die politischen Maßnahmen der Zentralbanken und der Regierungen genau beobachten.

Lyxor Funds Solutions S.A. verfolgt die laufenden Entwicklungen im Zusammenhang mit der COVID-19-Pandemie genau. Die fortgesetzte Leistungserbringung und Unterstützung unserer verwalteten Investmentfonds bleibt unsere höchste Priorität. Wir haben Maßnahmen getroffen, um sicherzustellen, dass wir unsere Dienstleistungen für die verwalteten Fonds weiterhin erbringen können. So hat Lyxor Funds Solutions S.A. bereits bewährte Business Continuity-Maßnahmen aktiviert, die sicherstellen, dass kritische Prozesse weiterhin aufrechterhalten werden, sodass wir unseren verwalteten Investmentfonds kontinuierliche Dienstleistungen erbringen können. Aus diesem Grund haben wir eine Reihe von Maßnahmen umgesetzt, darunter Heimarbeit und das Arbeiten an getrennten Standorten. Wir arbeiten zudem eng mit unseren Dienstleistern und Service-Providern zusammen, um sicherzustellen, dass auch diese weiter ihre Dienstleistungen erbringen. Zudem haben wir auch alle internationalen Geschäftsreisen eingeschränkt (mit Ausnahme besonderer Umstände aus Gründen der Geschäftskontinuität oder aus regulatorischen Gründen). Wir empfangen keine externen Gäste oder Kunden in unseren Büros. Zudem weisen wir auch unsere Mitarbeiter an, bei jeglichen zwischenmenschlichen Interaktionen einen Sicherheitsabstand zu wahren. Unsere Vorstellung ist es, eine vertrauenswürdige Verwaltungsgesellschaft für die von uns verwalteten Investmentfonds zu sein. Derzeit liefern wir alle Dienstleistungen und erfüllen unsere Qualitätsrichtlinien und werden dies auch fortlaufend tun. Falls Lyxor Funds Solutions S.A. dennoch der Ansicht ist, dass sich unsere Fähigkeit, einen normalen Service anzubieten, ändern könnte, werden wir uns umgehend mit Investoren und Aufsichtsbehörden in Verbindung setzen.

Ungeachtet dessen sollten Anleger, welche in den von der Lyxor Funds Solutions S.A. verwalteten Investmentfonds investiert sind, jedoch Folgendes berücksichtigen: COVID-19, die Ölpreisbewegungen und andere geopolitische Faktoren belasten weiterhin die Finanzmärkte. Obwohl die Impfkampagnen Ende 2020 / Anfang 2021 begonnen haben, besteht immer noch Unsicherheit über das endgültige Ausmaß und die Dauer der COVID-19-Pandemie, was eine Vorhersage der Liquidität deutlich erschwert. Investierte Portfolios können erheblich an Wert verlieren. Liquiditätsprobleme könnten auftreten - diese könnten zum Beispiel dann auftreten, wenn Investmentfonds Bargeld brauchen, um die laufenden Rechnungen zu bezahlen, Margenanforderungen zu erfüllen und Rücknahmeerlöse auszuzahlen - diese Risiken werden höchstwahrscheinlich so lange bestehen, bis die Märkte wieder ohne Auswirkungen von aufkommenden Lock-Downs fungieren. Aufgrund von COVID-19 können sich derzeit noch nicht vorhersehbare Risiken auf verwaltete Investmentfonds auswirken, z.B. könnte es zu erheblichen operativen Herausforderungen oder Bewertungsherausforderungen kommen.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

COVID-19 (Fortsetzung)

Es ist derzeit unvorhersehbar, welche Unternehmen die Auswirkungen von Lock-Downs überstehen werden und ab wann die Wirtschaft wieder ohne COVID-19-Effekte arbeiten kann. Niedriger bewertete und kleinere Unternehmen befinden sich in einer prekären Lage und haben weniger Spielraum, um durch die unsicheren Gewässer zu navigieren. Hieraus können potenzielle negative Markteffekte im ersten und zweiten Geschäftsquartal 2021, aber auch für mehrere Quartale danach entstehen. Aktuelle Risikohinweise, welche in den jeweiligen Verkaufsprospekten der verwalteten Investmentfonds beschrieben werden, warnen möglicherweise nicht ausreichend vor allen möglichen und derzeit nicht vorhersehbaren Folgen von COVID-19 und seinen Marktentwicklungen.

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Luxemburg, den 8. Oktober 2021

Anmerkung: Die Informationen in diesem Bericht beziehen sich auf historische Daten und haben keine Aussagekraft für die künftige Entwicklung des Fonds.

Prüfungsvermerk

An die Aktionäre des Lyxor (vormals ComStage)

Bericht über die Jahresabschlussprüfung

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Lyxor (vormals Comstage) und für jeden seiner Teilfonds (der "Fonds") - bestehend aus der Aufstellung des Nettovermögens, des Wertpapierbestands und der derivativen Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021, der Aufwands- und Ertragsrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Fonds und jeder seiner Teilfonds zum 30. Juni 2021 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjah.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier ("CSSF") angenommenen internationalen Prüfungsstandards ("ISA") durch. Unsere Verantwortung gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt «Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréefür die Jahresabschlussprüfung» weitergehend beschrieben. Wir sind auch unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem für Luxemburg von der CSSF angenommenen „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards", herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants" (IESBA Code), zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben, und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte sind solche Sachverhalte, die nach unserem pflichtgemäßen Ermessen am bedeutsamsten in der Prüfung des Jahresabschlusses für den aktuellen Berichtszeitraum waren. Diese Sachverhalte wurden im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses als Ganzes und bei der Bildung des Prüfungsurteils hierzu berücksichtigt und wir geben kein gesondertes Prüfungsurteil zu diesen Sachverhalten ab.

Bewertung von Finanzinstrumenten - OTC Derivative

Die Teilfonds des Lyxor (vormals ComStage) bilden die Wertentwicklung verschiedener Indices ab. Dies erfolgt durch Investitionen in übertragbare Wertpapiere und durch den Einsatz von OTC-Derivaten (Erläuterung 3).

Der Marktwert der Swaps wird durch Anwendung von Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung bestimmter Annahmen und Marktparameter bestimmt. Zum 30. Juni 2021 verzeichnen die Teilfonds des Lyxor (vormals Comstage) zusammengenommen eine sehr hohe Anzahl und ein hohes Volumen ausstehender Swapverträge, die auf konsolidierter Basis unrealisierte Gewinne in Höhe von EUR 30,72 Mio. und unrealisierte Verluste von EUR 57,52 Mio. generieren. Aufgrund der Vielzahl der Annahmen und Marktparameter sowie der Natur der Bewertungsmodelle, unterliegt die Bewertung dieser Finanzinstrumente einem hohen Schätzungsrisiko und wird daher als besonders wichtiger Prüfungssachverhalt betrachtet.

Wir haben das Kontrollumfeld der zum Einsatz kommenden OTC Derivate (Swaps) einer Prüfung unterzogen, insbesondere hinsichtlich der von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführten unabhängigen Überprüfung der Marktwerte und Bewertungsmodellvalidierung.

Darüberhinaus haben wir unsere Bewertungsspezialisten beauftragt, eine unabhängige Bewertung der Swaps zum 30. Juni 2021 durchzuführen. Im Einzelnen haben die Bewertungsspezialisten folgende Prüfungshandlungen durchgeführt:

- Einschätzung der Angemessenheit der vom Lyxor (vormals Comstage) angewendeten Bewertungsmodelle.
- Unabhängige Bewertung aller (100%) zum Jahresende ausstehenden Swaps.

Wir haben die Ergebnisse der Bewertungsspezialisten mit den Swap-Bewertungen des Fonds verglichen und, soweit vorliegend, die wesentlichen Differenzen abgestimmt bzw. nachvollzogen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des Réviseur d'entreprises agréé zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Prüfungsvermerk (Fortsetzung)

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat des Fonds als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und jeder seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt den Fonds oder einen seiner Teilfonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des Réviseur d'entreprises agréé für die Jahresabschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des Réviseur d'entreprises agréé, welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für das Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.

- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangangaben.

- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Verwaltungsrat des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder einer seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet im Bericht des Réviseur d'entreprises agréé auf die dazugehörigen Anhangangaben zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des Réviseur d'entreprises agréé erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.

- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Anhangangaben und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Wir haben gegenüber den für die Überwachung Verantwortlichen eine Erklärung abgegeben, dass wir die relevanten Unabhängigkeitsanforderungen eingehalten haben und mit ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte erörtert haben, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie unsere Unabhängigkeit bedrohen, und - sofern einschlägig -die hierzu getroffenen Schutzmaßnahmen.

Prüfungsvermerk (Fortsetzung)

Von den Sachverhalten, die mit den für die Überwachung Verantwortlichen erörtert wurden, bestimmen wir diejenigen Sachverhalte, die für die Prüfung des Jahresabschlusses des aktuellen Berichtszeitraums am bedeutsamsten waren, als besonders wichtige Prüfungssachverhalte. Wir beschreiben diese Sachverhalte in unserem Bericht, es sei denn, Gesetze oder andere Rechtsvorschriften schließen die öffentliche Angabe des Sachverhalts aus oder wenn - in extrem seltenen Fällen - wir der Auffassung sind, dass dieser Sachverhalt nicht in unserem Bericht beschrieben werden sollte, da vernünftigerweise angenommen werden kann, dass die negativen Auswirkungen dieser Berichterstattung den erwarteten Nutzen für das öffentliche Interesse übersteigen werden.

Bericht über weitere gesetzliche und aufsichtsrechtliche Verpflichtungen

Wir wurden als Réviseur d'entreprises agréé von der ordentlichen Generalversammlung der Aktionäre am 13. Oktober 2020 bestellt und die ununterbrochene Mandatsdauer, einschließlich vorheriger Verlängerungen und Wiederbestellungen, beträgt drei Jahre.

Wir bestätigen, dass wir keine verbotenen Nichtprüfungsleistungen für Abschlussprüfer gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014 erbracht haben und dass wir unabhängig von dem Fonds bei der Durchführung unserer Prüfung bleiben.

Wir haben die nachfolgend aufgeführten gestatteten Nichtprüfungsleistungen für Abschlussprüfer gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014 erbracht:

- Erstellung des Analytischen Berichts gemäß CSSF-Rundschreiben 2002/81 und 2004/146 für das am 30. Juni 2021 endende Geschäftsjahr

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé

Nicolas Bannier

Luxemburg, den 8. Oktober 2021

Statistische Angaben

		30. Juni 2021	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	964.110.732,73	886.746.240,65	900.362.708,09
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteiklasse I D	EUR	134,11	109,47	113,85
Anzahl der Anteile				
Anteiklasse I D		7.188.700,00	8.100.300,00	7.908.100,00
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	77.046.352,18	58.454.862,22	78.457.238,69
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	39,16	29,83	41,09
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		1.967.500,00	1.959.600,00	1.909.400,00
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	317.080.901,08	251.815.473,31	265.856.174,66
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	93,92	74,85	80,77
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		3.376.078,00	3.364.078,00	3.291.478,00
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	104.745.654,33	79.985.940,27	80.879.296,13
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	404,81	303,38	311,43
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		258.750,00	263.650,00	259.700,00
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	JPY	10.632.557.258,21	5.813.029.956,21	6.131.950.795,31
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	JPY	3.167,00	2.455,55	2.349,14
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		3.357.300,00	2.367.300,00	2.610.300,00
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	1.057.579.384,99	269.347.053,08	371.470.250,30
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	133,58	92,16	102,16
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		7.917.176,00	2.922.595,00	3.636.195,00
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	3.283.576.414,47	2.261.851.630,68	1.999.326.308,90

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Statistische Angaben

		30. Juni 2021	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	85,52	62,42	61,78
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		38.393.228,00	36.235.228,00	32.363.228,00
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	18.704.548,94	11.228.188,55	14.910.509,74
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	77,58	58,76	65,23
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		241.100,00	191.100,00	228.600,00
Lyxor MSCI North America UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	147.919.524,52	117.549.615,67	189.155.250,94
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	122,95	87,55	82,80
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		1.203.125,00	1.342.625,00	2.284.425,00
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	254.704.613,28	163.352.430,23	248.330.121,88
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	70,85	56,78	59,86
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		3.595.000,00	2.877.000,00	4.148.500,00
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	48.354.826,46	53.684.739,90	52.335.592,27
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	117,51	83,75	78,58
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		411.500,00	641.000,00	666.000,00
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	21.105.202,61	16.814.208,75	20.520.061,32
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	286,37	190,10	206,94
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		73.700,00	88.450,00	99.160,00
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	98.136.290,74	60.668.734,02	81.593.795,03
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	68,73	41,79	47,78

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Statistische Angaben

		30. Juni 2021	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		1.427.870,00	1.451.870,00	1.707.870,00
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	27.052.160,20	18.616.529,61	19.222.819,96
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	147,66	104,59	112,09
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		183.200,00	178.000,00	171.500,00
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	79.401.467,47	47.278.314,12	47.357.321,47
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	64,82	43,66	47,61
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		1.224.986,00	1.082.986,00	994.600,00
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	CHF	86.453.552,40	57.680.919,16	55.188.390,47
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	CHF	152,61	121,22	122,72
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		566.500,00	475.850,00	449.700,00
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	429.384.154,41	389.816.619,95	379.008.813,46
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	26,65	29,13	19,28
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		16.110.500,00	13.384.250,00	19.662.500,00
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	345.893.443,97	149.222.062,98	337.952.025,26
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	51,16	51,15	53,27
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		6.761.000,00	2.917.600,00	6.343.900,00
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	73.851.343,51	61.631.248,97	68.311.354,65
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	34,02	27,14	28,98
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		2.171.000,00	2.270.700,00	2.357.250,00

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Statistische Angaben

		30. Juni 2021	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	77.683.335,12	110.834.352,40	281.979.170,87
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	14,84	19,65	21,74
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		5.236.000,00	5.641.000,00	12.970.500,00
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	166.468.903,12	108.963.154,35	105.796.153,56
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	139,60	102,20	103,06
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		1.192.500,00	1.066.150,00	1.026.500,00
Lyxor SPI® UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	CHF	18.315.963,71	16.390.043,91	12.024.716,42
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	CHF	128,99	107,83	107,08
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		142.000,00	152.000,00	112.300,00
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	887.620.539,09	376.073.604,34	370.734.964,67
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	60,78	43,99	46,67
Anteilklasse I Acc**	USD	60,78	-	-
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		14.074.000,00	8.550.000,00	7.944.250,00
Anteilklasse I Acc**		531.000,00	-	-
**Die Anteilklasse „I Acc“ wurde am 3. Dezember 2020 aufgelegt.				
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	89.298.686,42	76.123.022,51	80.619.956,81
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	31,45	25,20	26,83
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		2.839.100,00	3.020.800,00	3.005.200,00
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	USD	42.490.403,28	18.726.186,03	17.952.260,09
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	USD	212,57	153,00	153,58
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		199.890,00	122.390,00	116.890,00

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Statistische Angaben

		30. Juni 2021	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	253.958.369,38	177.105.448,91	175.656.104,98
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	30,59	23,53	23,84
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		8.301.500,00	7.527.600,00	7.367.250,00
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF*				
Nettovermögen je Teilfonds	EUR	40.954.762,99	223.950.285,67	251.588.926,27
Nettoinventarwert je Anteil				
Anteilklasse I D	EUR	78,67	55,49	63,21
Anzahl der Anteile				
Anteilklasse I D		520.600,00	4.036.000,00	3.980.000,00

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Konsolidiert

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		7.116.861.330,66
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	577.688.997,49
Wertpapierbestand zum Marktwert		7.694.550.328,15
Bankguthaben*		401.374.316,23
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.689.227,65
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen		9.394,59
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	30.722.999,40
Dividenden- und Zinsforderungen		313.047,06
Vermögen insgesamt		**8.130.659.313,08**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		26.707,23
Pauschalgebühr	6.2	4.764.479,77
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		119.631,38
Verbindlichkeiten aus dem Rückkauf von Fondsanteilen		1.636.414,71
Verbindlichkeiten aus Swaps		2.161.422,64
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	57.523.081,68
Zinsverbindlichkeiten		1.939,15
Verbindlichkeiten insgesamt		**66.233.676,56**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres / Berichtszeitraums		**8.064.425.636,52**

*Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr / den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		44.065.261,51
Bankzinsen		91.484,73
Sonstige Erträge		1.151.676,45
Erträge insgesamt		**45.308.422,69**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	17.427.258,42
Transaktionskosten	9	160.801,79
Bankzinsen		795.477,81
Aufwendungen aus Swaps		606.294,84
Sonstige Aufwendungen		4.665,03
Aufwendungen insgesamt		**18.994.497,89**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**26.313.924,80**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	1.772.702.018,77
Fremdwährungsgeschäften		(5.950.827,77)
Devisentermingeschäften	2.2	(436.732,00)
Swaps	2.2	(238.750.373,53)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr / den Berichtszeitraum		**1.553.878.010,27**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	313.749.120,71
Devisentermingeschäften	2.2, 11	45.624,31
Swaps	2.2, 7	(20.151.456,65)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**1.847.521.298,64**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		2.277.790.298,41
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(3.419.891.921,80)
Ausschüttungen	10	(108.762.854,51)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres / Berichtszeitraums		7.705.778.780,63
Umrechnungsdifferenz		(238.009.964,85)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres / Berichtszeitraums		**8.064.425.636,52**

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		786.764.152,11
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	177.152.431,72
Wertpapierbestand zum Marktwert		963.916.583,83
Bankguthaben		385.959,55
Vermögen insgesamt		**964.302.543,38**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	191.810,65
Verbindlichkeiten insgesamt		**191.810,65**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**964.110.732,73**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		23.631.887,61
Bankzinsen		0,01
Erträge insgesamt		**23.631.887,62**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	741.886,78
Transaktionskosten	9	22.671,14
Bankzinsen		1.905,53
Aufwendungen insgesamt		**766.463,45**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**22.865.424,17**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	26.235.505,06
Fremdwährungsgeschäften		10.703,19
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**49.111.632,42**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	168.893.698,49
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**218.005.330,91**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		166.107.476,36
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(284.347.135,69)
Ausschüttungen	10	(22.401.179,50)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		886.746.240,65
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**964.110.732,73**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteiklasse I D	8.100.300	1.469.300	(2.380.900)	7.188.700

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
145.578	ADIDAS AG	EUR	45.696.934,20	4,74
330.865	ALLIANZ SE	EUR	69.580.909,50	7,22
737.521	BASF SE	EUR	49.000.895,24	5,08
788.868	BAYER AG	EUR	40.397.930,28	4,19
257.309	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	22.980.266,79	2,38
86.725	CONTINENTAL AG	EUR	10.752.165,50	1,12
155.105	COVESTRO AG	EUR	8.447.018,30	0,88
674.189	DAIMLER AG	EUR	50.766.431,70	5,27
151.217	DELIVERY HERO SE	EUR	16.845.573,80	1,75
1.659.081	DEUTSCHE BANK AG	EUR	18.226.663,87	1,89
147.364	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	21.691.980,80	2,25
788.988	DEUTSCHE POST AG	EUR	45.256.351,68	4,69
2.588.797	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	46.111.652,16	4,78
240.243	DEUTSCHE WOHNEN SE	EUR	12.391.733,94	1,29
1.668.958	E.ON AG	EUR	16.279.016,33	1,69
159.421	FRESENIUS MEDICAL CARE GMBH & CO. KGAA	EUR	11.165.846,84	1,16
330.368	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	14.534.540,16	1,51
118.649	HEIDELBERGCEMENT AG	EUR	8.583.068,66	0,89
140.100	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	12.474.504,00	1,29
1.044.959	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	35.340.513,38	3,67
103.779	MERCK KGAA	EUR	16.781.064,30	1,74
42.835	MTU AERO ENGINES AG	EUR	8.948.231,50	0,93
112.497	MUNICH RE	EUR	25.981.182,15	2,69
542.992	RWE AG	EUR	16.593.835,52	1,72
811.138	SAP AG	EUR	96.395.639,92	9,99
603.564	SIEMENS AG	EUR	80.648.221,68	8,36
378.680	SIEMENS ENERGY AG	EUR	9.626.045,60	1,00
147.001	VOLKSWAGEN AG	EUR	31.046.611,20	3,22
433.374	VONOVIA SE	EUR	23.627.550,48	2,45
			866.172.379,48	**89,84**
	Irland			
401.661	LINDE PLC	EUR	97.744.204,35	10,14
			97.744.204,35	**10,14**
			963.916.583,83	**99,98**
Wertpapierbestand insgesamt			**963.916.583,83**	**99,98**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**963.916.583,83**	**99,98**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**385.959,55**	**0,04**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(191.810,65)**	**(0,02)**
Nettovermögen insgesamt	**964.110.732,73**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	99,98
	100,00	**99,98**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	89,86	89,84
Irland	10,14	10,14
	100,00	**99,98**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		65.662.191,45
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	10.546.241,42
Wertpapierbestand zum Marktwert		76.208.432,87
Bankguthaben		766.875,55
Forderungen aus Quellensteuerrückforderungen		9.394,59
Dividenden- und Zinsforderungen		108.827,04
Vermögen insgesamt		**77.093.530,05**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	47.177,87
Verbindlichkeiten insgesamt		**47.177,87**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**77.046.352,18**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		3.392.224,27
Bankzinsen		861,13
Erträge insgesamt		**3.393.085,40**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	164.919,60
Transaktionskosten	9	33.797,90
Bankzinsen		1.860,63
Aufwendungen insgesamt		**200.578,13**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**3.192.507,27**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	3.450.018,50
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**6.642.525,77**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	14.123.749,28
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**20.766.275,05**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		7.961.446,64
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(7.404.775,73)
Ausschüttungen	10	(2.731.456,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		58.454.862,22
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**77.046.352,18**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	1.959.600	241.600	(233.700)	1.967.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
11.992	ALLIANZ SE	EUR	2.521.917,60	3,27
23.763	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	2.122.273,53	2,75
34.907	DEUTSCHE POST AG	EUR	2.002.265,52	2,60
73.491	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	2.078.325,48	2,70
8.158	MUNICH RE	EUR	1.884.090,10	2,45
23.218	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	EUR	2.097.978,48	2,72
10.676	SIEMENS AG	EUR	1.426.527,12	1,85
103.812	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	2.778.009,12	3,61
7.805	VOLKSWAGEN AG	EUR	1.648.416,00	2,14
			18.559.802,95	**24,09**
	Frankreich			
161.307	AXA SA	EUR	3.449.550,20	4,48
37.590	COVIVIO	EUR	2.710.990,80	3,52
21.003	GECINA SA	EUR	2.713.587,60	3,52
383.465	ORANGE SA	EUR	3.687.015,98	4,78
42.972	PUBLICIS GROUPE	EUR	2.317.909,68	3,01
28.049	SANOFI	EUR	2.478.409,64	3,22
			17.357.463,90	**22,53**
	Italien			
102.868	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	1.738.983,54	2,26
272.150	POSTE ITALIANE SPA	EUR	3.034.472,50	3,94
690.984	SNAM SPA	EUR	3.368.547,00	4,37
6.853.402	TELECOM ITALIA-RSP	EUR	3.062.100,01	3,97
			11.204.103,05	**14,54**
	Finnland			
124.329	FORTUM OYJ	EUR	2.891.892,54	3,76
80.955	KESKO OYJ-B SHS	EUR	2.521.748,25	3,27
66.151	NOKIAN RENKAAT OYJ	EUR	2.252.441,55	2,92
62.299	SAMPO OYJ-A SHS	EUR	2.414.709,24	3,13
			10.080.791,58	**13,08**
	Niederlande			
448.687	AEGON NV	EUR	1.569.955,81	2,04
110.333	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	EUR	2.766.048,31	3,59
93.267	NN GROUP NV - W/I	EUR	3.710.161,26	4,81
			8.046.165,38	**10,44**
	Belgien			
58.379	AGEAS	EUR	2.732.137,20	3,55
219.777	PROXIMUS	EUR	3.580.167,33	4,64
			6.312.304,53	**8,19**
	Österreich			
55.530	OMV AG	EUR	2.663.774,10	3,46
			2.663.774,10	**3,46**
	Portugal			
443.854	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	EUR	1.984.027,38	2,58
			1.984.027,38	**2,58**
			76.208.432,87	**98,91**
Wertpapierbestand insgesamt			**76.208.432,87**	**98,91**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**76.208.432,87**	**98,91**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**766.875,55**	**1,00**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**71.043,76**	**0,09**
Nettovermögen insgesamt	**77.046.352,18**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	98,91
	100,00	**98,91**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	24,35	24,09
Frankreich	22,78	22,53
Italien	14,70	14,54
Finnland	13,23	13,08
Niederlande	10,56	10,44
Belgien	8,28	8,19
Österreich	3,50	3,46
Portugal	2,60	2,58
	100,00	**98,91**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		282.487.698,67
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	13.778.357,19
Wertpapierbestand zum Marktwert		296.266.055,86
Bankguthaben		22.450.191,94
Vermögen insgesamt		**318.716.247,80**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	153.495,20
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	1.481.851,52
Verbindlichkeiten insgesamt		**1.635.346,72**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**317.080.901,08**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		10.740,69
Bankzinsen		7.206,12
Sonstige Erträge		6.987,50
Erträge insgesamt		**24.934,31**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	553.104,15
Bankzinsen		160.783,56
Aufwendungen aus Swaps		612,22
Aufwendungen insgesamt		**714.499,93**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(689.565,62)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	80.714.393,90
Fremdwährungsgeschäften		119.334,77
Swaps	2.2	(7.151.054,17)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**72.993.108,88**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(5.601.682,01)
Swaps	2.2, 7	2.791.033,20
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**70.182.460,07**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		12.078.884,60
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(11.336.484,30)
Ausschüttungen	10	(5.659.432,60)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		251.815.473,31
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**317.080.901,08**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	3.364.078	154.000	(142.000)	3.376.078

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
5.231	AMAZON.COM INC	USD	15.174.531,55	4,79
209.229	APPLE INC	USD	24.163.929,37	7,63
65.776	BLACKSTONE GROUP INC/THE	USD	5.387.874,73	1,70
27.815	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	3.209.080,28	1,01
35.498	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	USD	4.630.395,16	1,46
1.059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	USD	1.384.442,25	0,44
18.784	CITIGROUP INC	USD	1.120.640,86	0,35
19.592	GENERAC HOLDINGS INC	USD	6.858.604,27	2,16
60.834	HOLOGIC INC	USD	3.422.585,78	1,08
87.065	INGERSOLL-RAND INC	USD	3.583.474,70	1,13
395.802	INTEL CORP	USD	18.737.097,80	5,91
67.962	LAS VEGAS SANDS CORP	USD	3.019.578,19	0,95
2.835	MASTERCARD INC - A	USD	872.780,29	0,28
3.048	MERCADOLIBRE INC	USD	4.003.831,62	1,26
6.214	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	USD	7.259.046,09	2,29
11.447	MICROSOFT CORP	USD	2.614.885,15	0,82
74.323	NIKE INC CL B	USD	9.682.233,13	3,05
3.165	NVR INC	USD	13.273.036,93	4,19
2.631	OREILLY AUTOMOTIVE INC	USD	1.256.175,49	0,40
14.126	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	4.419.809,68	1,39
108.797	PAYCHEX INC	USD	9.843.931,28	3,10
11.675	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	3.578.305,30	1,13
41.803	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	10.274.676,14	3,24
47.723	SEMPRA ENERGY	USD	5.331.261,52	1,68
25.627	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	USD	3.825.357,57	1,21
32.206	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	5.222.374,40	1,65
106.198	UBER TECHNOLOGIES INC	USD	4.488.273,68	1,42
20.043	UNITED RENTALS INC	USD	5.391.616,01	1,70
62.256	WALMART INC	USD	7.403.104,07	2,33
14.706	WATERS CORP	USD	4.285.808,80	1,35
63.505	WESTERN DIGITAL CORP	USD	3.811.156,80	1,20
			197.529.898,89	**62,30**
	Deutschland			
1.589.107	COMMERZBANK AG	EUR	9.506.038,07	3,00
1.378.030	DEUTSCHE BANK AG	EUR	15.139.037,58	4,77
6.237	KNORR-BREMSE AG	EUR	604.989,00	0,19
			25.250.064,65	**7,96**
	Belgien			
355.086	KBC GROUP NV	EUR	22.832.029,80	7,20
			22.832.029,80	**7,20**
	Österreich			
710.922	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	21.995.926,68	6,94
			21.995.926,68	**6,94**
	Niederlande			
91.984	KONINKLIJKE DSM	EUR	14.478.281,60	4,57
			14.478.281,60	**4,57**
	Finnland			
609.624	FORTUM OYJ	EUR	14.179.854,24	4,47
			14.179.854,24	**4,47**
			296.266.055,86	**93,44**
Wertpapierbestand insgesamt			**296.266.055,86**	**93,44**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in EUR
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 51	17.12.2021	EUR	318.530.759,25	(1.449.403,86)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 52	17.12.2021	EUR	296.233.608,21	(32.447,66)
				(1.481.851,52)
Total Return Swap insgesamt				**(1.481.851,52)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**296.266.055,86**	**93,44**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(1.481.851,52)**	**(0,47)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**22.450.191,94**	**7,08**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(153.495,20)**	**(0,05)**
Nettovermögen insgesamt	**317.080.901,08**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	93,44
	100,00	**93,44**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	66,67	62,30
Deutschland	8,52	7,96
Belgien	7,71	7,20
Österreich	7,42	6,94
Niederlande	4,89	4,57
Finnland	4,79	4,47
	100,00	**93,44**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		93.857.663,04
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	6.546.235,06
Wertpapierbestand zum Marktwert		100.403.898,10
Bankguthaben**		5.317.731,85
Vermögen insgesamt		**105.721.629,95**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,70
Pauschalgebühr	6.2	115.760,72
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	860.214,20
Verbindlichkeiten insgesamt		**975.975,62**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**104.745.654,33**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		46,32
Sonstige Erträge		471,23
Erträge insgesamt		**517,55**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	414.261,88
Bankzinsen		362,21
Aufwendungen aus Swaps		493,64
Aufwendungen insgesamt		**415.117,73**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(414.600,18)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	24.851.118,45
Fremdwährungsgeschäften		31.855,93
Swaps	2.2	(893.215,53)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**23.575.158,67**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	2.239.572,31
Swaps	2.2, 7	1.758.160,92
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**27.572.891,90**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		1.025.931,66
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(2.457.583,50)
Ausschüttungen	10	(1.381.526,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		79.985.940,27
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**104.745.654,33**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	263.650	2.600	(7.500)	258.750

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
1.535	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	937.885,00	0,90
2.260	ALPHABET INC-CL A	USD	5.518.445,40	5,27
2.044	AMAZON.COM INC	USD	7.031.687,04	6,70
24.313	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	3.747.362,69	3,58
18.516	AMGEN INC	USD	4.513.275,00	4,31
39.072	APPLE INC	USD	5.351.301,12	5,11
35.527	AT&T INC	USD	1.022.467,06	0,98
18.969	AUTODESK INC	USD	5.537.051,10	5,29
17.958	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	4.990.887,36	4,76
1.084	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	148.312,88	0,14
20.781	CHEVRON CORP	USD	2.176.601,94	2,08
61.459	CITIGROUP INC	USD	4.348.224,25	4,15
73.330	COMCAST CORP-CLASS A	USD	4.181.276,60	3,99
26.529	DARDEN RESTAURANTS INC	USD	3.872.968,71	3,70
26.323	DISCOVERY INC-C	USD	762.840,54	0,73
23.491	EXPEDIA GROUP INC	USD	3.845.711,61	3,67
13.765	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	4.786.228,15	4,57
11.782	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	2.585.677,72	2,47
556	INCYTE CORP	USD	46.776,28	0,04
771	INTEL CORP	USD	43.283,94	0,04
10.535	KANSAS CITY SOUTHERN	USD	2.985.302,95	2,85
8.975	MASTERCARD INC - A	USD	3.276.682,75	3,13
29.512	MICROSOFT CORP	USD	7.994.800,80	7,62
18.050	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	1.648.867,50	1,57
14.950	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	4.357.626,00	4,16
29.064	QUALCOMM INC	USD	4.154.117,52	3,97
8.621	SCHWAB (CHARLES) CORP	USD	627.695,01	0,60
5.734	VERISIGN INC	USD	1.305.574,46	1,25
100.128	WELLS FARGO & CO	USD	4.534.797,12	4,33
28.140	XILINX INC	USD	4.070.169,60	3,89
			100.403.898,10	**95,85**
			100.403.898,10	**95,85**
Wertpapierbestand insgesamt			**100.403.898,10**	**95,85**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 35	17.12.2021	USD	104.391.744,25	356.495,70
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 36	17.12.2021	USD	99.172.085,22	(1.216.709,90)
				(860.214,20)
Total Return Swap insgesamt				**(860.214,20)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**100.403.898,10**	**95,85**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(860.214,20)**	**(0,82)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**5.317.731,15**	**5,08**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(115.760,72)**	**(0,11)**
Nettovermögen insgesamt	**104.745.654,33**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	95,85
	100,00	**95,85**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	95,85
	100,00	**95,85**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF* (in JPY)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	JPY
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		9.723.999.002,00
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	169.375.362,00
Wertpapierbestand zum Marktwert		9.893.374.364,00
Bankguthaben**		1.086.770.004,00
Vermögen insgesamt		**10.980.144.368,00**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		1.828.678,00
Pauschalgebühr	6.2	6.663.888,00
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	339.094.543,79
Verbindlichkeiten insgesamt		**347.587.109,79**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**10.632.557.258,21**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	JPY
Erträge		
Bankzinsen		581.137,94
Sonstige Erträge		760.770,00
Erträge insgesamt		**1.341.907,94**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	19.698.856,00
Bankzinsen		5.342.279,49
Sonstige Aufwendungen		3.105,00
Aufwendungen insgesamt		**25.044.240,49**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(23.702.332,55)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	2.956.970.066,00
Fremdwährungsgeschäften		11.813.424,82
Devisentermingeschäften	2.2	(37.195.066,00)
Swaps	2.2	(724.157.273,27)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**2.183.728.819,00**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	160.643.142,00
Swaps	2.2, 7	(619.121.707,00)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**1.725.250.254,00**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		3.453.960.100,00
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(279.910.070,00)
Ausschüttungen	10	(79.772.982,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		5.813.029.956,21
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**10.632.557.258,21**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	2.367.300	1.100.000	(110.000)	3.357.300

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF* (in JPY)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in JPY	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
4.688	ALLY FINANCIAL INC	USD	25.932.806,00	0,24
6.996	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	USD	131.629.923,00	1,24
12	AMAZON.COM INC	USD	4.581.881,00	0,04
6.825	ANSYS INC	USD	262.900.311,00	2,47
124.119	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	USD	834.823.706,00	7,85
14.550	AUTODESK INC	USD	471.390.656,00	4,43
13.929	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	429.658.710,00	4,04
2.773	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	42.109.815,00	0,40
52.958	CENTENE CORP	USD	428.668.597,00	4,03
1	CONSTELLATION BRANDS INC-A	USD	25.959,00	0,00
81.431	DATADOG INC - CLASS A	USD	940.677.882,00	8,86
12.456	DUKE ENERGY CORP	USD	136.479.564,00	1,28
17.890	ELI LILLY & CO	USD	455.737.491,00	4,29
17.377	ENTERGY CORP	USD	192.288.734,00	1,81
85.640	EXELON CORP	USD	421.174.714,00	3,96
1.261	GENERAL MOTORS CO	USD	8.281.339,00	0,08
22.737	GODADDY INC - CLASS A	USD	219.450.500,00	2,06
7.241	INGERSOLL-RAND INC	USD	39.227.555,00	0,37
174	IQVIA HOLDINGS INC	USD	4.679.747,00	0,04
4.418	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	124.088.946,00	1,17
1.919	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	USD	20.728.170,00	0,19
9.496	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	USD	25.663.953,00	0,24
2.062	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	66.708.520,00	0,63
100.407	PFIZER INC	USD	436.405.842,00	4,10
33.504	RESMED INC	USD	916.711.544,00	8,62
32.649	SOUTHERN CO/THE	USD	219.270.859,00	2,06
21.149	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	451.391.111,00	4,25
9.250	TYLER TECHNOLOGIES INC	USD	464.429.085,00	4,37
19.126	UBER TECHNOLOGIES INC	USD	106.394.480,00	1,00
13.365	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	USD	461.257.462,00	4,34
623	VERISIGN INC	USD	15.744.029,00	0,15
24.856	WASTE MANAGEMENT INC	USD	386.530.932,00	3,64
23.122	WATERS CORP	USD	886.942.729,00	8,34
16.835	XPO LOGISTICS INC	USD	261.386.812,00	2,46
			9.893.374.364,00	**93,05**
			9.893.374.364,00	**93,05**
Wertpapierbestand insgesamt			**9.893.374.364,00**	**93,05**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in JPY
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 45	17.12.2021	JPY	10.803.670.684,10	(169.889.567,42)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 46	17.12.2021	JPY	9.723.999.003,29	(169.204.976,37)
				(339.094.543,79)
Total Return Swap insgesamt				**(339.094.543,79)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**9.893.374.364,00**	**93,05**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(339.094.543,79)**	**(3,19)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.084.941.326,00**	**10,20**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(6.663.888,00)**	**(0,06)**
Nettovermögen insgesamt	**10.632.557.258,21**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF* (in JPY)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	93,05
	100,00	**93,05**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	93,05
	100,00	**93,05**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		951.247.125,13
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	(6.547.656,49)
Wertpapierbestand zum Marktwert		944.699.468,64
Bankguthaben		83.020.616,70
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	30.621.323,93
Vermögen insgesamt		**1.058.341.409,27**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		8.193,12
Pauschalgebühr	6.2	751.531,53
Zinsverbindlichkeiten		2.299,63
Verbindlichkeiten insgesamt		**762.024,28**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**1.057.579.384,99**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		23.004,38
Sonstige Erträge		211.443,44
Erträge insgesamt		**234.447,82**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	1.750.506,67
Bankzinsen		26.528,22
Aufwendungen aus Swaps		18.019,77
Aufwendungen insgesamt		**1.795.054,66**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(1.560.606,84)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	176.791.936,36
Fremdwährungsgeschäften		(9.765.580,28)
Swaps	2.2	14.660.144,86
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**180.125.894,10**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(23.649.147,26)
Swaps	2.2, 7	30.996.428,07
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**187.473.174,91**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		732.779.735,46
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(132.020.578,46)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		269.347.053,08
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**1.057.579.384,99**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	2.922.595	6.137.581	(1.143.000)	7.917.176

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
65.726	ADIDAS AG	EUR	24.466.767,06	2,31
25.433	ALLIANZ SE	EUR	6.342.857,19	0,60
318.059	BAYER AG	EUR	19.315.703,67	1,83
99.368	BEIERSDORF AG	EUR	11.990.272,01	1,13
75.350	DELIVERY HERO SE	EUR	9.954.432,74	0,94
278.138	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	48.553.015,34	4,59
264.611	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	5.589.444,52	0,53
76.436	GERRESHEIMER AG	EUR	8.452.688,44	0,80
50.326	HANNOVER RUECK SE	EUR	8.421.074,24	0,80
357.072	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	14.321.135,98	1,35
489.447	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	EUR	52.448.124,43	4,97
323.664	SAP AG	EUR	45.614.730,07	4,31
28.276	SARTORIUS AG-VORZUG	EUR	14.720.771,19	1,39
1.011.923	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	62.018.040,62	5,87
1.217.001	UNIPER SE	EUR	44.827.080,55	4,24
			377.036.138,05	**35,66**
	Niederlande			
132.524	ASML HOLDING NV	EUR	91.058.626,60	8,61
14.140.348	KONINKLIJKE KPN NV	EUR	44.169.647,92	4,18
434.013	QIAGEN N.V.	EUR	20.979.009,64	1,98
			156.207.284,16	**14,77**
	Schweiz			
34.833	ADECCO GROUP AG-REG	CHF	2.368.773,46	0,22
26.807	BALOISE HOLDING AG - REG	CHF	4.184.781,79	0,40
1.323	BARRY CALLEBAUT AG-REG	CHF	3.077.206,03	0,29
6.214	BELIMO HOLDING AG-REG	CHF	2.843.609,05	0,27
9.446	GEBERIT AG-REG	CHF	7.091.950,29	0,67
175.038	HOLCIM LTD	CHF	10.509.537,32	0,99
72.822	NESTLE SA-REG	CHF	9.077.133,95	0,86
63.866	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF	24.082.029,00	2,28
13.070	SIKA AG-REG	CHF	4.277.196,85	0,40
10.978	STRAUMANN HOLDING AG-REG	CHF	17.517.556,14	1,66
18.055	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	CHF	8.781.770,17	0,83
34.178	SWISSCOM AG-REG	CHF	19.530.048,13	1,85
143.548	TEMENOS AG - REG	CHF	23.076.727,77	2,18
			136.418.319,95	**12,90**
	Belgien			
162.198	AGEAS	EUR	9.002.008,46	0,85
39.737	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	2.865.617,03	0,27
557.999	GALAPAGOS NV	EUR	38.698.029,70	3,66
228.506	KBC GROUP NV	EUR	17.424.352,57	1,65
88.293	SOFINA	EUR	38.092.286,07	3,60
			106.082.293,83	**10,03**
	Portugal			
16.189.549	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	EUR	85.820.362,13	8,11
			85.820.362,13	**8,11**
	Finnland			
315.026	HUHTAMAKI OYJ	EUR	14.924.893,87	1,41
360.996	KESKO OYJ-B SHS	EUR	13.335.475,62	1,26
67.227	NESTE OYJ	EUR	4.116.973,14	0,39
63.755	NOKIAN RENKAAT OYJ	EUR	2.574.420,21	0,24
			34.951.762,84	**3,30**
	Österreich			
451.787	OMV AG	EUR	25.701.088,53	2,43
			25.701.088,53	**2,43**
	Irland			
77.904	LINDE PLC	EUR	22.482.219,15	2,13
			22.482.219,15	**2,13**
			944.699.468,64	**89,33**
Wertpapierbestand insgesamt			**944.699.468,64**	**89,33**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 34	15.12.2021	USD	1.029.160.221,27	28.429.365,03
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 35	15.12.2021	USD	946.827.312,00	2.191.958,90
				30.621.323,93
Total Return Swap insgesamt				**30.621.323,93**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**944.699.468,64**	**89,33**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**30.621.323,93**	**2,90**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**83.012.423,58**	**7,85**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(753.831,16)**	**(0,08)**
Nettovermögen insgesamt	**1.057.579.384,99**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	89,33
	100,00	**89,33**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	39,91	35,66
Niederlande	16,54	14,77
Schweiz	14,44	12,90
Belgien	11,23	10,03
Portugal	9,08	8,11
Finnland	3,70	3,30
Österreich	2,72	2,43
Irland	2,38	2,13
	100,00	**89,33**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		2.918.287.208,08
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	230.642.811,50
Wertpapierbestand zum Marktwert		3.148.930.019,58
Bankguthaben**		166.163.484,73
Dividenden- und Zinsforderungen		0,01
Vermögen insgesamt		**3.315.093.504,32**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		1.395,44
Pauschalgebühr	6.2	1.584.577,55
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	29.931.116,86
Verbindlichkeiten insgesamt		**31.517.089,85**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**3.283.576.414,47**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		14,75
Bankzinsen		13.392,23
Sonstige Erträge		188.616,64
Erträge insgesamt		**202.023,62**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	5.564.831,65
Bankzinsen		14.781,05
Aufwendungen aus Swaps		195.361,18
Aufwendungen insgesamt		**5.774.973,88**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(5.572.950,26)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	924.428.782,18
Fremdwährungsgeschäften		2.454.087,81
Swaps	2.2	(135.515.432,55)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**785.794.487,18**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	149.948.774,52
Swaps	2.2, 7	(34.487.237,59)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**901.256.024,11**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		337.175.669,20
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(176.512.911,00)
Ausschüttungen	10	(40.193.998,52)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		2.261.851.630,68
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**3.283.576.414,47**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	36.235.228	4.548.000	(2.390.000)	38.393.228

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Netto-vermö-gens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
126.052	ABBOTT LABORATORIES	USD	14.613.208,36	0,45
12.267	ABIOMED INC	USD	3.828.653,37	0,12
101.150	ACTIVISION BLIZZARD INC	USD	9.653.756,00	0,29
118.350	ADOBE INC	USD	69.310.494,00	2,11
4.006	ADVANCED MICRO DEVICES	USD	376.283,58	0,01
247.467	AFLAC INC	USD	13.279.079,22	0,40
38.390	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	USD	4.476.274,00	0,14
529.977	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	USD	97.362.074,67	2,97
15.604	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	9.534.044,00	0,29
49.378	ALPHABET INC-CL A	USD	120.570.706,62	3,67
10.287	ALPHABET INC-CL C	USD	25.782.513,84	0,79
223.343	ALTICE USA INC- A	USD	7.624.930,02	0,23
74.090	AMAZON.COM INC	USD	254.881.454,40	7,76
311.047	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	USD	14.805.837,20	0,45
23.904	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	5.949.227,52	0,18
3.853	ANSYS INC	USD	1.337.222,18	0,04
37.022	ANTHEM INC	USD	14.134.999,60	0,43
1.891.594	APPLE INC	USD	259.072.714,24	7,89
183.766	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	USD	11.136.219,60	0,34
2.531	ARISTA NETWORKS INC	USD	917.006,61	0,03
17.575	AUTODESK INC	USD	5.130.142,50	0,16
4.325	AUTOZONE INC	USD	6.453.851,50	0,20
740.332	BANK OF AMERICA CORP	USD	30.523.888,36	0,93
527.988	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	146.738.424,96	4,47
819	BIO-RAD LABORATORIES-A	USD	527.673,51	0,02
3.111	BOOKING HOLDINGS INC	USD	6.807.147,99	0,21
39.126	BROADCOM INC	USD	18.656.841,84	0,57
248.467	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	33.995.254,94	1,04
127.245	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	USD	19.683.529,05	0,60
6.205	CARMAX INC	USD	801.375,75	0,02
34.475	CATALENT INC	USD	3.727.437,00	0,11
182.230	CENTENE CORP	USD	13.290.033,90	0,40
18.115	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	USD	13.069.066,75	0,40
686	CHENIERE ENERGY INC	USD	59.503,64	0,00
7.288	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	USD	11.298.877,92	0,34
53.366	CIGNA CORP	USD	12.651.477,62	0,39
23.367	CINTAS CORP	USD	8.926.194,00	0,27
479.620	CITIGROUP INC	USD	33.933.115,00	1,03
161.293	CITIZENS FINANCIAL GROUP	USD	7.398.509,91	0,23
35.551	CLOROX COMPANY	USD	6.395.980,41	0,19
179.856	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	USD	12.456.826,56	0,38
218.001	CORTEVA INC	USD	9.668.344,35	0,29
94.589	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	37.426.029,63	1,14
48.765	CUMMINS INC	USD	11.889.394,65	0,36
3.248	DEXCOM INC	USD	1.386.896,00	0,04
117.049	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	USD	13.845.726,21	0,42
64.899	DISCOVERY INC - A	USD	1.991.101,32	0,06
14.782	DISH NETWORK CORP-A	USD	617.887,60	0,02
11.094	DXC TECHNOLOGY CO	USD	432.000,36	0,01
206.146	EBAY INC	USD	14.473.510,66	0,44
65.335	ECOLAB INC	USD	13.457.049,95	0,41
70.299	ELI LILLY & CO	USD	16.135.026,48	0,49
62.225	EVERSOURCE ENERGY	USD	4.992.934,00	0,15
315.462	EXELON CORP	USD	13.978.121,22	0,43
748.217	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	260.162.533,07	7,93
177.472	FASTENAL CO	USD	9.228.544,00	0,28
66.997	FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRAN	USD	12.539.828,49	0,38
68.823	FISERV INC	USD	7.356.490,47	0,22
3.939	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	USD	1.008.620,34	0,03
9.330	FORTINET INC	USD	2.222.312,70	0,07
21.305	GARTNER INC	USD	5.160.071,00	0,16
618.302	GENERAL MOTORS CO	USD	36.584.929,34	1,11
37.186	GILEAD SCIENCES INC	USD	2.560.627,96	0,08
67.971	HCA HEALTHCARE INC	USD	14.052.324,54	0,43
5.443	HENRY SCHEIN INC	USD	403.816,17	0,01
9.085	HOLOGIC INC	USD	606.151,20	0,02
50.654	INCYTE CORP	USD	4.261.521,02	0,13
13.202	INGERSOLL-RAND INC	USD	644.389,62	0,02
2.162.574	INTEL CORP	USD	121.406.904,36	3,70
84.470	INTUIT INC	USD	41.404.659,90	1,26
29.913	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	27.509.191,32	0,84
1.669	IPG PHOTONICS CORP	USD	351.775,13	0,01
6.249	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.514.257,68	0,05
435.493	JOHNSON & JOHNSON	USD	71.743.116,82	2,18
8.765	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN-W/I	USD	1.353.403,65	0,04
106.130	KIMBERLY-CLARK CORP	USD	14.198.071,40	0,43
60.942	KLA CORP	USD	19.758.005,82	0,60
11.550	LKQ CORP	USD	568.491,00	0,02
200.482	MARSH & MCLENNAN COS	USD	28.203.807,76	0,86
199.583	MASTERCARD INC - A	USD	72.865.757,47	2,22
51.038	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	USD	5.377.363,68	0,16
185.794	METLIFE INC	USD	11.119.770,90	0,34
913	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	USD	1.264.815,42	0,04
134.750	MGM RESORTS INTERNATIONAL	USD	5.747.087,50	0,18
89.979	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	USD	13.473.455,46	0,41
233.170	MICRON TECHNOLOGY INC	USD	19.814.786,60	0,60
925.672	MICROSOFT CORP	USD	250.764.544,80	7,64
223.341	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	20.402.200,35	0,62
26.271	MSCI INC	USD	14.004.544,68	0,43
8.364	NETFLIX INC	USD	4.417.948,44	0,13
32.871	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	8.724.292,11	0,27
44.824	NVIDIA CORP	USD	35.863.682,40	1,09
120	NVR INC	USD	596.796,00	0,02
296.446	ORACLE CORP	USD	23.075.356,64	0,70
6.242	OREILLY AUTOMOTIVE INC	USD	3.534.282,82	0,11
1.563	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	568.103,61	0,02
119.374	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	34.795.133,52	1,06
77.978	PPG INDUSTRIES INC	USD	13.238.325,06	0,40
131.462	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	17.738.167,66	0,54
4.037	QORVO INC	USD	789.839,05	0,02
18.822	REGENERON PHARMACEUTICALS	USD	10.512.839,88	0,32
6.277	ROKU INC	USD	2.882.712,25	0,09
126.745	SALESFORCE.COM INC	USD	30.960.001,15	0,94
246.580	SCHWAB (CHARLES) CORP	USD	17.953.489,80	0,55
49.668	SKYWORKS SOLUTIONS INC	USD	9.523.839,00	0,29
315.454	SOUTHERN CO/THE	USD	19.088.121,54	0,58
177.614	SYNCHRONY FINANCIAL	USD	8.617.831,28	0,26
6.417	SYNOPSYS INC	USD	1.769.744,43	0,05
26.175	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	USD	4.633.498,50	0,14
20.552	TESLA INC	USD	13.969.194,40	0,43
197.546	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	37.988.095,80	1,16
287.056	TJX COMPANIES INC	USD	19.353.315,52	0,59
384.452	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	21.337.086,00	0,65
731	UBER TECHNOLOGIES INC	USD	36.637,72	0,00
2.150	ULTA BEAUTY INC	USD	743.405,50	0,02
8.891	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	USD	464.910,39	0,01
59.387	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	USD	12.350.714,39	0,38
2.752	UNITED RENTALS INC	USD	877.915,52	0,03
18.781	VERISIGN INC	USD	4.276.245,89	0,13
29.410	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	5.929.938,30	0,18
265.465	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	13.966.113,65	0,43
98.594	WALMART INC	USD	13.903.725,88	0,42
689.750	WALT DISNEY Co	USD	121.237.357,50	3,69
2.358	WATERS CORP	USD	814.948,38	0,02
535.330	WELLS FARGO & CO	USD	24.245.095,70	0,74
14.024	WESTERN DIGITAL CORP	USD	998.088,08	0,03
179.579	XILINX INC	USD	25.974.306,56	0,79
50.048	YUM! BRANDS INC	USD	5.757.021,44	0,18
922	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	USD	488.189,78	0,01
9.895	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	USD	3.829.661,85	0,12
			3.148.930.019,58	**95,90**
			3.148.930.019,58	**95,90**
Wertpapierbestand insgesamt			**3.148.930.019,58**	**95,90**

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeits-datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
Total Return Swap**				
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 44	17.12.2021	USD	3.291.229.938,73	(7.702.541,59)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 45	17.12.2021	USD	3.126.668.462,30	(22.228.575,27)
				(29.931.116,86)
Total Return Swap insgesamt				**(29.931.116,86)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Netto-vermö-gens
Wertpapierbestand insgesamt	**3.148.930.019,58**	**95,90**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(29.931.116,86)**	**(0,91)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**166.162.089,29**	**5,06**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(1.584.577,54)**	**(0,05)**
Nettovermögen insgesamt	**3.283.576.414,47**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	95,90
	100,00	**95,90**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	95,90
	100,00	**95,90**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		18.043.752,22
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	630.136,98
Wertpapierbestand zum Marktwert		18.673.889,20
Bankguthaben**		1.366.616,11
Vermögen insgesamt		**20.040.505,31**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		549,72
Pauschalgebühr	6.2	10.043,76
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	1.325.362,88
Zinsverbindlichkeiten		0,01
Verbindlichkeiten insgesamt		**1.335.956,37**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**18.704.548,94**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		1.082,92
Sonstige Erträge		2.315,95
Erträge insgesamt		**3.398,87**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	33.523,37
Bankzinsen		790,91
Aufwendungen insgesamt		**34.314,28**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(30.915,41)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	4.067.137,34
Fremdwährungsgeschäften		816,62
Swaps	2.2	898.375,28
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**4.935.413,83**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(620.155,62)
Swaps	2.2, 7	(488.474,72)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**3.826.783,49**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		7.317.432,40
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(3.409.870,50)
Ausschüttungen	10	(257.985,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		11.228.188,55
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**18.704.548,94**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	191.100	95.000	(45.000)	241.100

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
1.607	ADOBE INC	USD	941.123,48	5,03
10.899	ADVANCED MICRO DEVICES	USD	1.023.743,07	5,47
6.374	APPLIED MATERIALS INC	USD	907.657,60	4,85
34.963	BANK OF AMERICA CORP	USD	1.441.524,49	7,71
1.004	BLACKROCK INC	USD	878.469,88	4,70
3.684	CIGNA CORP	USD	873.365,88	4,67
15.970	COCA-COLA CO/THE	USD	864.136,70	4,62
6.123	ELECTRONIC ARTS INC	USD	880.671,09	4,71
12.968	GILEAD SCIENCES INC	USD	892.976,48	4,77
2.353	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	893.034,09	4,77
1.367	LAM RESEARCH CORP	USD	889.506,90	4,76
3.706	MCDONALDS CORP	USD	856.048,94	4,58
11.397	MERCK & CO. INC.	USD	886.344,69	4,74
5.654	MICROSOFT CORP	USD	1.531.668,60	8,19
2.955	NETFLIX INC	USD	1.560.860,55	8,34
3.248	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	946.727,04	5,06
9.892	PEPSICO INC	USD	1.465.697,64	7,84
1.864	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	940.332,08	5,03
			18.673.889,20	**99,84**
			18.673.889,20	**99,84**
Wertpapierbestand insgesamt			**18.673.889,20**	**99,84**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 40	17.12.2021	USD	18.043.752,00	(628.786,71)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 41	17.12.2021	USD	19.402.295,00	(696.576,17)
				(1.325.362,88)
Total Return Swap insgesamt				**(1.325.362,88)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**18.673.889,20**	**99,84**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(1.325.362,88)**	**(7,09)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.366.066,39**	**7,30**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(10.043,77)**	**(0,05)**
Nettovermögen insgesamt	**18.704.548,94**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	99,84
	100,00	**99,84**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	99,84
	100,00	**99,84**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI North America UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		128.404.177,30
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	12.842.931,29
Wertpapierbestand zum Marktwert		141.247.108,59
Bankguthaben**		7.252.396,88
Vermögen insgesamt		**148.499.505,47**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		604,83
Pauschalgebühr	6.2	88.404,68
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	490.971,44
Verbindlichkeiten insgesamt		**579.980,95**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**147.919.524,52**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		1.519,90
Sonstige Erträge		8.179,87
Erträge insgesamt		**9.699,77**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	323.414,46
Bankzinsen		3.985,47
Aufwendungen aus Swaps		6.976,28
Aufwendungen insgesamt		**334.376,21**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(324.676,44)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	43.272.138,57
Fremdwährungsgeschäften		40.143,10
Swaps	2.2	(6.960.293,27)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**36.027.311,96**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	8.714.714,57
Swaps	2.2, 7	211.149,32
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**44.953.175,85**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		15.943.219,55
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(28.941.955,30)
Ausschüttungen	10	(1.584.531,25)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		117.549.615,67
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**147.919.524,52**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	1.342.625	146.500	(286.000)	1.203.125

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI North America UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
2.520	ALPHABET INC-CL A	USD	6.153.310,80	4,16
3.306	AMAZON.COM INC	USD	11.373.168,96	7,69
82.604	APPLE INC	USD	11.313.443,84	7,65
30.300	ARTHUR J GALLAGHER & CO	USD	4.244.424,00	2,87
85.276	AT&T INC	USD	2.454.243,28	1,66
21.729	AUTODESK INC	USD	6.342.695,10	4,29
19.453	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	5.406.377,76	3,65
333	BIOGEN INC	USD	115.307,91	0,08
64	BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	2.736,64	0,00
2.871	CINTAS CORP	USD	1.096.722,00	0,74
34.559	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	12.016.509,89	8,12
50.562	FISERV INC	USD	5.404.572,18	3,65
12.120	GILEAD SCIENCES INC	USD	834.583,20	0,56
115.829	INTEL CORP	USD	6.502.640,06	4,40
7.862	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.905.119,84	1,29
29.979	LOWES COS INC	USD	5.815.026,63	3,93
36.740	MICROSOFT CORP	USD	9.952.866,00	6,73
47.075	NIKE INC CL B	USD	7.272.616,75	4,92
22.089	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	5.862.641,49	3,96
705	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	256.246,35	0,17
10.943	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	3.189.665,64	2,16
6.601	PEPSICO INC	USD	978.070,17	0,66
48.802	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	6.584.853,86	4,45
54.350	PROGRESSIVE CORP	USD	5.337.713,50	3,61
24.571	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	7.027.797,42	4,75
21.603	SALESFORCE.COM INC	USD	5.276.964,81	3,57
16.507	WALT DISNEY Co	USD	2.901.435,39	1,96
14.294	WELLS FARGO & CO	USD	647.375,26	0,44
12.862	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	USD	4.977.979,86	3,37
			141.247.108,59	**95,49**
			141.247.108,59	**95,49**
Wertpapierbestand insgesamt			**141.247.108,59**	**95,49**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 39	17.12.2021	USD	143.415.544,64	4.499.960,79
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 40	17.12.2021	USD	136.244.731,80	(4.990.932,23)
				(490.971,44)
Total Return Swap insgesamt				**(490.971,44)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**141.247.108,59**	**95,49**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(490.971,44)**	**(0,33)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**7.251.792,05**	**4,90**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(88.404,68)**	**(0,06)**
Nettovermögen insgesamt	**147.919.524,52**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI North America UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	95,49
	100,00	**95,49**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	95,49
	100,00	**95,49**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		230.598.302,53
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	12.370.390,85
Wertpapierbestand zum Marktwert		242.968.693,38
Bankguthaben**		23.310.064,92
Vermögen insgesamt		**266.278.758,30**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		15,30
Pauschalgebühr	6.2	294.147,01
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	11.279.982,71
Verbindlichkeiten insgesamt		**11.574.145,02**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**254.704.613,28**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		1.828,77
Sonstige Erträge		40.187,60
Erträge insgesamt		**42.016,37**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	1.030.645,84
Bankzinsen		921,40
Aufwendungen aus Swaps		29.249,86
Aufwendungen insgesamt		**1.060.817,10**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(1.018.800,73)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	67.273.135,96
Fremdwährungsgeschäften		84.163,36
Swaps	2.2	(12.652.326,04)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**53.686.172,55**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	9.858.515,82
Swaps	2.2, 7	(11.066.460,62)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**52.478.227,75**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		64.574.326,30
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(22.258.311,00)
Ausschüttungen	10	(3.442.060,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		163.352.430,23
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**254.704.613,28**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	2.877.000	1.033.000	(315.000)	3.595.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
17.631	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	10.772.541,00	4,23
138	ALPHABET INC-CL A	USD	336.967,02	0,13
160.458	APPLE INC	USD	21.976.327,68	8,63
18.716	ARROW ELECTRONICS INC	USD	2.130.442,28	0,84
77.393	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	21.509.062,56	8,44
1.091	BOOKING HOLDINGS INC	USD	2.387.206,19	0,94
57.257	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	7.833.902,74	3,08
9.350	CARVANA CO	USD	2.822.017,00	1,11
52.102	CATALENT INC	USD	5.633.268,24	2,21
102.397	DATADOG INC - CLASS A	USD	10.657.479,76	4,18
10.283	DROPBOX INC-CLASS A	USD	311.677,73	0,12
109.961	DUKE ENERGY CORP	USD	10.855.349,92	4,26
23.401	ENTERGY CORP	USD	2.333.079,70	0,92
22.062	EXPEDIA GROUP INC	USD	3.611.770,02	1,42
31.921	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	11.099.250,91	4,36
14.916	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	3.273.465,36	1,29
119.803	INCYTE CORP	USD	10.079.026,39	3,96
40.449	IQVIA HOLDINGS INC	USD	9.801.601,68	3,85
57.434	MARATHON PETROLEUM CORP-W/I	USD	3.470.162,28	1,36
41.030	MICROSOFT CORP	USD	11.115.027,00	4,36
5.886	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	1.489.511,16	0,58
1.553	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	USD	37.815,55	0,01
54.553	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	15.901.108,44	6,24
186.637	PPD INC	USD	8.602.099,33	3,38
4.075	PVH CORP	USD	438.429,25	0,17
1	SEALED AIR CORP	USD	59,25	0,00
43.765	ULTA BEAUTY INC	USD	15.132.624,05	5,94
33.472	VAIL RESORTS INC	USD	10.594.557,44	4,16
81.529	XILINX INC	USD	11.792.354,56	4,63
60.100	XPO LOGISTICS INC	USD	8.407.389,00	3,30
47.963	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	USD	18.563.119,89	7,29
			242.968.693,38	**95,39**
			242.968.693,38	**95,39**
Wertpapierbestand insgesamt			**242.968.693,38**	**95,39**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 50	17.12.2021	USD	261.153.574,74	(6.501.118,39)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 51	17.12.2021	USD	238.164.896,91	(4.778.864,32)
				(11.279.982,71)
Total Return Swap insgesamt				**(11.279.982,71)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**242.968.693,38**	**95,39**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(11.279.982,71)**	**(4,43)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**23.310.049,62**	**9,15**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(294.147,01)**	**(0,11)**
Nettovermögen insgesamt	**254.704.613,28**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	95,39
	100,00	**95,39**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	95,39
	100,00	**95,39**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		42.862.036,24
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	3.149.372,80
Wertpapierbestand zum Marktwert		46.011.409,04
Bankguthaben		2.412.609,41
Vermögen insgesamt		**48.424.018,45**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,47
Pauschalgebühr	6.2	10.082,54
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	59.108,98
Verbindlichkeiten insgesamt		**69.191,99**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**48.354.826,46**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		77,08
Bankzinsen		258,34
Sonstige Erträge		9.810,59
Erträge insgesamt		**10.146,01**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	42.051,34
Bankzinsen		906,94
Aufwendungen aus Swaps		8.060,80
Aufwendungen insgesamt		**51.019,08**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(40.873,07)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	14.719.872,60
Fremdwährungsgeschäften		64.668,10
Swaps	2.2	(1.141.693,44)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**13.601.974,19**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	2.424.304,55
Swaps	2.2, 7	(325.573,73)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**15.700.705,01**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		16.342.285,45
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(36.796.263,90)
Ausschüttungen	10	(576.640,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		53.684.739,90
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**48.354.826,46**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	641.000	161.500	(391.000)	411.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
1.530	ALPHABET INC-CL A	USD	3.735.938,70	7,73
706	AMAZON.COM INC	USD	2.428.752,96	5,02
16.263	APPLE INC	USD	2.227.380,48	4,61
2.707	AUTODESK INC	USD	790.173,30	1,63
7.987	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	2.219.747,04	4,59
15.192	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	2.078.569,44	4,30
40.634	CONAGRA BRANDS INC	USD	1.478.264,92	3,06
30.106	CONSOLIDATED EDISON INC	USD	2.159.202,32	4,47
2.028	DEXCOM INC	USD	865.956,00	1,79
12.869	DISH NETWORK CORP-A	USD	537.924,20	1,11
15.288	FISERV INC	USD	1.634.134,32	3,38
2.594	IDEXX LABORATORIES INC	USD	1.638.240,70	3,39
8.049	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.950.433,68	4,03
64.249	KROGER CO	USD	2.461.379,19	5,09
5.667	MASTERCARD INC - A	USD	2.068.965,03	4,28
21.278	MICRON TECHNOLOGY INC	USD	1.808.204,44	3,74
15.532	MICROSOFT CORP	USD	4.207.618,80	8,69
2.812	NVIDIA CORP	USD	2.249.881,20	4,65
21.752	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	1.778.661,04	3,68
507	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	147.780,36	0,31
7.015	PEPSICO INC	USD	1.039.412,55	2,15
2.431	QUALCOMM INC	USD	347.462,83	0,72
30.359	SCHWAB (CHARLES) CORP	USD	2.210.438,79	4,57
183	SYNOPSYS INC	USD	50.469,57	0,10
7.209	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	USD	1.276.137,18	2,64
1.776	TESLA INC	USD	1.207.147,20	2,50
9.770	XILINX INC	USD	1.413.132,80	2,92
			46.011.409,04	**95,15**
			46.011.409,04	**95,15**
Wertpapierbestand insgesamt			**46.011.409,04**	**95,15**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 31	17.12.2021	USD	48.002.200,80	349.306,64
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 32	17.12.2021	USD	45.602.019,31	(408.415,62)
				(59.108,98)
Total Return Swap insgesamt				**(59.108,98)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**46.011.409,04**	**95,15**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(59.108,98)**	**(0,12)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**2.412.608,94**	**4,99**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(10.082,54)**	**(0,02)**
Nettovermögen insgesamt	**48.354.826,46**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	95,15
	100,00	**95,15**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	95,15
	100,00	**95,15**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		19.315.353,34
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	1.346.452,57
Wertpapierbestand zum Marktwert		20.661.805,91
Bankguthaben**		1.082.709,39
Vermögen insgesamt		**21.744.515,30**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,43
Pauschalgebühr	6.2	18.805,69
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	620.506,57
Verbindlichkeiten insgesamt		**639.312,69**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**21.105.202,61**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		30,78
Bankzinsen		1.540,11
Sonstige Erträge		843,39
Erträge insgesamt		**2.414,28**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	67.611,48
Bankzinsen		544,64
Aufwendungen aus Swaps		722,90
Aufwendungen insgesamt		**68.879,02**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(66.464,74)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	5.706.956,68
Fremdwährungsgeschäften		16.124,41
Swaps	2.2	3.023.086,57
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**8.679.702,92**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	484.101,36
Swaps	2.2, 7	(1.268.388,89)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**7.895.415,39**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		-
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(3.373.567,03)
Ausschüttungen	10	(230.854,50)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		16.814.208,75
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**21.105.202,61**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	88.450	-	(14.750)	73.700

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
1.478	ABBOTT LABORATORIES	USD	171.344,54	0,81
1.546	ADOBE INC	USD	905.399,44	4,29
239	ALPHABET INC-CL C	USD	599.010,48	2,84
19.000	ALTICE USA INC- A	USD	648.660,00	3,07
488	AMAZON.COM INC	USD	1.678.798,08	7,96
1.103	AMGEN INC	USD	268.856,25	1,27
7.580	APPLE INC	USD	1.038.156,80	4,92
6.829	AT&T INC	USD	196.538,62	0,93
3.867	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	1.074.716,64	5,09
6.291	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	860.734,62	4,08
6.235	CHEVRON CORP	USD	653.053,90	3,09
5.805	COMCAST CORP-CLASS A	USD	331.001,10	1,57
93	DEXCOM INC	USD	39.711,00	0,19
3.249	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	1.129.709,79	5,35
7.539	FISERV INC	USD	805.843,71	3,82
530	GODADDY INC - CLASS A	USD	46.088,80	0,22
628	IDEXX LABORATORIES INC	USD	396.613,40	1,88
20.432	INTEL CORP	USD	1.147.052,48	5,43
955	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	878.256,20	4,16
2.631	MASTERCARD INC - A	USD	960.551,79	4,55
321	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	USD	33.820,56	0,16
4.745	MICROSOFT CORP	USD	1.285.420,50	6,10
9.408	PACCAR INC	USD	839.664,00	3,98
2.375	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	692.265,00	3,28
3.432	PEPSICO INC	USD	508.519,44	2,41
275	PROGRESSIVE CORP	USD	27.007,75	0,13
7.238	QUALCOMM INC	USD	1.034.527,34	4,90
1.707	REGENERON PHARMACEUTICALS	USD	953.427,78	4,52
6.975	SNAP INC - A	USD	475.276,50	2,25
2.734	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	USD	981.779,40	4,65
			20.661.805,91	**97,90**
			20.661.805,91	**97,90**
Wertpapierbestand insgesamt			**20.661.805,91**	**97,90**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 32	17.12.2021	USD	21.332.559,11	(227.031,88)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 33	17.12.2021	USD	20.265.825,01	(393.474,69)
				(620.506,57)
Total Return Swap insgesamt				**(620.506,57)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**20.661.805,91**	**97,90**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(620.506,57)**	**(2,94)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.082.708,96**	**5,13**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(18.805,69)**	**(0,09)**
Nettovermögen insgesamt	**21.105.202,61**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	97,90
	100,00	**97,90**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	97,90
	100,00	**97,90**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		87.542.728,30
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	5.475.049,70
Wertpapierbestand zum Marktwert		93.017.778,00
Bankguthaben**		5.108.148,95
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		4.077.357,64
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	228.974,76
Vermögen insgesamt		**102.432.259,35**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	89.626,52
Verbindlichkeiten aus dem Rückkauf von Fondsanteilen		1.643.110,92
Verbindlichkeiten aus Swaps		2.563.231,17
Verbindlichkeiten insgesamt		**4.295.968,61**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**98.136.290,74**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		10,83
Bankzinsen		2,39
Sonstige Erträge		15.463,16
Erträge insgesamt		**15.476,38**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	295.820,51
Bankzinsen		1.934,80
Aufwendungen aus Swaps		14.211,37
Aufwendungen insgesamt		**311.966,68**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(296.490,30)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	27.733.996,46
Fremdwährungsgeschäften		16.742,67
Swaps	2.2	11.620.141,52
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**39.074.390,35**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	3.609.675,45
Swaps	2.2, 7	(1.195.505,38)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**41.488.560,42**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		26.388.786,30
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(29.553.186,70)
Ausschüttungen	10	(856.603,30)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		60.668.734,02
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**98.136.290,74**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	1.451.870	449.000	(473.000)	1.427.870

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
24.840	ABBVIE INC	USD	2.797.977,60	2,85
441	ALPHABET INC-CL A	USD	1.076.829,39	1,10
1.157	AMAZON.COM INC	USD	3.980.265,12	4,06
12.835	ANSYS INC	USD	4.454.515,10	4,54
20.807	APPLE INC	USD	2.849.726,72	2,90
146.273	AT&T INC	USD	4.209.736,94	4,29
17.552	AUTODESK INC	USD	5.123.428,80	5,22
17.562	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	4.880.831,04	4,97
94.370	COMCAST CORP-CLASS A	USD	5.380.977,40	5,48
6.601	DISH NETWORK CORP-A	USD	275.921,80	0,28
15.654	ELI LILLY & CO	USD	3.592.906,08	3,66
13.570	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	4.718.424,70	4,81
61.927	INTEL CORP	USD	3.476.581,78	3,54
12.384	JOHNSON & JOHNSON	USD	2.040.140,16	2,08
2.789	KANSAS CITY SOUTHERN	USD	790.318,93	0,81
24.402	LAS VEGAS SANDS CORP	USD	1.285.741,38	1,31
11.479	MASTERCARD INC - A	USD	4.190.868,11	4,27
45.723	MICRON TECHNOLOGY INC	USD	3.885.540,54	3,96
25.456	MICROSOFT CORP	USD	6.896.030,40	7,04
3.806	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	1.109.372,88	1,13
22.215	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	USD	4.237.733,40	4,32
6.599	ROSS STORES INC	USD	818.276,00	0,83
205	SPLUNK INC	USD	29.638,90	0,03
17.274	SYNOPSYS INC	USD	4.763.996,46	4,85
14.541	TARGET CORP	USD	3.515.141,34	3,58
75.128	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	4.209.421,84	4,29
21.809	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	4.397.348,67	4,48
12.401	WALMART INC	USD	1.748.789,02	1,78
36.015	WELLS FARGO & CO	USD	1.631.119,35	1,66
1.702	XILINX INC	USD	246.177,28	0,25
763	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	USD	404.000,87	0,41
			93.017.778,00	**94,78**
			93.017.778,00	**94,78**
Wertpapierbestand insgesamt			**93.017.778,00**	**94,78**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 33	17.12.2021	USD	100.635.354,06	350.320,88
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 34	17.12.2021	USD	95.603.496,93	(121.346,12)
				228.974,76
Total Return Swap insgesamt				**228.974,76**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**93.017.778,00**	**94,78**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**228.974,76**	**0,23**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**5.108.148,95**	**5,21**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(218.610,97)**	**(0,22)**
Nettovermögen insgesamt	**98.136.290,74**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	94,78
	100,00	**94,78**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	94,78
	100,00	**94,78**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		25.996.218,62
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	907.817,84
Wertpapierbestand zum Marktwert		26.904.036,46
Bankguthaben**		1.976.074,29
Vermögen insgesamt		**28.880.110,75**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	22.820,22
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	1.805.130,33
Verbindlichkeiten insgesamt		**1.827.950,55**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**27.052.160,20**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		27,30
Bankzinsen		3,08
Sonstige Erträge		1.173,83
Erträge insgesamt		**1.204,21**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	79.963,54
Bankzinsen		286,16
Aufwendungen insgesamt		**80.249,70**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(79.045,49)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	10.216.129,26
Fremdwährungsgeschäften		(34.889,58)
Swaps	2.2	235.366,95
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**10.337.561,14**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	379.705,89
Swaps	2.2, 7	(2.893.014,56)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**7.824.252,47**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		2.300.904,60
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(1.381.586,48)
Ausschüttungen	10	(307.940,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		18.616.529,61
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**27.052.160,20**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	178.000	17.000	(11.800)	183.200

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
2.315	ADOBE INC	USD	1.355.756,60	5,01
15.702	ADVANCED MICRO DEVICES	USD	1.474.888,86	5,45
9.183	APPLIED MATERIALS INC	USD	1.307.659,20	4,83
50.372	BANK OF AMERICA CORP	USD	2.076.837,56	7,68
1.447	BLACKROCK INC	USD	1.266.081,59	4,68
5.308	CIGNA CORP	USD	1.258.367,56	4,65
23.009	COCA-COLA CO/THE	USD	1.245.016,99	4,60
8.821	ELECTRONIC ARTS INC	USD	1.268.724,43	4,69
18.682	GILEAD SCIENCES INC	USD	1.286.442,52	4,76
3.391	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	1.286.986,23	4,76
1.969	LAM RESEARCH CORP	USD	1.281.228,30	4,74
5.340	MCDONALDS CORP	USD	1.233.486,60	4,56
16.419	MERCK & CO. INC.	USD	1.276.905,63	4,72
8.145	MICROSOFT CORP	USD	2.206.480,50	8,16
4.258	NETFLIX INC	USD	2.249.118,18	8,30
4.679	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	1.363.834,92	5,04
14.252	PEPSICO INC	USD	2.111.718,84	7,81
2.685	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	1.354.501,95	5,01
			26.904.036,46	**99,45**
			26.904.036,46	**99,45**
Wertpapierbestand insgesamt			**26.904.036,46**	**99,45**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 48	17.12.2021	USD	27.953.144,00	(899.257,87)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 49	17.12.2021	USD	25.996.219,00	(905.872,46)
				(1.805.130,33)
Total Return Swap insgesamt				**(1.805.130,33)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**26.904.036,46**	**99,45**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(1.805.130,33)**	**(6,67)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.976.074,29**	**7,30**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(22.820,22)**	**(0,08)**
Nettovermögen insgesamt	**27.052.160,20**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	99,45
	100,00	**99,45**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	99,45
	100,00	**99,45**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		74.423.386,07
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	(1.039.623,54)
Wertpapierbestand zum Marktwert		73.383.762,53
Bankguthaben		5.666.996,45
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	415.033,26
Vermögen insgesamt		**79.465.792,24**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,63
Pauschalgebühr	6.2	64.324,14
Verbindlichkeiten insgesamt		**64.324,77**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**79.401.467,47**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		3.891,31
Sonstige Erträge		5.490,72
Erträge insgesamt		**9.382,03**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	220.989,92
Bankzinsen		3.389,69
Aufwendungen insgesamt		**224.379,61**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(214.997,58)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	12.363.171,11
Fremdwährungsgeschäften		(1.065.222,21)
Swaps	2.2	15.014.037,63
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**26.096.988,95**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(2.430.856,17)
Swaps	2.2, 7	749.545,07
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**24.415.677,85**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		12.206.037,30
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(3.657.822,30)
Ausschüttungen	10	(840.739,50)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		47.278.314,12
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**79.401.467,47**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	1.082.986	202.000	(60.000)	1.224.986

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
9.639	ADIDAS AG	EUR	3.588.156,40	4,52
53.339	BAYER AG	EUR	3.239.274,22	4,08
30.518	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	3.232.244,66	4,07
71.982	DAIMLER AG	EUR	6.427.868,07	8,10
49.369	DEUTSCHE POST AG	EUR	3.358.238,55	4,23
83.612	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	3.353.438,02	4,22
48.931	SAP AG	EUR	6.895.961,11	8,68
12.638	VOLKSWAGEN AG	EUR	3.165.339,77	3,99
52.671	VONOVIA SE	EUR	3.405.457,62	4,29
			36.665.978,42	**46,18**
	Belgien			
41.742	ACKERMANS & VAN HAAREN SA	EUR	7.049.061,70	8,87
43.671	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	3.149.315,78	3,97
			10.198.377,48	**12,84**
	Portugal			
1.202.247	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	EUR	6.373.078,89	8,03
			6.373.078,89	**8,03**
	Schweiz			
2.738	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	CHF	332.045,29	0,42
12.425	TEMENOS AG - REG	CHF	1.997.438,78	2,52
228.205	UBS GROUP AG-REG	CHF	3.495.800,82	4,40
			5.825.284,89	**7,34**
	Niederlande			
308	ADYEN NV	EUR	752.612,46	0,95
4.894	ASML HOLDING NV	EUR	3.362.718,59	4,23
			4.115.331,05	**5,18**
	Österreich			
171.249	AMS AG	CHF	3.438.462,46	4,33
			3.438.462,46	**4,33**
	Irland			
11.729	LINDE PLC	EUR	3.384.857,62	4,26
			3.384.857,62	**4,26**
	Finnland			
41.456	KONE OYJ	EUR	3.382.391,72	4,26
			3.382.391,72	**4,26**
			73.383.762,53	**92,42**
Wertpapierbestand insgesamt			**73.383.762,53**	**92,42**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 59	15.12.2021	USD	80.103.759,39	(700.665,26)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 61	15.12.2021	USD	74.496.544,00	1.115.698,52
				415.033,26
Total Return Swap insgesamt				**415.033,26**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**73.383.762,53**	**92,42**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**415.033,26**	**0,52**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**5.666.995,82**	**7,14**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(64.324,14)**	**(0,08)**
Nettovermögen insgesamt	**79.401.467,47**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	92,42
	100,00	**92,42**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	49,96	46,18
Belgien	13,90	12,84
Portugal	8,68	8,03
Schweiz	7,94	7,34
Niederlande	5,61	5,18
Österreich	4,69	4,33
Irland	4,61	4,26
Finnland	4,61	4,26
	100,00	**92,42**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF* (in CHF)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	CHF
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		68.150.013,72
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	18.304.065,03
Wertpapierbestand zum Marktwert		86.454.078,75
Bankguthaben		49.384,24
Dividenden- und Zinsforderungen		0,01
Vermögen insgesamt		**86.503.463,00**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,02
Pauschalgebühr	6.2	49.910,58
Verbindlichkeiten insgesamt		**49.910,60**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**86.453.552,40**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	CHF
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		1.170.771,24
Bankzinsen		191,14
Erträge insgesamt		**1.170.962,38**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	170.163,00
Transaktionskosten	9	1.563,99
Bankzinsen		534,78
Aufwendungen insgesamt		**172.261,77**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**998.700,61**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	1.748.456,10
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**2.747.156,71**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	15.002.415,74
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**17.749.572,45**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		22.043.649,10
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(9.691.519,31)
Ausschüttungen	10	(1.329.069,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		57.680.919,16
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**86.453.552,40**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	475.850	164.300	(73.650)	566.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF* (in CHF)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in CHF	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Schweiz			
160.048	ABB LTD-REG	CHF	5.023.906,72	5,81
13.684	ADECCO GROUP AG-REG	CHF	860.176,24	0,99
41.917	ALCON INC	CHF	2.715.383,26	3,14
4.094	BALOISE HOLDING AG - REG	CHF	590.764,20	0,68
88	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	CHF	810.040,00	0,94
9	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	CHF	872.100,00	1,01
43.788	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	CHF	4.902.066,60	5,67
203.269	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	CHF	1.970.083,15	2,28
3.107	GEBERIT AG-REG	CHF	2.156.258,00	2,49
666	GIVAUDAN-REG	CHF	2.865.798,00	3,31
42.883	HOLCIM LTD	CHF	2.380.006,50	2,75
18.774	JULIUS BAER GROUP LTD	CHF	1.133.574,12	1,31
4.228	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	CHF	1.338.584,80	1,55
14.521	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	CHF	1.627.804,10	1,88
6.247	LONZA GROUP AG-REG	CHF	4.096.782,60	4,74
75.123	NESTLE SA-REG	CHF	8.655.672,06	10,01
104.049	NOVARTIS AG-REG	CHF	8.773.411,68	10,16
1.568	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	2.197.552,00	2,54
936	ROCHE HOLDING AG-BR	CHF	351.748,80	0,41
24.166	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF	8.423.059,30	9,74
1.632	SCHINDLER HOLDING AG-REG	CHF	441.292,80	0,51
3.416	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	CHF	966.728,00	1,12
432	SGS SA-REG	CHF	1.232.928,00	1,43
11.893	SIKA AG-REG	CHF	3.597.632,50	4,16
4.538	SONOVA HOLDING AG-REG	CHF	1.579.224,00	1,83
961	STRAUMANN HOLDING AG-REG	CHF	1.417.475,00	1,64
2.427	SWATCH GROUP AG/THE-BR	CHF	770.329,80	0,89
4.904	SWATCH GROUP AG/THE-REG	CHF	299.389,20	0,35
2.685	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	CHF	1.207.176,00	1,40
23.703	SWISS RE AG	CHF	1.978.726,44	2,29
2.129	SWISSCOM AG-REG	CHF	1.124.537,80	1,30
5.553	TEMENOS AG - REG	CHF	825.175,80	0,95
323.713	UBS GROUP AG-REG	CHF	4.583.776,08	5,30
12.621	ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	4.684.915,20	5,42
			86.454.078,75	**100,00**
			86.454.078,75	**100,00**
Wertpapierbestand insgesamt			**86.454.078,75**	**100,00**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**86.454.078,75**	**100,00**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**49.384,22**	**0,06**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(49.910,57)**	**(0,06)**
Nettovermögen insgesamt	**86.453.552,40**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF* (in CHF)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	100,00
	100,00	**100,00**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Schweiz	100,00	100,00
	100,00	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		410.984.196,17
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	17.843.425,40
Wertpapierbestand zum Marktwert		428.827.621,57
Bankguthaben		1.201.019,18
Dividenden- und Zinsforderungen		117.010,88
Vermögen insgesamt		**430.145.651,63**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	761.497,22
Verbindlichkeiten insgesamt		**761.497,22**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**429.384.154,41**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		4.550.768,25
Bankzinsen		4.885,53
Erträge insgesamt		**4.555.653,78**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	2.880.798,37
Transaktionskosten	9	64.305,41
Bankzinsen		66,63
Aufwendungen insgesamt		**2.945.170,41**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**1.610.483,37**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	52.848.795,00
Fremdwährungsgeschäften		2.135,47
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**54.461.413,84**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(105.683.469,76)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**(51.222.055,92)**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		207.580.871,58
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(116.223.113,20)
Ausschüttungen	10	(568.168,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		389.816.619,95
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**429.384.154,41**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	13.384.250	6.756.450	(4.030.200)	16.110.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Kanada			
178.580	AGNICO EAGLE MINES LTD	USD	10.795.161,00	2,51
1.452.693	ALAMOS GOLD INC-CLASS A	USD	11.113.101,45	2,59
3.138.976	BARRICK GOLD CORP	USD	64.914.023,68	15,12
2.593.888	B2GOLD CORP	USD	10.920.268,48	2,54
1.102.513	ELDORADO GOLD CORP	USD	10.970.004,35	2,55
1.436.570	EQUINOX GOLD CORP	USD	9.984.161,50	2,33
320.480	FRANCO-NEVADA CORP	USD	46.492.033,60	10,83
3.415.171	IAMGOLD CORP	USD	10.074.754,45	2,35
1.626.068	KINROSS GOLD CORP	USD	10.325.531,80	2,40
294.908	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	USD	11.362.805,24	2,65
5.937.385	NEW GOLD INC	USD	10.746.666,85	2,50
1.316.734	NOVAGOLD RESOURCES INC	USD	10.547.039,34	2,46
879.314	OSISKO GOLD ROYALTIES LTD	USD	12.046.601,80	2,81
1.222.238	PRETIUM RESOURCES INC	USD	11.684.595,28	2,72
1.408.433	SANDSTORM GOLD LTD	USD	11.126.620,70	2,59
679.449	SEABRIDGE GOLD INC	USD	11.924.329,95	2,78
711.964	SSR MINING INC	USD	11.099.518,76	2,58
264.585	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	USD	11.660.260,95	2,72
2.484.357	YAMANA GOLD INC	USD	10.483.986,54	2,44
			298.271.465,72	**69,47**
	Vereinigte Staaten			
581.208	ANGLOGOLD ASHANTI-SPON ADR	USD	10.798.844,64	2,51
1.194.050	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	USD	10.806.152,50	2,52
1.172.418	COEUR MINING INC	USD	10.411.071,84	2,42
1.163.984	GOLD FIELDS LTD-SPONS ADR	USD	10.359.457,60	2,41
1.047.356	NEWMONT CORP	USD	66.381.423,28	15,47
103.267	ROYAL GOLD INC	USD	11.782.764,70	2,74
			120.539.714,56	**28,07**
	Südafrika			
2.685.373	HARMONY GOLD MNG-SPON ADR	USD	10.016.441,29	2,33
			10.016.441,29	**2,33**
			428.827.621,57	**99,87**
Wertpapierbestand insgesamt			**428.827.621,57**	**99,87**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**428.827.621,57**	**99,87**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.201.019,18**	**0,28**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(644.486,34)**	**(0,15)**
Nettovermögen insgesamt	**429.384.154,41**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	99,87
	100,00	**99,87**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Kanada	69,55	69,47
Vereinigte Staaten	28,11	28,07
Südafrika	2,34	2,33
	100,00	**99,87**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ und 1.3 „Verschmelzung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		300.569.674,96
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	21.406.383,77
Wertpapierbestand zum Marktwert		321.976.058,73
Bankguthaben**		34.665.695,73
Vermögen insgesamt		**356.641.754,46**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		1,82
Pauschalgebühr	6.2	98.335,51
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	10.649.973,16
Verbindlichkeiten insgesamt		**10.748.310,49**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**345.893.443,97**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Bankzinsen		3,13
Sonstige Erträge		25.320,33
Erträge insgesamt		**25.323,46**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	309.363,82
Bankzinsen		108.545,40
Aufwendungen aus Swaps		24.228,59
Aufwendungen insgesamt		**442.137,81**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(416.814,35)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	27.556.550,30
Fremdwährungsgeschäften		167.919,89
Swaps	2.2	(41.680.536,86)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**(14.372.881,02)**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	21.813.498,41
Swaps	2.2, 7	(8.184.800,12)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**(744.182,73)**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		219.879.778,72
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(22.329.665,00)
Ausschüttungen	10	(134.550,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		149.222.062,98
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**345.893.443,97**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	2.917.600	4.283.400	(440.000)	6.761.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Netto-vermö-gens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
136	ABIOMED INC	USD	35.793,03	0,01
61.060	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	USD	9.458.919,47	2,73
852	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	438.967,87	0,13
3.049	ALPHABET INC-CL C	USD	6.443.856,72	1,86
5.188	AMAZON.COM INC	USD	15.049.793,47	4,35
9.470	AMGEN INC	USD	1.946.464,71	0,56
48.840	ANTHEM INC	USD	15.724.017,20	4,55
101.207	APPLE INC	USD	11.688.431,33	3,38
51.385	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	12.042.262,59	3,48
1.436	BOOKING HOLDINGS INC	USD	2.649.546,54	0,77
24.649	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	2.843.811,60	0,82
41.538	CHEVRON CORP	USD	3.668.682,11	1,06
131.073	CIGNA CORP	USD	26.202.442,12	7,58
86.654	CME GROUP INC CL A	USD	15.540.579,07	4,49
105.585	DR HORTON INC	USD	8.045.970,53	2,33
62.366	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	5.446.704,29	1,57
14.392	ENTERGY CORP	USD	1.209.952,27	0,35
12.950	EQUIFAX INC	USD	2.615.443,55	0,76
54.694	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	16.036.470,82	4,64
18.949	FISERV INC	USD	1.707.950,59	0,49
8.082	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	1.495.636,83	0,43
3.349	IDEXX LABORATORIES INC	USD	1.783.507,00	0,52
272.848	INTEL CORP	USD	12.916.507,90	3,73
6.592	JOHNSON & JOHNSON	USD	915.731,58	0,26
4.055	KLA CORP	USD	1.108.585,50	0,32
37.770	LOWES COS INC	USD	6.177.794,84	1,79
734	MASTERCARD INC - A	USD	225.968,51	0,07
16.052	MICRON TECHNOLOGY INC	USD	1.150.264,74	0,33
120.663	MICROSOFT CORP	USD	27.563.543,89	7,97
15.030	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	3.363.784,72	0,97
103.761	PACCAR INC	USD	7.808.979,89	2,26
13.817	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	3.396.052,92	0,98
60.592	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	6.894.070,80	1,99
53.316	PROGRESSIVE CORP	USD	4.415.350,67	1,28
231.132	QUALCOMM INC	USD	27.857.067,85	8,05
6.519	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	1.572.277,92	0,45
263.932	ROSS STORES INC	USD	27.597.240,91	7,98
20.069	SALESFORCE.COM INC	USD	4.133.784,16	1,20
49.874	STARBUCKS CORP	USD	4.702.261,52	1,36
29.880	TARGET CORP	USD	6.090.894,00	1,76
10.010	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	472.940,64	0,14
38.383	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	6.525.983,89	1,89
40.669	WALMART INC	USD	4.836.109,60	1,40
526	WORKDAY INC-CLASS A	USD	105.891,93	0,03
			321.906.292,09	**93,07**
	Belgien			
1.193	GALAPAGOS NV	EUR	69.766,64	0,02
			69.766,64	**0,02**
			321.976.058,73	**93,09**
Wertpapierbestand insgesamt			**321.976.058,73**	**93,09**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeits-datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in EUR
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 27	21.12.2021	EUR	346.014.680,70	(58.414,54)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 28	21.12.2021	EUR	311.413.230,92	(10.591.558,62)
				(10.649.973,16)
Total Return Swap insgesamt				**(10.649.973,16)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Netto-vermö-gens
Wertpapierbestand insgesamt	**321.976.058,73**	**93,09**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(10.649.973,16)**	**(3,08)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**34.665.693,91**	**10,02**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(98.335,51)**	**(0,03)**
Nettovermögen insgesamt	**345.893.443,97**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	93,09
	100,00	**93,09**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	99,98	93,07
Belgien	0,02	0,02
	100,00	**93,09**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		66.292.168,81
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	7.555.873,53
Wertpapierbestand zum Marktwert		73.848.042,34
Bankguthaben		48.581,56
Vermögen insgesamt		**73.896.623,90**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	45.280,39
Verbindlichkeiten insgesamt		**45.280,39**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**73.851.343,51**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		2.416.461,71
Bankzinsen		0,01
Erträge insgesamt		**2.416.461,72**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	166.252,02
Transaktionskosten	9	3.558,68
Bankzinsen		279,11
Aufwendungen insgesamt		**170.089,81**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**2.246.371,91**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	638.451,12
Fremdwährungsgeschäften		(0,55)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**2.884.822,48**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	14.419.832,50
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**17.304.654,98**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		4.784.399,60
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(7.560.570,04)
Ausschüttungen	10	(2.308.390,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		61.631.248,97
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**73.851.343,51**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	2.270.700	154.900	(254.600)	2.171.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
34.101	ALLIANZ SE	EUR	7.171.440,30	9,71
114.780	BASF SE	EUR	7.625.983,20	10,32
129.720	BAYER AG	EUR	6.642.961,20	9,00
42.311	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	3.778.795,41	5,12
25.505	COVESTRO AG	EUR	1.389.002,30	1,88
96.136	DAIMLER AG	EUR	7.239.040,80	9,80
129.739	DEUTSCHE POST AG	EUR	7.441.829,04	10,08
421.128	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	7.501.131,94	10,16
39.505	DEUTSCHE WOHNEN SE	EUR	2.037.667,90	2,76
274.440	E.ON AG	EUR	2.676.887,76	3,62
23.038	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	2.051.303,52	2,78
18.499	MUNICH RE	EUR	4.272.344,05	5,79
89.288	RWE AG	EUR	2.728.641,28	3,69
55.424	SIEMENS AG	EUR	7.405.754,88	10,03
71.263	VONOVIA SE	EUR	3.885.258,76	5,26
			73.848.042,34	**100,00**
			73.848.042,34	**100,00**
Wertpapierbestand insgesamt			**73.848.042,34**	**100,00**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**73.848.042,34**	**100,00**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**48.581,56**	**0,07**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(45.280,39)**	**(0,07)**
Nettovermögen insgesamt	**73.851.343,51**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	100,00
	100,00	**100,00**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	100,00	100,00
	100,00	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		70.908.385,29
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	1.892.370,90
Wertpapierbestand zum Marktwert		72.800.756,19
Bankguthaben**		7.318.385,12
Vermögen insgesamt		**80.119.141,31**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		3,09
Pauschalgebühr	6.2	56.360,81
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	2.379.442,29
Verbindlichkeiten insgesamt		**2.435.806,19**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**77.683.335,12**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Bankzinsen		3.305,73
Sonstige Erträge		16.952,54
Erträge insgesamt		**20.258,27**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	259.685,41
Bankzinsen		65.708,58
Aufwendungen insgesamt		**325.393,99**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(305.135,72)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	29.165.809,53
Fremdwährungsgeschäften		216.863,67
Swaps	2.2	(46.218.734,18)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**(17.141.196,70)**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(6.304.147,52)
Swaps	2.2, 7	726.896,94
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**(22.718.447,28)**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		31.876.473,50
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(42.309.043,50)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		110.834.352,40
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**77.683.335,12**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	5.641.000	1.915.000	(2.320.000)	5.236.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
20.852	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	USD	3.230.222,55	4,16
1.901	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	USD	76.302,89	0,10
29.202	APPLE INC	USD	3.372.549,05	4,34
3.985	ARROW ELECTRONICS INC	USD	382.504,89	0,49
52.557	CENTENE CORP	USD	3.232.129,19	4,16
1.837	COGNEX CORP	USD	130.196,35	0,17
39.219	DUKE ENERGY CORP	USD	3.264.777,54	4,20
45.705	EXPEDIA GROUP INC	USD	6.309.440,55	8,13
11.385	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	3.338.121,55	4,30
90.459	FOX CORP - CLASS B	USD	2.685.012,90	3,46
29.949	INCYTE CORP	USD	2.124.638,98	2,73
23.919	LAS VEGAS SANDS CORP	USD	1.062.730,51	1,37
84.565	MARATHON OIL CORP	USD	971.224,64	1,25
62.368	MARATHON PETROLEUM CORP-W/I	USD	3.177.565,19	4,09
25.864	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	USD	3.265.768,92	4,20
48.945	MICRON TECHNOLOGY INC	USD	3.507.332,91	4,51
14.634	MICROSOFT CORP	USD	3.342.904,63	4,30
60.684	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	USD	1.246.020,24	1,60
1.991	NORDSON CORP	USD	368.533,95	0,47
17.329	PPD INC	USD	673.491,53	0,87
37.030	PVH CORP	USD	3.359.522,47	4,32
3.402	QORVO INC	USD	561.262,59	0,72
81.629	SYNCHRONY FINANCIAL	USD	3.339.774,92	4,30
11.511	ULTA BEAUTY INC	USD	3.356.234,48	4,32
23.817	VAIL RESORTS INC	USD	6.356.823,37	8,19
74.679	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	3.312.979,33	4,26
15.926	WORKDAY INC-CLASS A	USD	3.206.149,96	4,13
29.078	XILINX INC	USD	3.546.540,11	4,57
			72.800.756,19	**93,71**
			72.800.756,19	**93,71**
Wertpapierbestand insgesamt			**72.800.756,19**	**93,71**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in EUR
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 29	21.12.2021	EUR	70.908.385,30	(1.897.696,90)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 31	21.12.2021	EUR	78.178.306,78	(481.745,39)
				(2.379.442,29)
Total Return Swap insgesamt				**(2.379.442,29)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**72.800.756,19**	**93,71**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(2.379.442,29)**	**(3,06)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**7.318.382,03**	**9,42**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(56.360,81)**	**(0,07)**
Nettovermögen insgesamt	**77.683.335,12**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	93,71
	100,00	**93,71**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	93,71
	100,00	**93,71**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		144.128.938,24
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	22.382.161,26
Wertpapierbestand zum Marktwert		166.511.099,50
Bankguthaben		343.929,70
Dividenden- und Zinsforderungen		21.399,73
Vermögen insgesamt		**166.876.428,93**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	310.141,01
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		97.384,80
Verbindlichkeiten insgesamt		**407.525,81**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**166.468.903,12**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		2.535.003,79
Bankzinsen		11,83
Erträge insgesamt		**2.535.015,62**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	1.034.719,81
Transaktionskosten	9	16.800,84
Bankzinsen		1.571,61
Aufwendungen insgesamt		**1.053.092,26**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**1.481.923,36**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	6.991.414,57
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**8.473.337,93**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	34.477.059,07
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**42.950.397,00**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		86.869.723,35
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(71.519.446,58)
Ausschüttungen	10	(794.925,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		108.963.154,35
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**166.468.903,12**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	1.066.150	694.900	(568.550)	1.192.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
136.308	AAREAL BANK AG	EUR	2.653.916,76	1,59
103.726	ADVA OPTICAL NETWORKING SE	EUR	1.211.519,68	0,73
12.911	AMADEUS FIRE AG	EUR	1.990.876,20	1,20
32.239	BAYWA-BAYERISCHE WARENVERMIT	EUR	1.173.499,60	0,70
57.291	BILFINGER SE	EUR	1.446.024,84	0,87
154.403	BORUSSIA DORTMUND GMBH & CO	EUR	959.614,65	0,58
404.604	CECONOMY AG	EUR	1.665.350,06	1,00
12.777	CEWE STIFTUNG + CO KGAA	EUR	1.668.676,20	1,00
45.810	DERMAPHARM HOLDING SE	EUR	3.080.722,50	1,85
118.983	DEUTSCHE EUROSHOP AG	EUR	2.379.660,00	1,43
323.197	DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG	EUR	2.694.816,59	1,62
290.478	DEUTZ AG	EUR	1.981.059,96	1,19
89.302	DIC ASSET AG	EUR	1.301.130,14	0,78
20.669	DRAEGERWERK AG - PREF	EUR	1.649.386,20	0,99
74.553	DWS GROUP GMBH & CO KGAA	EUR	2.849.415,66	1,71
34.026	ECKERT + ZIEGLER STRAHLEN UN	EUR	3.278.405,10	1,97
73.033	ELRINGKLINGER AG	EUR	1.096.225,33	0,66
57.214	FIELMANN AG	EUR	3.773.263,30	2,27
35.028	FLATEXDEGIRO AG	EUR	3.975.678,00	2,39
66.110	GRENKE AG	EUR	2.446.070,00	1,47
175.559	HAMBORNER REIT AG	EUR	1.576.344,26	0,95
53.455	HAMBURGER HAFEN UND LOGISTIK	EUR	1.133.246,00	0,68
80.653	HENSOLDT AG	EUR	1.225.925,60	0,74
65.316	HOME24 SE	EUR	1.028.727,00	0,62
20.977	HORNBACH HOLDING AG & CO KGA	EUR	2.015.889,70	1,21
9.757	HYPOPORT SE	EUR	4.254.052,00	2,56
49.831	INDUS HOLDING AG	EUR	1.664.355,40	1,00
112.931	INSTONE REAL ESTATE GROUP AG	EUR	2.868.447,40	1,72
122.433	JENOPTIK AG	EUR	2.823.304,98	1,70
32.036	JOST WERKE AG	EUR	1.611.410,80	0,97
115.363	JUNGHEINRICH - PRFD	EUR	4.755.262,86	2,86
179.205	KLOECKNER & CO SE	EUR	2.068.025,70	1,24
31.868	KRONES AG	EUR	2.401.253,80	1,44
24.698	KWS SAAT SE & CO KGAA	EUR	1.714.041,20	1,03
58.875	LPKF LASER & ELECTRONICS	EUR	1.445.970,00	0,87
27.745	MEDIOS AG	EUR	932.232,00	0,56
314.528	METRO AG	EUR	3.283.672,32	1,97
15.940	NAGARRO SE	EUR	1.649.790,00	0,99
6.722	NEW WORK SE	EUR	1.781.330,00	1,07
76.578	NORMA GROUP SE	EUR	3.306.638,04	1,99
58.191	OSRAM LICHT AG	EUR	3.101.580,30	1,86
100.058	PATRIZIA AG	EUR	2.201.276,00	1,32
9.434	PFEIFFER VACUUM TECHNOLOGY	EUR	1.511.326,80	0,91
109.100	SAF-HOLLAND SE	EUR	1.279.743,00	0,77
77.274	SALZGITTER AG	EUR	1.936.486,44	1,16
299.222	SCHAEFFLER AG - PREF	EUR	2.327.947,16	1,40
134.433	SGL CARBON SE	EUR	1.087.562,97	0,65
21.436	SILTRONIC AG	EUR	3.048.199,20	1,83
30.442	SIXT SE	EUR	3.458.211,20	2,08
45.168	SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	EUR	2.185.227,84	1,31
17.287	STRATEC SE	EUR	2.036.408,60	1,22
150.017	SUEDZUCKER AG	EUR	2.025.229,50	1,22
39.046	SUESS MICROTEC SE	EUR	1.081.574,20	0,65
78.449	TAKKT AG	EUR	1.099.854,98	0,66
127.347	TALANX AG	EUR	4.390.924,56	2,64
123.534	TRATON SE	EUR	3.303.299,16	1,98
230.355	VANTAGE TOWERS AG	EUR	6.256.441,80	3,75
42.929	VERBIO VEREINIGTE BIOENERGI	EUR	1.833.926,88	1,10
21.069	VOSSLOH AG	EUR	896.485,95	0,54
69.065	WACKER NEUSON SE	EUR	1.674.135,60	1,01
30.923	WESTWING GROUP AG	EUR	1.426.787,22	0,86
35.509	ZEAL NETWORK SE	EUR	1.487.827,10	0,89
15.474	ZOOPLUS AG	EUR	4.227.496,80	2,54
104.594	1&1 AG	EUR	2.698.525,20	1,62
			143.391.708,29	**86,14**
	Luxemburg			
211.670	ADLER GROUP SA	EUR	4.694.840,60	2,82
81.876	BEFESA SA	EUR	5.305.564,80	3,19
204.253	GLOBAL FASHION GROUP SA	EUR	2.608.310,81	1,57
85.390	RTL GROUP	EUR	4.290.847,50	2,58
59.364	STABILUS SA	EUR	4.069.402,20	2,44
			20.968.965,91	**12,60**
	Österreich			
111.421	S&T AG	EUR	2.150.425,30	1,29
			2.150.425,30	**1,29**
			166.511.099,50	**100,03**
Wertpapierbestand insgesamt			**166.511.099,50**	**100,03**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**166.511.099,50**	**100,03**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**343.929,70**	**0,21**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(386.126,08)**	**(0,24)**
Nettovermögen insgesamt	**166.468.903,12**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	100,03
	100,00	**100,03**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	86,12	86,14
Luxemburg	12,59	12,60
Österreich	1,29	1,29
	100,00	**100,03**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor SPI® UCITS ETF* (in CHF)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	CHF
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		16.234.995,79
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	948.119,02
Wertpapierbestand zum Marktwert		17.183.114,81
Bankguthaben**		1.835.514,89
Vermögen insgesamt		**19.018.629,70**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		5,01
Pauschalgebühr	6.2	17.412,89
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	685.248,09
Verbindlichkeiten insgesamt		**702.665,99**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**18.315.963,71**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	CHF
Erträge		
Bankzinsen		1.657,51
Sonstige Erträge		348,92
Erträge insgesamt		**2.006,43**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	67.773,95
Bankzinsen		15.756,99
Aufwendungen insgesamt		**83.530,94**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(81.524,51)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	4.379.769,12
Fremdwährungsgeschäften		(88,57)
Swaps	2.2	(559.543,17)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**3.738.612,87**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	548.173,92
Swaps	2.2, 7	(870.999,99)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**3.415.786,80**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		-
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(1.163.067,00)
Ausschüttungen	10	(326.800,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		16.390.043,91
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**18.315.963,71**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	152.000	-	(10.000)	142.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor SPI® UCITS ETF* (in CHF)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in CHF	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
10.203	ALASKA AIR GROUP INC	USD	568.799,16	3,11
217	AMAZON.COM INC	USD	690.049,28	3,77
23.196	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	USD	1.299.353,90	7,09
25.593	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	1.211.957,19	6,62
2.903	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	745.776,28	4,07
5.506	COGNEX CORP	USD	427.775,25	2,34
2.949	COUPA SOFTWARE INC	USD	714.496,48	3,90
12.303	DATADOG INC - CLASS A	USD	1.183.641,10	6,46
16.124	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	USD	517.033,66	2,82
3.660	ENPHASE ENERGY INC	USD	621.250,07	3,39
5.647	FISERV INC	USD	557.951,69	3,05
14.031	LKQ CORP	USD	638.369,26	3,49
11.610	MARATHON PETROLEUM CORP-W/I	USD	648.417,41	3,54
2.695	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	630.411,32	3,44
9.450	NEWS CORP/NEW-CL B-W/I	USD	212.702,46	1,16
5.483	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	1.477.300,13	8,06
13.222	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	USD	730.136,57	3,99
6.403	PVH CORP	USD	636.791,32	3,48
16.246	TAPESTRY INC	USD	652.946,67	3,56
10.239	T-MOBILE US INC	USD	1.370.748,57	7,47
5.852	WASTE MANAGEMENT INC	USD	757.905,71	4,14
15.248	WELLS FARGO & CO	USD	638.347,16	3,49
1.877	XILINX INC	USD	250.954,17	1,37
			17.183.114,81	**93,81**
			17.183.114,81	**93,81**
Wertpapierbestand insgesamt			**17.183.114,81**	**93,81**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in CHF
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 54	15.12.2021	CHF	18.274.419,68	49.776,58
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 55	15.12.2021	CHF	16.451.805,55	(735.024,67)
				(685.248,09)
Total Return Swap insgesamt				**(685.248,09)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**17.183.114,81**	**93,81**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(685.248,09)**	**(3,74)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.835.509,88**	**10,02**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(17.412,89)**	**(0,09)**
Nettovermögen insgesamt	**18.315.963,71**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor SPI® UCITS ETF* (in CHF)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	93,81
	100,00	**93,81**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	93,81
	100,00	**93,81**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		814.677.195,27
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	(2.193.667,01)
Wertpapierbestand zum Marktwert		812.483.528,26
Bankguthaben**		70.517.545,99
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	4.922.356,92
Vermögen insgesamt		**887.923.431,17**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		4.422,12
Pauschalgebühr	6.2	298.469,96
Verbindlichkeiten insgesamt		**302.892,08**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**887.620.539,09**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
***Die Anteilklasse „I Acc“ wurde am 3. Dezember 2020 aufgelegt.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		80,14
Bankzinsen		508,08
Sonstige Erträge		574.449,59
Erträge insgesamt		**575.037,81**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	911.804,44
Bankzinsen		9.373,56
Aufwendungen aus Swaps		299.751,23
Aufwendungen insgesamt		**1.220.929,23**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(645.891,42)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	180.449.675,09
Fremdwährungsgeschäften		(655.997,12)
Swaps	2.2	24.444.001,32
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**203.591.787,87**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(22.600.576,94)
Swaps	2.2, 7	8.592.857,22
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**189.584.068,15**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		343.347.342,60
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(13.130.726,00)
Ausschüttungen	10	(8.253.750,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		376.073.604,34
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**887.620.539,09**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	8.550.000	5.534.000	(10.000)	14.074.000
Anteilklasse I Acc***	-	741.000	(210.000)	531.000

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
103.602	ADIDAS AG	EUR	38.566.259,94	4,34
189.991	ALLIANZ SE	EUR	47.382.761,75	5,35
448.388	BASF SE	EUR	35.329.026,79	3,98
577.573	BAYER AG	EUR	35.075.973,06	3,95
138.866	DELIVERY HERO SE	EUR	18.345.484,50	2,07
4.681.921	DEUTSCHE BANK AG	EUR	60.997.459,20	6,88
29.213	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	4.207.476,96	0,47
17.627	MERCK KGAA	EUR	3.380.154,05	0,38
130.263	MUNICH RE	EUR	35.676.900,04	4,02
241.487	SAP AG	EUR	34.033.331,85	3,83
353.867	SIEMENS AG	EUR	56.073.749,96	6,33
641.740	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	20.365.416,11	2,29
144.362	VOLKSWAGEN AG	EUR	36.157.206,79	4,07
241.730	VONOVIA SE	EUR	15.629.117,93	1,76
			441.220.318,93	**49,72**
	Niederlande			
4.872	ADYEN NV	EUR	11.904.960,74	1,34
4.340.404	ING GROEP NV	EUR	57.340.756,05	6,47
690.161	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	EUR	20.518.840,58	2,31
143.090	NN GROUP NV - W/I	EUR	6.750.285,35	0,76
187.005	PROSUS NV	EUR	18.289.308,36	2,06
1.881.598	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	EUR	37.942.505,71	4,27
			152.746.656,79	**17,21**
	Portugal			
13.829.513	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	EUR	73.309.875,02	8,26
			73.309.875,02	**8,26**
	Finnland			
812.669	FORTUM OYJ	EUR	22.416.689,33	2,53
380.562	NESTE OYJ	EUR	23.305.569,69	2,62
105.847	NOKIAN RENKAAT OYJ	EUR	4.274.090,75	0,48
			49.996.349,77	**5,63**
	Irland			
128.898	LINDE PLC	EUR	37.198.514,63	4,19
			37.198.514,63	**4,19**
	Belgien			
203.916	AGEAS	EUR	11.317.362,47	1,28
237.458	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	17.124.183,70	1,92
			28.441.546,17	**3,20**
	Schweiz			
713	BARRY CALLEBAUT AG-REG	CHF	1.658.388,44	0,19
113.830	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	CHF	13.804.498,05	1,56
32.304	NESTLE SA-REG	CHF	4.026.636,67	0,45
1.278	SONOVA HOLDING AG-REG	CHF	481.136,57	0,05
			19.970.659,73	**2,25**
	Österreich			
268.152	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	EUR	6.073.827,82	0,68
			6.073.827,82	**0,68**
	Vereinigte Staaten			
10.140	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	3.525.779,40	0,40
			3.525.779,40	**0,40**
			812.483.528,26	**91,54**
Wertpapierbestand insgesamt			**812.483.528,26**	**91,54**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 27	17.12.2021	USD	877.614.724,06	9.920.338,53
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 28	17.12.2021	USD	807.405.524,00	(4.997.981,61)
				4.922.356,92
Total Return Swap insgesamt				**4.922.356,92**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**812.483.528,26**	**91,54**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**4.922.356,92**	**0,55**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**70.513.123,87**	**7,94**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(298.469,96)**	**(0,03)**
Nettovermögen insgesamt	**887.620.539,09**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	91,54
	100,00	**91,54**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	54,31	49,72
Niederlande	18,80	17,21
Portugal	9,02	8,26
Finnland	6,15	5,63
Irland	4,58	4,19
Belgien	3,50	3,20
Schweiz	2,46	2,25
Sonstige	1,18	1,08
	100,00	**91,54**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		73.291.371,03
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	14.321.336,80
Wertpapierbestand zum Marktwert		87.612.707,83
Bankguthaben		1.706.393,41
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		251.030,89
Dividenden- und Zinsforderungen		11.848,75
Vermögen insgesamt		**89.581.980,88**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	32.418,90
Verbindlichkeiten aus dem Rückkauf von Fondsanteilen		250.875,56
Verbindlichkeiten insgesamt		**283.294,46**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**89.298.686,42**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		1.932.463,80
Bankzinsen		0,01
Erträge insgesamt		**1.932.463,81**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	121.769,70
Transaktionskosten	9	1.264,09
Bankzinsen		4.277,51
Aufwendungen insgesamt		**127.311,30**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**1.805.152,51**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	1.123.305,20
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**2.928.457,71**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	16.973.682,16
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**19.902.139,87**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		3.587.143,90
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(8.621.973,86)
Ausschüttungen	10	(1.691.646,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		76.123.022,51
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**89.298.686,42**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	3.020.800	125.200	(306.900)	2.839.100

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
2.928	AAREAL BANK AG	EUR	57.008,16	0,06
9.803	ADIDAS AG	EUR	3.077.161,70	3,45
20.166	ALLIANZ SE	EUR	4.240.909,80	4,75
8.696	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	EUR	135.570,64	0,15
2.199	AURUBIS AG	EUR	171.873,84	0,19
44.923	BASF SE	EUR	2.984.684,12	3,34
48.051	BAYER AG	EUR	2.460.691,71	2,76
29.444	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	2.629.643,64	2,94
2.054	BECHTLE AG	EUR	321.759,10	0,36
12.325	BEIERSDORF AG	EUR	1.254.068,75	1,40
2.162	BILFINGER SE	EUR	54.568,88	0,06
11.813	BIONTECH SE-ADR	EUR	2.258.645,60	2,53
7.557	BRENNTAG SE	EUR	592.619,94	0,66
4.375	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	EUR	712.906,25	0,80
17.449	CECONOMY AG	EUR	71.820,08	0,08
61.254	COMMERZBANK AG	EUR	366.421,43	0,41
2.628	COMPUGROUP MEDICAL SE & CO K	EUR	173.579,40	0,19
9.782	CONTINENTAL AG	EUR	1.212.772,36	1,36
9.450	COVESTRO AG	EUR	514.647,00	0,58
4.695	CTS EVENTIM AG + CO KGAA	EUR	247.426,50	0,28
52.327	DAIMLER AG	EUR	3.940.223,10	4,41
12.180	DELIVERY HERO SE	EUR	1.356.852,00	1,52
101.087	DEUTSCHE BANK AG	EUR	1.110.541,78	1,24
9.293	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	1.367.929,60	1,53
3.022	DEUTSCHE EUROSHOP AG	EUR	60.440,00	0,07
29.236	DEUTSCHE LUFTHANSA AG	EUR	277.449,64	0,31
60.603	DEUTSCHE POST AG	EUR	3.476.188,08	3,89
232.886	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	4.148.165,43	4,65
17.600	DEUTSCHE WOHNEN SE	EUR	907.808,00	1,02
3.385	DUERR AG	EUR	108.590,80	0,12
6.771	ENCAVIS AG	EUR	107.929,74	0,12
129.189	E.ON AG	EUR	1.260.109,51	1,41
22.792	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	644.557,76	0,72
8.049	EVOTEC SE	EUR	307.713,27	0,34
4.108	FIELMANN AG	EUR	270.922,60	0,30
4.523	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	EUR	259.891,58	0,29
6.264	FREENET AG	EUR	124.778,88	0,14
14.325	FRESENIUS MEDICAL CARE GMBH & CO. KGAA	EUR	1.003.323,00	1,12
27.270	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	1.199.743,65	1,34
3.399	FUCHS PETROLUB SE-PREF	EUR	139.426,98	0,16
8.828	GEA GROUP AG	EUR	301.564,48	0,34
1.536	GERRESHEIMER AG	EUR	143.232,00	0,16
2.274	GRENKE AG	EUR	84.138,00	0,09
5.898	HANNOVER RUECK SE	EUR	832.207,80	0,93
8.597	HAPAG-LLOYD AG	EUR	1.668.677,70	1,87
9.705	HEIDELBERGCEMENT AG	EUR	702.059,70	0,79
5.435	HELLA GMBH & CO KGAA	EUR	313.925,60	0,35
8.714	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	775.894,56	0,87
3.455	HOCHTIEF AG	EUR	223.745,80	0,25
3.443	HUGO BOSS AG -ORD	EUR	157.964,84	0,18
63.874	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	2.160.218,68	2,42
2.348	JUNGHEINRICH - PRFD	EUR	96.784,56	0,11
6.417	KION GROUP AG	EUR	576.759,96	0,65
7.884	KNORR-BREMSE AG	EUR	764.748,00	0,86
1.545	KRONES AG	EUR	116.415,75	0,13
9.362	K+S AG	EUR	107.475,76	0,12
4.277	LANXESS AG	EUR	247.296,14	0,28
3.526	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	428.232,70	0,48
6.321	MERCK KGAA	EUR	1.022.105,70	1,14
15.747	METRO AG	EUR	164.398,68	0,18
1.609	MORPHOSYS AG	EUR	105.260,78	0,12
2.612	MTU AERO ENGINES AG	EUR	545.646,80	0,61
6.852	MUNICH RE	EUR	1.582.469,40	1,77
5.649	NEMETSCHEK AKT	EUR	364.473,48	0,41
5.740	NORDEX SE	EUR	117.555,20	0,13
1.558	NORMA GROUP SE	EUR	67.274,44	0,08
7.489	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	EUR	676.706,04	0,76
11.396	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	EUR	191.167,90	0,21
7.377	PUMA SE	EUR	741.757,35	0,83
556	RATIONAL AG	EUR	424.784,00	0,48
2.131	RHEINMETALL AG	EUR	177.512,30	0,20
33.074	RWE AG	EUR	1.010.741,44	1,13
2.939	SALZGITTER AG	EUR	73.651,34	0,08
60.087	SAP AG	EUR	7.140.739,08	8,01
1.831	SARTORIUS AG-VORZUG	EUR	803.809,00	0,90
8.119	SCHAEFFLER AG - PREF	EUR	63.165,82	0,07
5.170	SCOUT24 AG	EUR	367.690,40	0,41
41.574	SIEMENS AG	EUR	5.555.117,88	6,23
35.541	SIEMENS ENERGY AG	EUR	903.452,22	1,01
1.485	SIXT SE	EUR	168.696,00	0,19
1.697	SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	EUR	82.100,86	0,09
3.619	SOFTWARE AG	EUR	137.304,86	0,15
2.771	STROEER SE + CO KGAA	EUR	187.181,05	0,21
9.987	SUEDZUCKER AG	EUR	134.824,50	0,15
6.624	SYMRISE AG	EUR	778.320,00	0,87
7.165	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	191.735,40	0,21
12.365	TALANX AG	EUR	426.345,20	0,48
9.835	TEAMVIEWER AG	EUR	311.966,20	0,35
145.488	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	EUR	323.710,80	0,36
30.448	THYSSENKRUPP AG	EUR	267.637,92	0,30
53.772	TUI AG-DI	EUR	231.918,64	0,26
17.899	UNIPER SE	EUR	555.942,94	0,62
9.489	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	EUR	327.180,72	0,37
10.086	VOLKSWAGEN AG	EUR	2.130.163,20	2,39
27.678	VONOVIA SE	EUR	1.509.004,56	1,69
2.551	WACKER CHEMIE AG	EUR	331.757,55	0,37
12.763	ZALANDO SE	EUR	1.301.187,85	1,46
8.646	1&1 AG	EUR	223.066,80	0,25
			87.032.230,63	**97,46**
	Niederlande			
9.127	CUREVAC NV	EUR	580.477,20	0,65
			580.477,20	**0,65**
			87.612.707,83	**98,11**
Wertpapierbestand insgesamt			**87.612.707,83**	**98,11**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**87.612.707,83**	**98,11**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**1.706.393,41**	**1,91**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(20.414,82)**	**(0,02)**
Nettovermögen insgesamt	**89.298.686,42**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	98,11
	100,00	**98,11**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	99,34	97,46
Niederlande	0,66	0,65
	100,00	**98,11**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		35.814.351,56
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	3.240.345,67
Wertpapierbestand zum Marktwert		39.054.697,23
Bankguthaben**		4.315.041,92
Vermögen insgesamt		**43.369.739,15**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		0,71
Pauschalgebühr	6.2	40.537,16
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2.2, 7	838.798,00
Verbindlichkeiten insgesamt		**879.335,87**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**42.490.403,28**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Im Bankguthaben sind gestellte Sicherheiten für Swaps enthalten; siehe Erläuterung 7 in den Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	USD
Erträge		
Bankzinsen		126,66
Sonstige Erträge		12.856,15
Erträge insgesamt		**12.982,81**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	123.074,04
Bankzinsen		525,71
Aufwendungen aus Swaps		13.604,24
Aufwendungen insgesamt		**137.203,99**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(124.221,18)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	8.384.700,83
Fremdwährungsgeschäften		48.804,71
Swaps	2.2	(1.521.911,88)
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**6.787.372,48**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	1.724.326,86
Swaps	2.2, 7	(811.389,69)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**7.700.309,65**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		16.413.443,50
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		-
Ausschüttungen	10	(349.535,90)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		18.726.186,03
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**42.490.403,28**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	122.390	77.500	-	199.890

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF* (in USD)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
10.848	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	USD	1.992.886,08	4,69
732	ALPHABET INC-CL A	USD	1.787.390,28	4,21
542	AMAZON.COM INC	USD	1.864.566,72	4,39
14.168	APPLE INC	USD	1.940.449,28	4,57
3.881	AUTODESK INC	USD	1.132.863,90	2,67
7.299	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	USD	2.028.538,08	4,77
3.388	BIOGEN INC	USD	1.173.162,76	2,76
1.072	CADENCE DESIGN SYS INC	USD	146.671,04	0,35
287	CONAGRA BRANDS INC	USD	10.441,06	0,02
317	DATADOG INC - CLASS A	USD	32.993,36	0,08
6.801	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	704.379,57	1,66
6.780	FACEBOOK INC-CLASS A	USD	2.357.473,80	5,55
9.714	HERSHEY CO/THE	USD	1.691.984,52	3,98
31.317	INTEL CORP	USD	1.758.136,38	4,14
4.354	INTUIT INC	USD	2.134.200,18	5,02
7.973	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.932.017,36	4,55
2.675	LAM RESEARCH CORP	USD	1.740.622,50	4,10
12.193	MICROSOFT CORP	USD	3.303.083,70	7,76
4.719	MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD	1.023.315,15	2,41
2.500	NVIDIA CORP	USD	2.000.250,00	4,71
37.630	ORACLE CORP	USD	2.929.119,20	6,89
3.199	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	932.444,52	2,19
12.976	PEPSICO INC	USD	1.922.653,92	4,52
308	QUALCOMM INC	USD	44.022,44	0,10
9.860	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	1.896.078,00	4,46
1.195	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	478.525,80	1,13
1.721	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	96.427,63	0,23
			39.054.697,23	**91,91**
			39.054.697,23	**91,91**
Wertpapierbestand insgesamt			**39.054.697,23**	**91,91**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in USD
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 28	17.12.2021	USD	42.641.302,57	(164.241,71)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 29	17.12.2021	USD	38.377.269,04	(674.556,29)
				(838.798,00)
Total Return Swap insgesamt				**(838.798,00)**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**39.054.697,23**	**91,91**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**(838.798,00)**	**(1,97)**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**4.315.041,21**	**10,16**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(40.537,16)**	**(0,10)**
Nettovermögen insgesamt	**42.490.403,28**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF* (in USD)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	91,91
	100,00	**91,91**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	91,91
	100,00	**91,91**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		205.849.513,33
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	47.817.969,84
Wertpapierbestand zum Marktwert		253.667.483,17
Bankguthaben		424.552,00
Dividenden- und Zinsforderungen		72.303,10
Vermögen insgesamt		**254.164.338,27**
Verbindlichkeiten		
Pauschalgebühr	6.2	183.722,31
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		22.246,58
Verbindlichkeiten insgesamt		**205.968,89**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**253.958.369,38**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Dividenden (nach Abzug der Quellensteuer)		2.961.653,32
Bankzinsen		13,54
Erträge insgesamt		**2.961.666,86**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	645.439,66
Transaktionskosten	9	13.109,78
Bankzinsen		765,89
Aufwendungen insgesamt		**659.315,33**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**2.302.351,53**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	9.392.495,73
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**11.694.847,26**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	46.069.917,19
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**57.764.764,45**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		34.927.309,57
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(14.166.163,55)
Ausschüttungen	10	(1.672.990,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		177.105.448,91
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**253.958.369,38**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	7.527.600	1.293.400	(519.500)	8.301.500

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Deutschland			
84.873	AIXTRON SE	EUR	1.939.348,05	0,76
128.059	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	EUR	1.996.439,81	0,79
24.574	AURUBIS AG	EUR	1.920.703,84	0,76
79.461	AUTO1 GROUP SE	EUR	2.944.030,05	1,16
20.688	BECHTLE AG	EUR	3.240.775,20	1,28
74.175	BEIERSDORF AG	EUR	7.547.306,25	2,97
117.117	BRENNTAG SE	EUR	9.184.315,14	3,62
29.650	CANCOM SE	EUR	1.512.150,00	0,60
27.703	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	EUR	4.514.203,85	1,78
753.676	COMMERZBANK AG	EUR	4.508.489,83	1,78
19.613	COMPUGROUP MEDICAL SE & CO K	EUR	1.295.438,65	0,51
44.507	CTS EVENTIM AG + CO KGAA	EUR	2.345.518,90	0,92
380.387	DEUTSCHE LUFTHANSA AG	EUR	3.609.872,63	1,42
37.266	DUERR AG	EUR	1.195.493,28	0,47
76.386	ENCAVIS AG	EUR	1.217.592,84	0,48
145.148	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	4.104.785,44	1,62
103.240	EVOTEC SE	EUR	3.946.865,20	1,55
27.926	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	EUR	1.604.627,96	0,63
101.238	FREENET AG	EUR	2.016.660,96	0,79
52.684	FUCHS PETROLUB SE-PREF	EUR	2.161.097,68	0,85
112.343	GEA GROUP AG	EUR	3.837.636,88	1,51
21.410	GERRESHEIMER AG	EUR	1.996.482,50	0,79
45.507	HANNOVER RUECK SE	EUR	6.421.037,70	2,53
33.691	HELLA GMBH & CO KGAA	EUR	1.945.992,16	0,77
131.558	HELLOFRESH SE	EUR	10.785.124,84	4,25
16.178	HOCHTIEF AG	EUR	1.047.687,28	0,41
41.332	HUGO BOSS AG -ORD	EUR	1.896.312,16	0,75
54.381	KION GROUP AG	EUR	4.887.764,28	1,92
50.112	KNORR-BREMSE AG	EUR	4.860.864,00	1,91
145.088	K+S AG	EUR	1.665.610,24	0,66
61.973	LANXESS AG	EUR	3.583.278,86	1,41
54.651	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	6.637.363,95	2,61
24.853	MORPHOSYS AG	EUR	1.625.883,26	0,64
42.402	NEMETSCHEK AKT	EUR	2.735.777,04	1,08
59.511	NORDEX SE	EUR	1.218.785,28	0,48
116.074	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING	EUR	10.488.446,64	4,13
149.635	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	EUR	2.510.127,13	0,99
69.467	PUMA SE	EUR	6.984.906,85	2,75
3.866	RATIONAL AG	EUR	2.953.624,00	1,16
32.745	RHEINMETALL AG	EUR	2.727.658,50	1,07
18.649	SARTORIUS AG-VORZUG	EUR	8.186.911,00	3,22
63.825	SCOUT24 AG	EUR	4.539.234,00	1,79
210.774	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	10.892.800,32	4,29
38.655	SOFTWARE AG	EUR	1.466.570,70	0,58
20.889	STROEER SE + CO KGAA	EUR	1.411.051,95	0,56
92.146	SYMRISE AG	EUR	10.827.155,00	4,26
111.051	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	2.971.724,76	1,17
121.981	TEAMVIEWER AG	EUR	3.869.237,32	1,52
694.034	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	EUR	1.544.225,65	0,61
373.133	THYSSENKRUPP AG	EUR	3.279.839,07	1,29
69.325	UNIPER SE	EUR	2.153.234,50	0,85
71.750	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	EUR	2.473.940,00	0,97
13.638	VARTA AG	EUR	1.772.940,00	0,70
11.370	WACKER CHEMIE AG	EUR	1.478.668,50	0,58
133.901	ZALANDO SE	EUR	13.651.206,95	5,37
			214.134.818,83	**84,32**
	Niederlande			
224.861	AIRBUS SE	EUR	24.374.932,40	9,60
173.297	QIAGEN N.V.	EUR	7.063.585,72	2,78
10.123	SHOP APOTHEKE EUROPE NV	EUR	1.603.483,20	0,63
			33.042.001,32	**13,01**
	Luxemburg			
739.620	AROUNDTOWN SA	EUR	4.866.699,60	1,92
71.289	GRAND CITY PROPERTIES	EUR	1.623.963,42	0,64
			6.490.663,02	**2,56**
			253.667.483,17	**99,89**
Wertpapierbestand insgesamt			**253.667.483,17**	**99,89**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**253.667.483,17**	**99,89**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**424.552,00**	**0,17**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(133.665,79)**	**(0,06)**
Nettovermögen insgesamt	**253.958.369,38**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	99,89
	100,00	**99,89**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Deutschland	84,41	84,32
Niederlande	13,03	13,01
Luxemburg	2,56	2,56
	100,00	**99,89**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Nettovermögens zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Vermögen		
Wertpapierbestand zu Einstandskosten		35.355.629,50
Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Wertpapieren	2.2	1.482.113,36
Wertpapierbestand zum Marktwert		36.837.742,86
Bankguthaben		3.942.690,14
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2.2, 7	208.041,97
Vermögen insgesamt		**40.988.474,97**
Verbindlichkeiten		
Bankverbindlichkeiten		1,02
Pauschalgebühr	6.2	33.710,96
Verbindlichkeiten insgesamt		**33.711,98**
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**40.954.762,99**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. Juni 2021

	Erläuterungen	EUR
Erträge		
Bankzinsen		7.574,71
Sonstige Erträge		92.895,62
Erträge insgesamt		**100.470,33**
Aufwendungen		
Pauschalgebühr	6.1, 6.2	222.885,68
Bankzinsen		66.044,55
Aufwendungen aus Swaps		12.583,77
Aufwendungen insgesamt		**301.514,00**
Ordentlicher Nettoertrag (Nettoverlust)		**(201.043,67)**
Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus:		
Wertpapieranlagen	2.3	40.858.109,82
Fremdwährungsgeschäften		494.980,61
Swaps	2.2	36.184.786,15
Realisierter Nettogewinn (Nettoverlust) für das Geschäftsjahr		**77.336.832,91**
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus:		
Wertpapieranlagen	2.2	(29.428.342,30)
Swaps	2.2, 7	(9.134.188,53)
Ergebnis aus Geschäftstätigkeit		**38.774.302,08**
Mittelzuflüsse aus der Zeichnung von Anteilen		23.534.939,74
Mittelabflüsse aus der Rücknahme von Anteilen		(245.276.108,50)
Ausschüttungen	10	(28.656,00)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		223.950.285,67
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		**40.954.762,99**

Veränderung der Anzahl der Anteile

	Zu Beginn des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile	Anzahl der ausgegebenen Anteile	Anzahl der zurückgenommenen Anteile	Zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindliche Anteile
Anteilklasse I D	4.036.000	362.600	(3.878.000)	520.600

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF* (in EUR)

Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2021

Bestand	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
	An einer amtlichen Börse notierte Wertpapiere			
	Aktien			
	Vereinigte Staaten			
25.542	ADVANCED MICRO DEVICES	USD	2.023.071,14	4,94
14.938	APPLIED MATERIALS INC	USD	1.793.718,86	4,38
81.938	BANK OF AMERICA CORP	USD	2.848.725,64	6,96
2.354	BLACKROCK INC	USD	1.736.806,97	4,24
8.634	CIGNA CORP	USD	1.725.999,14	4,21
37.427	COCA-COLA CO/THE	USD	1.707.711,42	4,17
14.349	ELECTRONIC ARTS INC	USD	1.740.295,70	4,25
30.390	GILEAD SCIENCES INC	USD	1.764.613,71	4,31
5.515	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	1.764.995,32	4,31
3.203	LAM RESEARCH CORP	USD	1.757.477,11	4,29
8.686	MCDONALDS CORP	USD	1.691.862,00	4,13
26.709	MERCK & CO. INC.	USD	1.751.546,45	4,28
13.250	MICROSOFT CORP	USD	3.026.751,83	7,39
6.926	NETFLIX INC	USD	3.084.899,62	7,53
7.612	PAYPAL HOLDINGS INC-W/I	USD	1.870.938,33	4,57
23.183	PEPSICO INC	USD	2.896.555,45	7,07
5.052	QUALCOMM INC	USD	608.889,75	1,49
4.368	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	1.858.103,52	4,54
31.023	WELLS FARGO & CO	USD	1.184.780,90	2,89
			36.837.742,86	**89,95**
			36.837.742,86	**89,95**
Wertpapierbestand insgesamt			**36.837.742,86**	**89,95**

Derivative Finanzinstrumente zum 30. Juni 2021

Kontraktart	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) in EUR
	Total Return Swap**			
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 38	17.12.2021	EUR	35.238.851,84	(1.602.626,32)
TOTAL RETURN EQUITY SWAP 39	17.12.2021	EUR	39.154.288,60	1.810.668,29
				208.041,97
Total Return Swap insgesamt				**208.041,97**

Nettovermögen im Überblick

		% des Nettovermögens
Wertpapierbestand insgesamt	**36.837.742,86**	**89,95**
Derivative Finanzinstrumente insgesamt	**208.041,97**	**0,51**
Bankguthaben und Bankverbindlichkeiten	**3.942.689,12**	**9,63**
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**(33.710,96)**	**(0,09)**
Nettovermögen insgesamt	**40.954.762,99**	**100,00**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.
**Siehe Erläuterung 7 in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Die beigefügten Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Jahresberichtes.

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF* (in EUR)

Aufschlüsselung des Wertpapierbestands

Aufgliederung nach Vermögenskategorien	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Aktien	100,00	89,95
	100,00	**89,95**

Aufgliederung nach Ländern	% des Wertpapierbestands	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten	100,00	89,95
	100,00	**89,95**

*Weitere Informationen befinden sich im Teil 1.2 „Namensänderung von Teilfonds“ in den „Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021“.

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021

Erläuterung 1 - Allgemeines

Lyxor (vormals ComStage) (die „Gesellschaft“) ist im Großherzogtum Luxemburg als Organismus für gemeinsame Anlagen gemäß Teil I des abgeänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung (das „Gesetz“) registriert.

Die Gesellschaft wurde am 17. Juli 2008 als offene Investmentgesellschaft („*Société d'Investissement à Capital Variable*“, „SICAV“) für eine unbestimmte Zeit gegründet. Die Gesellschaft unterliegt zum einen dem Luxemburger Gesetz vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften in der jeweils abgeänderten Fassung und zum anderen dem Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010. Seit dem 1. Juli 2011 unterliegt die Verwaltungsgesellschaft Kapitel 15 des abgeänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010.

Die Satzung in ihrer ursprünglichen Fassung wurde am 20. August 2008 im Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations („Mémorial“), mit letztmaliger Änderung am 11. November 2020, veröffentlicht. Das Mémorial wurde ab dem 1. Juni 2016 durch eine elektronische Sammlung der Gesellschaften und Vereinigungen „Recueil électronique des sociétés et associations“ („RESA“) ersetzt.

Die Gesellschaft wurde beim Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg unter der Nummer B 140.772 eingetragen.

Die Gesellschaft ist derzeit als Umbrella-Fonds konstruiert, um sowohl institutionellen als auch privaten Anlegern Gelegenheit zu geben, unter verschiedenen Teilfonds (die „Teilfonds“ bzw. einzeln ein „Teilfonds“) auszuwählen, deren Wertentwicklung vollständig oder teilweise an die Wertentwicklung eines zugrunde liegenden Index (der „Index“) oder eines Wertpapierkorbes (der „Basket“) gekoppelt sein kann.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft kann die Auflegung verschiedener Anteilklassen innerhalb eines Teilfonds beschließen. Derzeit bietet die Gesellschaft ausschließlich Anteile der Klasse „I Acc“ für thesaurierende und „I D“ für ausschütende an. Seit dem 3. Dezember 2020 ist Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF der einzige Teilfonds, welcher thesaurierende Anteile anbietet.

Während des Geschäftsjahres notierten alle Teilfonds mit der Anteilklasse I D an der Frankfurter Wertpapierbörse und der Baden-Württembergischen Wertpapierbörse, Stuttgart. Darüber hinaus notierten alle Teilfonds an der XETRA mit der Anteilklasse I D und einige Teilfonds an weiteren europäischen Börsen. Der vollständige Überblick bzgl. des Börsenlistings ist in der folgenden Tabelle unter Erläuterung **1.1 Darstellung des Jahresabschlusses** angegeben.

Der Verkaufsprospekt, der Geschäftsbericht sowie eine Aufstellung der Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes während des Geschäftsjahres (siehe Erläuterung 6.4) können kostenlos bei der Gesellschaft angefordert werden.

1.1 Darstellung des Jahresabschlusses

Am 30. Juni 2021 waren Anteile an 27 Teilfonds der Lyxor (vormals ComStage) ausgegeben: (Hinweise zu der Gesellschaftsbezeichnung und Namensänderung einzelner Teilfonds siehe 1.2 und Verschmelzung einzelner Teilfonds siehe 1.3).

Teilfonds	Anteilklasse	Währung	Auflagedatum	Börse
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	21.08.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	01.09.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	03.09.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	01.09.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	JPY	21.08.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	USD	22.05.2009	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange, London Stock Exchange
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	27.11.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	01.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	03.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	05.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	03.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	03.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	03.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	01.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	01.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	CHF	01.12.2008	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	USD	11.05.2010	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	07.10.2010	Euronext Paris, Borsa Italiana, XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	10.05.2010	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	10.05.2010	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	10.05.2010	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	CHF	10.05.2010	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	28.09.2011	Borsa Italiana, London Stock Exchange, XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
	Anteilklasse I Acc	USD	03.12.2020	Borsa Italiana (seit dem 19.01.2021), London Stock Exchange (seit dem 28.01.2021)
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	28.09.2011	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	USD	30.09.2013	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange

.

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 1 - Allgemeines (Fortsetzung)

1.1 Darstellung des Jahresabschlusses (Fortsetzung)

Teilfonds	Anteilklasse	Währung	Auflagedatum	Börse
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	24.03.2014	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	EUR	08.10.2015	XETRA, Frankfurt, Stuttgart, SIX Swiss Exchange

Mit Datum vom 26. März 2021 haben LFS und Lyxor International Asset Management S.A.S. (LIAM) durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, die Notierung aller Lyxor Teilfonds an der Euronext Lissabon zu beenden, aufgrund des geringen Handelsvolumens und Kostenüberlegungen.

1.2 Änderung der Gesellschaftsbezeichnung und Namensänderung von Teilfonds

Mit Datum vom 5. November 2020 hat der Verwaltungsrat der Lyxor (vormals ComStage) durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, die Bezeichnung der Gesellschaft von „ComStage“ in „Lyxor“ und die Satzung der Gesellschaft am 11. November 2020 zu ändern. Im Einzelnen werden die Bezeichnungen der Teilfonds per 30. November 2020 wie folgt geändert:

Alter Fondsname	Neuer Fondsname
ComStage DAX® UCITS ETF	Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF
ComStage EURO STOXX® Select Dividend 30 UCITS ETF	Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF
ComStage STOXX® Europe 600 UCITS ETF	Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF
ComStage Dow Jones Industrial Average UCITS ETF	Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF
ComStage Nikkei 225® UCITS ETF	Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF
ComStage Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.3)	Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.3)
ComStage MSCI World UCITS ETF	Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF
ComStage MSCI Europe UCITS ETF	Lyxor MSCI Europe UCITS ETF
ComStage MSCI North America UCITS ETF	Lyxor MSCI North America UCITS ETF
ComStage MSCI Pacific UCITS ETF	Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF
ComStage MSCI USA UCITS ETF	Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF
ComStage S&P MidCap 400 UCITS ETF	Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF
ComStage S&P SmallCap 600 UCITS ETF	Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF
ComStage MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF
ComStage MSCI Europe Small Cap UCITS ETF	Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF
ComStage Dow Jones Switzerland Titans 30TM UCITS ETF	Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF
ComStage NYSE Arca Gold BUGS UCITS ETF (siehe 1.3)	Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.3)
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF
ComStage DivDAX® UCITS ETF	Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF
ComStage ShortDAX® UCITS ETF	Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF
ComStage SDAX® UCITS ETF	Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF
ComStage SPI® UCITS ETF	Lyxor SPI® UCITS ETF
ComStage MSCI Emerging Markets UCITS ETF	Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF
ComStage F.A.Z. Index UCITS ETF	Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF
ComStage FTSE China A50 UCITS ETF	Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF
ComStage MDAX® UCITS ETF	Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF
ComStage Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF	Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF

1.3 Verschmelzung von Teilfonds

Mit Datum vom 19. November 2019 hat der Verwaltungsrat der Lyxor (vormals ComStage) durch Umlaufbeschlüsse beschlossen, die folgenden Teilfonds zu verschmelzen.

Untergehende Teilfonds	Ratio	Datum des Inkrafttretens	Basierend auf dem NIW vom	Zu erhaltenden Anteile der aufnehmenden Teilfonds
MULTI UNITS LUXEMBOURG - Lyxor MSCI ACWI Gold UCITS ETF	3,488172	11.09.2020	10.09.2020	ComStage NYSE Arca Gold BUGS UCITS ETF (siehe 1.2)
MULTI UNITS LUXEMBOURG - Lyxor Commodities Thomson Reuters/CoreCommodity CRB EX-Agriculture TR UCITS ETF	0,886886	11.09.2020	10.09.2020	ComStage Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2)

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 1 - Allgemeines (Fortsetzung)

1.3 Verschmelzung von Teilfonds (Fortsetzung)

Mit Datum vom 8. Oktober 2020 hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft der Rohstoff Strategie durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, den Fonds „Rohstoff Strategie“ (der „untergehende Fonds“) mit dem Teilfonds „Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF“ (der „aufnehmende Teilfonds“) zu verschmelzen.

Untergehender Fonds	Ratio	Datum des Inkrafttretens	Basierend auf dem NIW vom	Zu erhaltenden Anteile der aufnehmenden Teilfonds
Rohstoff Strategie R EUR	0,396552	11.12.2020	10.12.2020	Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF, I D (siehe 1.2)
Rohstoff Strategie I EUR	82,598617	11.12.2020	10.12.2020	Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF, I D (siehe 1.2)
Rohstoff Strategie R USD	0,327817	11.12.2020	10.12.2020	Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF, I D (siehe 1.2)

Erläuterung 2 - Grundlegende Rechnungslegungsmethoden

2.1 Abschlüsse

Die Abschlüsse wurden in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften für Investmentfonds erstellt.

2.2 Bewertung von Vermögenswerten

1) Der Wert von Kassenbeständen oder Bareinlagen, Wechseln und Zahlungsaufforderungen sowie Forderungen aus Lieferungen und Leistungen, aktivischen Rechnungsabgrenzungsposten, Bardividenden und Zinserträgen, die beschlossen oder wie vorgenannt aufgelaufen, aber noch nicht eingegangen sind, wird in voller Höhe berücksichtigt, außer wenn es jeweils unwahrscheinlich ist, dass diese Beträge gezahlt werden oder eingehen, in welchem Falle ihr Wert mit einem jeweils für angemessen gehaltenen Abschlag festgelegt wird, um ihren tatsächlichen Wert wiederzugeben.

2) Wertpapiere, die an einer anerkannten Börse notiert sind oder an einem sonstigen organisierten Markt gehandelt werden, werden zu ihren letzten verfügbaren amtlichen Schlusskursen oder, falls es mehrere solche Märkte gibt, anhand ihrer letzten verfügbaren Schlusskurse auf dem wichtigsten Markt für das betreffende Wertpapier bewertet. Im Normalfall wird es sich dabei um dieselben Schlusskurse handeln, welche vom Indexsponsor bei der Berechnung des Index berücksichtigt werden. Falls der letzte verfügbare Kurs den marktgerechten Wert der betreffenden Wertpapiere nicht angemessen wiedergibt, wird der Wert dieser Wertpapiere vom Verwaltungsrat in angemessener Weise (nach sorgfältigen Erwägungen und nach Treu und Glauben) auf den vorhersehbaren Verkaufspreis festgelegt.

3) Wertpapiere, die nicht an einer anerkannten Börse notiert oder zum Handel zugelassen sind, und nicht an einem sonstigen organisierten Markt gehandelt werden, werden auf der Grundlage ihres vermutlichen Verkaufspreises bewertet, der vom Verwaltungsrat nach vernünftigen Erwägungen und nach Treu und Glauben ermittelt wird.

4) Unter dem Liquidationswert von Futures, Termingeschäften oder Optionskontrakten, die nicht an Börsen oder sonstigen organisierten Märkten gehandelt werden, ist der Nettoliquidationswert zu verstehen, der gemäß den von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Grundsätzen auf einer für jede der verschiedenen Arten von Kontrakten einheitlich angewandten Grundlage ermittelt wird. Der Liquidationswert von Futures, Termingeschäften oder Optionskontrakten, die an Börsen oder sonstigen organisierten Märkten gehandelt werden, richtet sich nach den letzten verfügbaren Abrechnungspreisen. Wenn jedoch einer dieser Futures, Termingeschäfte oder Optionskontrakte nicht an dem Tag liquidiert werden konnte, zu dem das Nettovermögen ermittelt wurde, muss als Grundlage für die Ermittlung des Liquidationswerts eines betreffenden Kontrakts ein Wert festgelegt werden, der vom Verwaltungsrat als angemessen und vernünftig erachtet wird.

5) Zins-Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet, der unter Bezugnahme auf die jeweils geltenden Zinskurven festgelegt wird. Swaps, die sich auf Indizes und Finanztitel beziehen, werden zu ihrem Marktwert bewertet, der unter Bezugnahme auf den jeweiligen Index oder Finanztitel festgelegt wird. Die Bewertung der auf einen Index oder Finanztitel bezogenen Swap-Vereinbarung richtet sich nach dem Marktwert dieses Swap-Geschäfts, der nach Treu und Glauben entsprechend dem vom Verwaltungsrat bestimmten Verfahren ermittelt wird.

6) Alle sonstigen Wertpapiere und anderen Vermögenswerte werden zu ihrem marktgerechten Wert bewertet, der nach Treu und Glauben entsprechend den vom Verwaltungsrat bestimmten Verfahren ermittelt wird.

2.2 Bewertung von Vermögenswerten

7) Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag über den Kauf oder Verkauf einer bestimmten Menge von Fremdwährung zu einem, an einem oder vor einem bestimmten Datum. Die Devisenterminkontrakte sind unter Bezugnahme auf den zum Fälligkeitstermin der Kontrakte geltenden Devisenterminkurs bewertet. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust ist in der Aufstellung des Nettovermögens unter „Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften“ oder unter „Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste und die Veränderung des nicht realisierten Gewinns und Verlusts sind in der Aufwands- und Ertragsrechnung unter „Netto realisierter Gewinn (Verlust) aus Devisentermingeschäften“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinns (Verlusts) aus Devisentermingeschäften“ ausgewiesen.

2.3 Realisierte Gewinne und Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieranlagen

Die realisierten Gewinne und Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieranlagen werden auf der Grundlage der gewichteten Durchschnittskosten ermittelt.

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 2 - Grundlegende Rechnungslegungsmethoden (Fortsetzung)

2.4 Währungsumrechnung

Das Nettovermögen der Gesellschaft ist jederzeit gleich der Summe der Nettoinventarwerte der verschiedenen Teilfonds. Die Umrechnung in Euro erfolgt jeweils zu dem Wechselkurs, der in einem organisierten Markt am Bewertungstag vor dem Bewertungszeitpunkt gilt.

Erläuterung 3 - Anlagepolitik

Das Anlageziel der Teilfonds besteht darin, den Anlegern einen Ertrag zukommen zu lassen, der an die Wertentwicklung des jeweiligen zugrundeliegenden Index, Baskets und/oder eines strukturierten Produktes anknüpft, wie im entsprechenden Anhang des Verkaufsprospekts näher beschrieben.

Zur Erreichung des Anlageziels wird der Teilfonds unter Einhaltung der Anlagebeschränkungen in übertragbare Wertpapiere (der „Wertpapierkorb“) investieren, die in ihrer Zusammensetzung von der Indexzusammensetzung abweichen können, und wird zudem derivative Techniken einsetzen. Um die Differenz in der Wertentwicklung zwischen den vom Teilfonds erworbenen Wertpapieren und dem Index auszugleichen, schließt der Teilfonds mit dem Swap-Kontrahent zu marktüblichen Bedingungen ausgehandelte Swaps (die „Swaps“) ab.

Im Falle der voll-replizierenden ETFs bemüht sich der jeweilige Teilfonds zur Erreichung des Anlageziels unter Einhaltung der Anlagebeschränkungen um eine Nachbildung des Index, indem er alle (oder in Ausnahmefällen eine wesentliche Anzahl der) Bestandteile des Index im gleichen Verhältnis wie der Index erwirbt (wie vom Anlageverwalter bestimmt). Der Teilfonds hält unter Umständen nicht jeden Bestandteil bzw. nicht die genaue Gewichtung eines Bestandteils des Index. Stattdessen kann durch den Einsatz von Optimierungstechniken (sog. Sampling) und/oder Anlagen in Wertpapiere, die nicht Bestandteil des Index sind und/oder durch den Einsatz von Finanzderivaten (z.B. Swaps), die Nachbildung der Wertentwicklung des Referenzindex angestrebt werden. Der Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten ist im Interesse der Investoren möglich.

In Abhängigkeit von der Wertentwicklung des Index Swaps hat der Teilfonds eine Zahlung an den Swap-Kontrahenten zu leisten oder erhält eine solche Zahlung. Hat der Teilfonds eine Zahlung an den Swap-Kontrahenten zu leisten, erfolgt diese Zahlung aus den Erlösen und der teilweisen bzw. vollständigen Veräußerung der übertragbaren Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert hat.

Die Wertentwicklung des Index kann sowohl positiv als auch negativ verlaufen. Da der Wert der Anteile des Teilfonds die Entwicklung des Index nachvollzieht, sollten Anleger beachten, dass der Wert ihrer Anlage sowohl steigen als auch fallen kann und es keine Garantie dafür gibt, dass sie ihr investiertes Kapital zurückerhalten.

Erläuterung 4 - Wechselkurse

Für die Euro-Umrechnung des zum 30. Juni 2021 bestehenden Wertes der auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und der Verbindlichkeiten der Gesellschaft wurden folgende Wechselkurse vom 30. Juni 2021 zugrunde gelegt:

1 EUR =	1,468500 CAD	(Kanadischer Dollar)
1 EUR =	1,096200 CHF	(Schweizer Franken)
1 EUR =	131,623050 JPY	(Japanischer Yen)
1 EUR =	1,185900 USD	(US-Dollar)

Erläuterung 5 - Besteuerung

Nach derzeitigem Luxemburger Recht und Luxemburger Praxis ist die Gesellschaft in Luxemburg nicht einkommensteuerpflichtig und für von der Gesellschaft gezahlte Dividenden fällt keine Quellensteuer an. Nach derzeitigem Luxemburger Recht und Luxemburger Praxis ist für den realisierten Kapitalzuwachs des Vermögens der Gesellschaft keine Kapitalgewinnsteuer zu zahlen.

Von der jährlichen Steuer („Taxe d'abonnement“) befreit sind seit dem 1. Januar 2011 Teilfonds, (i) deren Anteile an mindestens einer Wertpapierbörse notiert oder auf einem geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden und (ii) deren ausschließlicher Zweck darin besteht, die Wertentwicklung eines oder mehrerer Indizes nachzubilden. Bei mehreren Anteilklassen eines Teilfonds ist die Befreiung nur auf die Klassen anwendbar, die die vorgenannte Bedingung (i) erfüllen. Unbeschadet zusätzlicher oder alternativer Kriterien, die durch Verordnungen festgelegt werden können, muss der in Bedingung (ii) in Bezug genommene Index eine adäquate Bezugsgrundlage für den Markt darstellen, auf den er sich bezieht, und in angemessener Weise veröffentlicht werden. Die Gesellschaft ist von der Zahlung befreit.

Erläuterung 6 - Kosten zu Lasten der Gesellschaft

6.1 Aufwendungen

Die Verwaltungsvergütung wird durch die Pauschalgebühr abgegolten. Bankzinsen entstehen aus kurzfristigen Überziehungen und werden täglich gebucht.

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 6 - Kosten zu Lasten der Gesellschaft (Fortsetzung)

6.2 Pauschalgebühr

Jeder Teilfonds zahlt eine Pauschalgebühr, die für die verschiedenen Anteilklassen eines Teilfonds unterschiedlich sein kann und insbesondere die Kosten für die Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwalter der Teilfonds, die Verwahrstelle und Zahlstelle sowie die Kosten für die Register-, Transfer- und Verwaltungsstelle umfasst. Die Pauschalgebühr wird von der Verwaltungsgesellschaft aufgeteilt und unmittelbar von dieser an die Verwahrstelle und/oder die jeweiligen Dienstleister gezahlt. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse des jeweiligen Teilfonds berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen.

Die Pauschalgebühr deckt außerdem diverse andere Kosten, Gebühren und Aufwendungen, die im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit des Teilfonds anfallen (die „regulären Kosten des Teilfonds“). So umfassen zum Beispiel die in der Pauschalgebühr enthaltenen regulären Kosten des Teilfonds Folgendes: Aufwendungen für normale Rechtsberatungsleistungen; Aufwendungen für Prüfungsleistungen; die Erstellung und den Druck der Berichte an die Anteilinhaber, der wesentlichen Anlegerinformationen und des Verkaufsprospekts (inklusive sämtlicher Anpassungen und Nachträge), der Geschäftsberichte und Informationsbroschüren inklusive aller Übersetzungskosten; alle Vergütungen und angemessenen Spesen der Verwaltungsratsmitglieder; die laufenden Registrierungsgebühren und sonstigen Kosten für Aufsichtsbehörden in verschiedenen Gerichtsbarkeiten; Versicherungen und die Kosten der Veröffentlichung des indikativen Nettoinventarwerts je Anteil innerhalb eines Börsentages und des täglichen Nettoinventarwerts je Anteil, sowie die Auslagen und Baraufwendungen, die den einzelnen Dienstleistern entstehen.

Folgende weitere Kosten und Gebühren sind in der Pauschalgebühr enthalten: Noch nicht abgeschriebene Gründungskosten, laufende Unterlizenzkommissionen („Laufende Indexkommissionen“), welche die Gesellschaft an die Verwaltungsgesellschaft zahlen muss, alle Steuern und andere Ausgaben steuerlicher Art, welche zu Lasten der Gesellschaft zahlbar werden können, so zum Beispiel, falls anwendbar, die jährliche Steuer in Luxemburg (die „Taxe d’abonnement“) und/oder die Kosten und Kommissionen, die zur Aufrechterhaltung der Notierung der Anteile eines Teilfonds an einer Notierungsbörse oder eine anderen Notierung notwendig sind („Laufende Notierungskosten“).

Bei den in der nachfolgenden Tabelle ausgewiesenen Prozentsätzen in Bezug auf die Pauschalgebühr handelt es sich um die effektiven Prozentsätze.

Teilfonds	Anteilklasse	Pauschalgebühr
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,08% p.a.
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20% p.a.
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,45% p.a.
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	0,30% p.a.
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20% p.a.
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,45% p.a.
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,07% p.a.*
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35% p.a.
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35% p.a.
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35% p.a.
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35% p.a.
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	0,65% p.a.
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20% p.a.
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25% p.a.
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,30% p.a.
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,70% p.a.
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,40% p.a.
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D und I Acc	0,14% p.a.**
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,15% p.a.
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,40% p.a.
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,30% p.a.
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35% p.a.

*Bis zum 1. Mai 2021 : 0.10% p.a..
**0,14% p.a. für die Anteilklassen I D und I Acc (am 3. Dezember 2020 aufgelegt).

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 6 - Kosten zu Lasten der Gesellschaft (Fortsetzung)

6.3 Andere Kosten

Es entstehen der Gesellschaft andere Kosten, die in der Pauschalgebühr nicht inbegriffen sind, und die die Gesellschaft gegebenenfalls aus den Aktiva der betreffenden Aktienklasse bzw. des betreffenden Teilfonds zahlen muss („Andere Kosten"). Nicht in der Pauschalgebühr inbegriffen sind zum Beispiel:

- anfallende Steuer oder ähnliche Verkaufs- oder Dienstleistungsabgaben zu Lasten der Gesellschaft („Steuern und Abgaben“);

- alle Kosten und Ausgaben, welche durch den Kauf und Verkauf von Wertpapieren, Finanzinstrumenten oder von sonstigen Anlagen eines Teilfonds entstehen, z.B. Maklerkommissionen sowie Kommissionen von Korrespondenten anlässlich der Übertragung von Wertpapieren oder anderen Anlagen („Transaktionskosten“);

- für die Anbahnung und Durchführung besonderer Techniken und Instrumente, wie Wertpapierdarlehensgeschäfte, Wertpapierpensionsgeschäfte und Derivate, für Rechnung des Fonds eine Vergütung in Höhe von bis zu 30% der Erträge aus diesen Geschäften („Ertragsbeteiligung“);

- Kosten sowie jegliche Entgelte, die mit dem Erwerb und/oder der Verwendung bzw. Nennung eines Referenzwertes oder Finanzindizes anfallen können („Lizenzkosten“);

- alle Kosten und Kommissionen, welche außerhalb der normalen Geschäftstätigkeit eines Teilfonds anfallen (z.B. Kosten für Rechtsberatung und Rechtsverfolgung) („Außergewöhnliche Kosten“).

6.4 Veränderungen des Wertpapierbestands

Eine Aufstellung der Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes während des Geschäftsjahres kann kostenlos bei der Gesellschaft angefordert werden.

Erläuterung 7 - Swap-Kontrakte

Folgende Swap-Kontrakte standen zum 30. Juni 2021 aus:

Kontraktart	Nennwert in Währung	Währung	(Gestellter) Sicherungsbetrag in EUR	Erhaltener Sicherungsbetrag in EUR	Gegenpartei	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Swaps in Währung
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	318.530.759,25	EUR	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(1.449.403,86)
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	296.233.608,21	EUR	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(32.447,66)
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	104.391.744,25	USD	(723.297,88)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	356.495,70
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	99.172.085,22	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(1.216.709,90)
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	10.803.670.684,10	JPY	(2.032.926,60)	-	Goldman Sachs International	17.12.2021	(169.889.567,42)
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	9.723.999.003,29	JPY	-	-	Goldman Sachs International	17.12.2021	(169.204.976,37)
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	1.029.160.221,27	USD	-	9.072.423,05	Merrill Lynch International	15.12.2021	28.429.365,03
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	946.827.312,00	USD	-	-	Merrill Lynch International	15.12.2021	2.191.958,90
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	3.291.229.938,73	USD	(19.894.833,47)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(7.702.541,59)
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	3.126.668.462,30	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(22.228.575,27)
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	18.043.752,00	USD	(510.516,06)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(628.786,71)
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	19.402.295,00	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(696.576,17)
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	143.415.544,64	USD	(602.924,44)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	4.499.960,79
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	136.244.731,80	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(4.990.932,23)
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	261.153.574,74	USD	(8.803.440,42)	-	Goldman Sachs International	17.12.2021	(6.501.118,39)
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	238.164.896,91	USD	-	-	Goldman Sachs International	17.12.2021	(4.778.864,32)
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	48.002.200,80	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	349.306,64
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	45.602.019,31	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(408.415,62)
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	21.332.559,11	USD	(640.647,61)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(227.031,88)
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	20.265.825,01	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(393.474,69)
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	100.635.354,06	USD	(1.794.842,46)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	350.320,88
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	95.603.496,93	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(121.346,12)
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	27.953.144,00	USD	(750.758,92)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(899.257,87)
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	25.996.219,00	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(905.872,46)
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	80.103.759,39	USD	-	-	Merrill Lynch International	15.12.2021	(700.665,26)
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	74.496.544,00	USD	-	-	Merrill Lynch International	15.12.2021	1.115.698,52
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	346.014.680,70	EUR	(7.340.000,00)	-	Barclays Bank Ireland PLC	21.12.2021	(58.414,54)
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	311.413.230,92	EUR	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	21.12.2021	(10.591.558,62)

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 7 - Swap-Kontrakte (Fortsertung)

Kontraktart	Nennwert in Währung	Währung	(Gestellter) Sicherungsbetrag in EUR	Erhaltener Sicherungsbetrag in EUR	Gegenpartei	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Gewinn (Verlust) aus Swaps in Währung
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	70.908.385,30	EUR	(2.850.000,00)	-	Goldman Sachs International	21.12.2021	(1.897.696,90)
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	78.178.306,78	EUR	-	-	Goldman Sachs International	21.12.2021	(481.745,39)
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	18.274.419,68	CHF	(346.652,07)	-	Goldman Sachs International	15.12.2021	49.776,58
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	16.451.805,55	CHF	-	-	Goldman Sachs International	15.12.2021	(735.024,67)
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	877.614.724,06	USD	(4.376.422,97)	-	Merrill Lynch International	17.12.2021	9.920.338,53
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	807.405.524,00	USD	-	-	Merrill Lynch International	17.12.2021	(4.997.981,61)
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	42.641.302,57	USD	(954.693,06)	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(164.241,71)
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	38.377.269,04	USD	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(674.556,29)
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	35.238.851,84	EUR	-	680.000,00	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	(1.602.626,32)
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	39.154.288,60	EUR	-	-	Barclays Bank Ireland PLC	17.12.2021	1.810.668,29

Die Gegenparteien der Swap-Kontrakte sind Barclays Bank Ireland PLC, Goldman Sachs International, Merrill Lynch International. Die erhaltenen und gestellten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln.

Bei den positiven Sicherungsbeträgen handelt es sich um erhaltene Sicherheiten, welche nicht Bestandteil des Nettovermögens sind. Bei den negativen Sicherungsbeträgen handelt es sich um gestellte Sicherheiten (siehe die „Aufstellung des Nettovermögens“ für die betroffenen Teilfonds).

Erläuterung 8 - Informationen zur Verwaltungsgesellschaft Lyxor Funds Solutions S.A.

Zum 30. Juni 2021 wurden von der Verwaltungsgesellschaft weitere im Großherzogtum Luxemburg gemäß Teil I des abgeänderten Gesetzes von 2010 errichtete Investmentfonds verwaltet, die nicht Inhalt dieses Jahresberichtes sind.

Erläuterung 9 - Transaktionskosten

Im abgelaufenen Geschäftsjahr sind Transaktionskosten in Höhe von 160.801,79 EUR angefallen.

Erläuterung 10 - Ausschüttungen

Mit Datum vom 31. Juli 2020 hat der Verwaltungsrat der Lyxor (vormals ComStage) durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, die Ausschüttung einer Dividende für die Anteilklasse I D gemäß der folgenden Tabelle vorzunehmen:

Teilfonds	Anteilklasse	Ex-Tag	Währung	Dividenden
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	2,81
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	1,34
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	1,70
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	5,24
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	JPY	35,34
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,09
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,35
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,25
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,18
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,28
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	2,61
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	0,59
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	1,73
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	0,75
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	CHF	2,66
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	0,98
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	0,75
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	CHF	2,15
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	0,93
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	0,57
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	USD	2,81
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	21.08.2020	EUR	0,22

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 10 - Ausschüttungen (Fortsetzung)

Mit Datum vom 30. November 2020 hat der Verwaltungsrat der Lyxor (vormals ComStage) durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, die Ausschüttung einer Dividende für die Anteilklasse I D gemäß der folgenden Tabelle vorzunehmen:

Teilfonds	Anteilklasse	Ex-Tag	Währung	Dividenden
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	09.12.2020	USD	0,04
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	09.12.2020	EUR	0,05
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	09.12.2020	EUR	0,06

Erläuterung 11 - Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfte

Zum 30. Juni 2021 halten die Teilfonds keine Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfte.

Erläuterung 12 - Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio) und Portfolio Turnover Rate (PTR)

Es werden die zu Lasten der Gesellschaft angefallenen Kosten (Pauschalgebühr und Andere Kosten) auf Teilfondsebene offen gelegt und als Quote des durchschnittlichen Teilfondsvolumens ausgewiesen („Total Expense Ratio“ - TER). Diese Gesamtkostenquote wird jeweils für das vergangene Geschäftsjahr ermittelt. Transaktionskosten werden in der Gesamtkostenquote nicht berücksichtigt. Die Gesamtkostenquote wird für Berichterstattungszeiträume von weniger als zwölf Monaten annualisiert.

Teilfonds	Anteilklasse	TER
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,08%
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20%
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,45%
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	0,30%
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20%
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,45%
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,09%
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35%
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35%
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35%
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,35%
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	0,65%
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20%
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,25%
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,30%
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,70%
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,40%
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,14%
	Anteilklasse I Acc	0,14%
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,15%
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,40%
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,30%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,34%

Die PTR gibt die Umschlagshäufigkeit der Anteile der jeweiligen Teilfonds an. Sie wird ermittelt aus der Differenz der Summe der Wertpapiergeschäfte des Teilfonds und der Summe der Transaktionen mit Anteilen des jeweiligen Teilfonds, dividiert durch das durchschnittliche Nettovermögen.

Teilfonds	PTR
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	23,00%
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	87,81%
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	845,30%
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	814,25%
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	835,39%

Erläuterungen zum Jahresbericht zum 30. Juni 2021 (Fortsetzung)

Erläuterung 12 - Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio) und Portfolio Turnover Rate (PTR) (Fortsetzung)

Teilfonds	PTR
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	1.166,94%
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	929,23%
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	646,18%
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	774,23%
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	1.366,90%
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	836,41%
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	873,77%
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	976,82%
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	1.218,33%
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	1.752,96%
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	11,44%
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	93,84%
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	771,55%
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	43,95%
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	756,77%
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	98,09%
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	1.860,17%
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	1.119,53%
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	7,97%
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	929,47%
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	51,54%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	357,02%

Erläuterung 13 - Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Mit Datum vom 1. Juli 2021 hat der Verwaltungsrat der Lyxor (vormals ComStage) durch einen Umlaufbeschluss beschlossen, die Ausschüttung einer Dividende für die Anteilklasse I D gemäß der folgenden Tabelle vorzunehmen:

Teilfonds	Anteilklasse	Ex-Tag	Währung	Dividenden
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	2,57
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	1,34
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	1,76
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	3,99
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	JPY	32,35
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,05
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,48
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,12
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,06
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,21
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,91
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	0,41
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	1,95
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	0,74
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	CHF	2,90
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	0,12
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	0,85
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	0,58
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	CHF	2,32
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	0,91
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	0,50
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	USD	2,48
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	07.07.2021	EUR	0,19

Es gibt keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach dem Stichtag.

Informationen für Anleger in der Schweiz zum 30. Juni 2021 (ungeprüft)

Informationen für Anleger in der Schweiz

Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz
Als Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz wurde die Société Générale, Paris, Zweigniederlassung Zürich, Talacker 50, Postfach 5070, CH-8021 Zürich, (der „Vertreter") bestimmt.

Bezugsort der maßgeblichen Dokumente
Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Satzung der Gesellschaft, die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Aufstellung der Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes sowie die Ausgabe-, und Rücknahmepreise können kostenlos beim Vertreter bezogen werden.

Publikationen
Die Gesellschaft betreffende Publikationen erfolgen in der Schweiz auf der elektronischen Plattform www.fundinfo.com.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise beziehungsweise der Nettoinventarwert mit dem Hinweis „exklusive Kommissionen" werden an jedem Berechnungs- und Veröffentlichungstag und bei jeder Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, mindestens aber zweimal im Monat (am ersten und dritten Freitag eines jeden Monats), auf der elektronischen Plattform www.fundinfo.com publiziert.

Zahlung von Retrozessionen und Rabatten
Die Verwaltungsgesellschaft sowie deren Beauftragte können Retrozessionen zur Entschädigung der Vertriebstätigkeit von Fondsanteilen in der Schweiz oder von der Schweiz aus bezahlen. Mit dieser Entschädigung können insbesondere folgende Dienstleistungen abgegolten werden:

- Aufbau und Pflege einer elektronischen Vertriebs- und Informationsplattform;
- zentrales Relationship Management zwischen der Vertriebsstelle und Vertriebspartnern bzgl. der Aktivitäten auf der elektronischen Vertriebs- und Informationsplattform;
- Auswahl und Due Diligence von Vertriebspartnern sowie zentrales Vertragsmanagement.

Retrozessionen gelten nicht als Rabatte auch wenn sie ganz oder teilweise letztendlich an die Anleger weitergeleitet werden.

Die Empfänger der Retrozessionen gewährleisten eine transparente Offenlegung und informieren den Anleger von sich aus kostenlos über die Höhe der Entschädigungen, die sie für den Vertrieb erhalten könnten.

Auf Anfrage legen die Empfänger der Retrozessionen die effektiv erhaltenen Beträge, welche sie für den Vertrieb der kollektiven Kapitalanlagen dieser Anleger erhalten, offen.

Die Verwaltungsgesellschaft und deren Beauftragte bezahlen im Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus keine Rabatte, um die auf den Anleger entfallenden, dem jeweiligen Teilfonds belasteten Gebühren und Kosten zu reduzieren.

Maßgebliche Sprache
Im Rahmen des Vertriebs in der Schweiz geht die deutsche Fassung des Verkaufsprospekts und der wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger vor.

Erfüllungsort und Gerichtsstand
Für die in der Schweiz und von der Schweiz aus vertriebenen Anteile ist am Sitz des Vertreters Erfüllungsort und Gerichtsstand begründet.

Gesamtkostenquote („Total Expense Ratio" (TER)) und Portfolio Turnover Ratio (PTR)
Die Gesellschaft weist für alle Teilfonds in den Jahres- und Halbjahresberichten die Total Expense Ratio (TER) oder Gesamtkostenquote sowie die Portfolio Turnover Rate (PTR) oder Umschlagsrate aus.

Wertentwicklung zum 30. Juni 2021 (ungeprüft)

Wertentwicklung

Teilfonds	Währung	Wertentwicklung 30.06.2018 - 30.06.2019	Wertentwicklung 30.06.2019 - 30.06.2020	Wertentwicklung 30.06.2020 - 30.06.2021
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(2,32%)	(3,85%)	22,51%
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(2,34%)	(27,40%)	31,28%
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	1,59%	(7,33%)	25,48%
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	9,83%	(2,58%)	33,43%
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	JPY	(4,38%)	4,53%	28,97%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	USD	(3,78%)	(9,79%)	44,94%
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	4,61%	1,04%	37,01%
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(0,91%)	(9,92%)	32,03%
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	8,00%	5,74%	40,43%
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(2,55%)	(5,15%)	24,78%
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	8,52%	6,58%	40,31%
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(0,03%)	(8,14%)	50,64%
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(6,08%)	(12,54%)	64,47%
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(4,37%)	(6,69%)	41,18%
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(8,76%)	(8,30%)	48,47%
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	CHF	7,63%	(1,22%)	25,90%
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	USD	10,80%	51,09%	(8,51%)
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(8,34%)	(3,98%)	0,02%
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	1,01%	(9,47%)	25,35%
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(4,65%)	(9,61%)	(24,48%)
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(6,69%)	(0,83%)	36,59%
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	CHF	12,08%	0,70%	19,62%
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	(1,33%)	(5,74%)	38,17%
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(4,35%)	(6,08%)	24,80%
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	USD	10,52%	(0,38%)	38,93%
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(3,33%)	(1,30%)	30,00%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	EUR	(6,99%)	(12,21%)	41,77%

Tracking Error zum 30. Juni 2021 (ungeprüft)

Tracking Error und Tracking Differenz

Der Tracking Error bezeichnet die Standardabweichung der Differenz zwischen der Wertentwicklung eines Teilfonds und der Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index (Benchmark). Ein niedriger Tracking Error steht für eine sehr ähnliche Wertentwicklung. Der Tracking Error ist höher, je größer die durchschnittliche Abweichung der Fondsentwicklung von der Wertentwicklung der Benchmark ist.

Der Tracking Error resultiert grundsätzlich aus der in den einzelnen Teilfonds erhobenen Pauschalgebühr und der Tracking Differenz des jeweiligen Teilfonds.

Positive Tracking Differenzen kommen im Wesentlichen bei ETFs zustande, die sich auf einen Preisindex ohne Dividendenberücksichtigung beziehen. Da die Dividenden im Fonds (mittels des Total Return Swaps) berücksichtigt werden, hat der ETF eine tendenziell positivere Wertentwicklung als der Vergleichsindex, was jedoch zu einem entsprechend großen Tracking Error führt.

Teilfonds	Anteilklasse	Tracking Difference	Tracking Error
Lyxor Core DAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,53%)	0,10%
Lyxor EURO STOXX® Select Dividend 30 (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,65%	0,21%
Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,08%)	0,04%
Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,06%	0,01%
Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,03%)	0,06%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	(0,38%)	0,02%
Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,20%	0,03%
Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,13%)	0,07%
Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,22%	0,02%
Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,50%)	0,04%
Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	0,41%	0,03%
Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,03%)	0,01%
Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,09%)	0,02%
Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,43%)	0,03%
Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,22%)	0,02%
Lyxor Dow Jones Switzerland Titans 30TM (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,28%)	0,07%
Lyxor NYSE Arca Gold BUGS (DR) UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)	Anteilklasse I D	0,02%	0,56%
Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,41%)	0,03%
Lyxor DivDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,96%)	0,15%
Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,32%)	0,09%
Lyxor SDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(1,36%)	0,08%
Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(1,41%)	0,07%
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,03%)	0,03%
Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I Acc	(0,02%)	0,01%
Lyxor F.A.Z. 100 Index (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	2,56%	0,52%
Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	4,26%	0,20%
Lyxor MDAX® (DR) UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,58%)	0,04%
Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)	Anteilklasse I D	(0,76%)	0,04%

Vergütungspolitik (ungeprüft)

Die Lyxor Funds Solutions S.A. (i.F. die „LFS“), ehemals Commerz Funds Solutions S.A. (i.F. die „CFS“), hat die Vergütungspolitik ihrer alleinigen Aktionärin, der Lyxor International Asset Management S.A.S. übernommen. Dies unter Berücksichtigung der lokalen und europäischen Vorgaben hinsichtlich UCITS- und AIFMD-Regularien.

Im Anschluss an den Kauf der CFS S.A. durch die Lyxor International Asset Management S.A.S., der am 27. Mai 2019 stattgefunden hat, wurde die Vergütungspolitik turnusmäßig zum 30. Juni 2021 überprüft. Eine Änderung der selbigen ist bis dato nicht erfolgt.

Die Vergütungspolitik legt die geltenden Grundsätze fest für:

- Jegliche Form der Zahlung oder sonstigen Leistungen gegenüber Mitarbeitern durch die LFS;
- Jeder direkt durch den von der LFS verwalteten Organismus für gemeinsame Anlage (i.F. „OGA“) selbst gezahlte Betrag, einschließlich der leistungsabhängigen Vergütung; und
- Jegliche Übertragung von Anteilen des betreffenden OGA; im Austausch für professionelle Dienstleistungen, die von den Mitarbeitern der LFS erbracht werden.

Um eine marktgerechte Gesamtvergütung der LFS-Mitarbeiter zu gewährleisten, besteht diese aus mehreren Komponenten: Erfolg des Unternehmens, freiwillige betriebliche Zusatzleistungen und betriebliche Altersvorsorge. Die genannten Vergütungskomponenten bestimmen unter Berücksichtigung eines angemessenen und zulässigen Verhältnisses von variabler zu fester Vergütung die marktgerechte Gesamtvergütung der Mitarbeiter.

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der festen Vergütung für alle Mitarbeiter der LFS 1.314 TEUR (93,39%) und der variable Teil 93 TEUR (6,61%).

Eine erfolgsabhängige Vergütung (Performance Fee) wird generell nicht an die Mitarbeiter der LFS ausgezahlt. Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter (16). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an bestimmte Mitarbeitergruppen beträgt anteilig für den Lyxor:

- Senior Management:	507.771,97 EUR
- Personal:	459.732,63 EUR
- Gesamtvergütung:	967.504,60 EUR

Im Geschäftsjahr 2020 betrug der Gesamtbetrag der von der Lyxor International Asset Management S.A.S. gezahlten festen Vergütung für das Portfolio Management 5.050 TEUR.

Die Zahl der Begünstigten entspricht der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2020 durchschnittlich beschäftigten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter des Portfoliomanagements der Lyxor International Asset Management S.A.S. (37). Die Gesamtsumme der im Geschäftsjahr 2020 gezahlten Vergütung an das Portfoliomanagement beträgt anteilig für den Lyxor:

Portfolio Management (Lyxor International Asset Management S.A.S.): 3.472.920,03 EUR

Gemäß Kapitel 7 der ESMA-Richtlinien zur Vergütungspolitik (Final Report vom 31. März 2016) wendet die LFS das vorgesehene Verhältnismäßigkeitsprinzip an.

Dies hat zur Folge, dass die LFS:

- keinen Vergütungsausschuss einsetzt;
- die Auszahlung der variablen Vergütung nicht in AIF/OGAW-Instrumenten erfolgt; und
- das „Auszahlungsverfahren“ (d.h. Sperrfrist, Zurückstellung und ex post Berücksichtigung des Risikos) nicht angewendet wird.

Der Grundsatz der Verhältnismäßigkeit der Vergütung findet auch auf die Art und den Umfang der offenzulegenden Informationen Anwendung. Dies bedeutet für die LFS keine Offenlegung von Informationen über den Beschlussfassungsprozess, auf den sich die Vergütungspolitik stützt, gegebenenfalls einschließlich der Informationen über die Zusammensetzung und das Mandat des Vergütungsausschusses, Name des externen Beraters, dessen Dienste bei der Festlegung der Vergütungspolitik in Anspruch genommen wurden, und Rolle der beteiligten Kreise.

Ferner werden keine Informationen über die (i) Verbindung zwischen der variablen Vergütung und Leistung, (ii) Kriterien, die für die Leistungsbemessung und die Risikoanpassung zugrunde gelegt werden, (iii) Leistungskriterien, auf die sich der Anspruch auf den Bezug der variablen Vergütung gründet sowie die (iv) wichtigsten Parameter und Begründung etwaiger jährlicher Bonusregelungen und anderer unbare Leistungen veröffentlicht. Weiterhin sind vertrauliche quantitative Aspekte der Vergütung nicht Gegenstand der Offenlegung.

Zusätzliche Informationen über die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft können im Internet auf der Website https://www.lyxor.com/de/fondsloesungen-von-lyxor eingesehen werden. Eine Druckversion wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft)

Die im folgenden aufgeführten Daten sind in EUR ausgewiesen.

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(1.481.851,52)
in % des Fondsvermögens			(0,47%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(1.481.851,52)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(1.481.851,52)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Aktuell sind keine Sicherheitenbestände vorhanden.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor STOXX® Europe 600 UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			
1. Name			
1. verwahrter Betrag			
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(726.164,27)
in % des Fondsvermögens			(0,82%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(726.164,27)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(726.164,27)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 723.297,88 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			723.297,88
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Dow Jones Industrial Average (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			723.297,88
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxembourg
1. verwahrter Betrag			723.297,88
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(2.576.644,82)
in % des Fondsvermögens			(3,19%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(2.576.644,82)
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(2.576.644,82)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 2.032.926,60 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			2.032.926,60
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Nikkei 225® UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			2.032.926,60
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			2.032.926,60
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			25.849.505,26
in % des Fondsvermögens			2,90%
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Merrill Lynch International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			25.849.505,26
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			25.849.505,26
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die erhaltenen Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 9.072.423,05 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			9.072.423,05
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture UCITS ETF (siehe 1.2 und 1.3) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Merrill Lynch International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			9.072.423,05
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxembourg
1. verwahrter Betrag			9.072.423,05
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(25.266.855,36)
in % des Fondsvermögens			(0,91%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(25.266.855,36)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(25.266.855,36)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 19.894.833,47 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			19.894.833,47
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI World (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			19.894.833,47
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			19.894.833,47
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(1.118.827,35)
in % des Fondsvermögens			(7,09%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(1.118.827,35)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(1.118.827,35)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 510.516,06 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			510.516,06
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			510.516,06
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			510.516,06
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(414.461,79)
in % des Fondsvermögens			(0,33%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(414.461,79)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(414.461,79)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 602.924,44 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			602.924,44
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI North America UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			602.924,44
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			602.924,44
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(9.522.186,99)
in % des Fondsvermögens			(4,43%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(9.522.186,99)
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(9.522.186,99)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 8.803.440,42 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			8.803.440,42
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Pacific UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			8.803.440,42
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			8.803.440,42
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(49.897,84)
in % des Fondsvermögens			(0,12%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(49.897,84)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(49.897,84)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Aktuell sind keine Sicherheitenbestände vorhanden.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI USA (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			
1. Name			
1. verwahrter Betrag			
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(523.811,05)
in % des Fondsvermögens			(2,94%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(523.811,05)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(523.811,05)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 640.647,61 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			640.647,61
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor S&P MidCap 400 UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			640.647,61
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			640.647,61
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			193.292,89
in % des Fondsvermögens			0,23%
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			193.292,89
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			193.292,89
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 1.794.842,46 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			1.794.842,46
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor S&P SmallCap 600 UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			1.794.842,46
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			1.794.842,46
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(1.523.831,11)
in % des Fondsvermögens			(6,67%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(1.523.831,11)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(1.523.831,11)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 750.758,92 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			750.758,92
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			750.758,92
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			750.758,92
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			350.357,30
in % des Fondsvermögens			0,52%
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Merrill Lynch International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			350.357,30
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			350.357,30
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Aktuell sind keine Sicherheitenbestände vorhanden.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Europe Small Cap UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			
1. Name			
1. verwahrter Betrag			
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(10.649.973,16)
in % des Fondsvermögens			(3,08%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(10.649.973,16)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(10.649.973,16)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 7.340.000,00 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			7.340.000,00
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			7.340.000,00
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxembourg
1. verwahrter Betrag			7.340.000,00
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(2.379.442,29)
in % des Fondsvermögens			(3,06%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(2.379.442,29)
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(2.379.442,29)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 2.850.000,00 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			2.850.000,00
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor ShortDAX® Daily (-1x) Inverse UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			2.850.000,00
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			2.850.000,00
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(624.606,31)
in % des Fondsvermögens			(3,74%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(624.606,31)
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(624.606,31)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 346.652,07 EUR.
Währung(en) der hinterlegten Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			346.652,07
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor SPI® UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Goldman Sachs International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			346.652,07
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			346.652,07
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			4.155.290,33
in % des Fondsvermögens			0,55%
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Merrill Lynch International
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			4.155.290,33
1. Sitzstaat			USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			4.155.290,33
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 4.376.422,97 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			4.376.422,97
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor MSCI Emerging Markets (LUX) UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Merrill Lynch International
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			4.376.422,97
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxembourg
1. verwahrter Betrag			4.376.422,97
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			(708.085,43)
in % des Fondsvermögens			(1,97%)
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			(708.085,43)
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			(708.085,43)
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die hinterlegten Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 954.693,06 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			954.693,06
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor FTSE China A50 UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			954.693,06
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxemburg
1. verwahrter Betrag			954.693,06
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2)

	Angaben pro Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäft / Total Return Swaps		
	Wertpapierleihe	**Pensionsgeschäfte**	**Total Return Swaps**
Verwendete Vermögensgegenstände EUR			
Betrag			208.041,97
in % des Fondsvermögens			0,51%
Einstandskosten			
Nicht realisierter Gewinn/ Verlust			
10 größte Gegenparteien			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Bruttovolumen offene Geschäfte			208.041,97
1. Sitzstaat			Vereinigtes Königreich
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)			zweiseitige Verträge
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			208.041,97
über 1 Jahr			
unbefristet			
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen / hinterlegten Sicherheiten			Die erhaltenen Sicherheiten bestehen ausschließlich aus Barmitteln und belaufen sich auf 680.000,00 EUR.
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			EUR
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (Betrag)			
unter 1 Tag			
1 Tag bis 1 Woche (=7 Tage)			
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)			
1 bis 3 Monate			
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)			680.000,00
über 1 Jahr			
unbefristet			

Securities Financing Transactions Regulation zum 30. Juni 2021 (ungeprüft) (Fortsetzung)

Lyxor Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture EUR hedged UCITS ETF (siehe 1.2) (Fortsetzung)

Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
10 größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps			
1. Name			Barclays Bank Ireland PLC
1. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			680.000,00
2. Name			
2. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
3. Name			
3. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
4. Name			
4. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
5. Name			
5. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
6. Name			
6. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
7. Name			
7. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
8. Name			
8. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
9. Name			
9. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
10. Name			
10. Volumen empfangene Sicherheiten (Betrag)			
Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer / Kontoführer			1
1. Name			BNP Paribas Securities Services Niederlassung Luxembourg
1. verwahrter Betrag			680.000,00
Verwahrart begebener Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
In % aller begebenen Sicherheiten aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps			
gesonderte Konten / Depots			100,00%