

LYXOR EVO FUND

information
periodique

FONDS D'INVESTISSEMENT À VOCATION GÉNÉRALE - FIVG DE DROIT FRANÇAIS

Die periodische Informationsschrift wird nicht durch den Anschlussprüfer der Anlagegesellschaft bestätigt.

Vermögensaufstellung

Gegenstände der Vermögensaufstellung	<i>Buchhaltungswährung der Anlagegesellschaft: EUR</i>	Betrag bei dem periodischen Kontoabschluss
a) Unter dem 1. Punkt des 1. Absatzes des Artikels L. 214-20 / 1. Punkt des 1. Absatzes des Artikels L. 214-24-55 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches genannte zulässige Wertpapiere		4 809 812,00
b) Bankguthaben		-
c) Andere von der Anlagegesellschaft gehaltene Vermögenswerte		324 893 524,33
d) Von der Anlagegesellschaft gehaltenen Gesamtvermögenswerte (<i>Zeilen a+b+c</i>)		329 703 336,33
e) Passiva		-46 900 277,92
f) Nettoinventarwert (<i>Zeilen d+e = Reinvermögen der Anlagegesellschaft</i>)		282 803 058,41

Anzahl der sich in Umlauf befindenden Anteile oder Aktien und Nettoinventarwert pro Anteil oder Aktie

Anteile oder Aktien	Anzahl der sich in Umlauf befindenden Anteile oder Aktien	<i>Währung der Anteile oder Aktien</i>	Nettoinventarwert pro Anteil oder Aktie (Liquidationswert)
AUSSCHÜTTBARE ANTEILE / FR0010343822	4 502 408	EUR	62,81

Wertpapierportfolio

Elemente des Wertpapierportfolios	Prozentsatz	
	Reinvermögen	Gesamtaktiva
<p>a) Die zulässigen Wertpapiere und die Instrumente des Geldmarktes, die zum Handel auf einem geregelten Markt im Sinne des Artikels L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches zugelassen sind.</p> <p>und b) die zugelassenen Wertpapiere und Finanzinstrumente des Geldmarktes, die zum Handel auf einem anderen geregelten Markt zugelassen sind, der einen regelmäßigen Betrieb aufweist, anerkannt ist, der Öffentlichkeit zugänglich ist und dessen Sitz sich in einem Mitgliedstaat der europäischen Union oder in einem anderen Staat befindet, der das Abkommen über den europäischen Wirtschaftsraum unterzeichnet hat.</p>	1,70	1,46
<p>c) Die zugelassenen Wertpapiere und Finanzinstrumente des Geldmarktes, die zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, der einen regelmäßigen Betrieb aufweist, anerkannt ist und der Öffentlichkeit zugänglich ist, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Kapitalmarktaufsichtsbehörde erstellten Liste steht oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes per Gesetz oder per Vorschrift oder in den Statuten der Anlagegesellschaft / des allgemein ausgerichteten Investmentfonds vorgesehen ist.</p>	-	-
<p>d) Die neu ausgegebenen Wertpapiere, die im 4. Absatz des 1. Punkts des Artikels R. 214-11 / im 4. Absatz des 1. Punkts des Artikels R. 214-32-18 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches genannt werden.</p>	-	-
<p>e) Die anderen Vermögenswerte</p>	113,15	97,06

Aufteilung der Vermögenswerte nach Wahrung

Wahrungen (die 10 wichtigsten)	Betrag In der Buchhaltungswahrung der Anlagegesellschaft	Prozentsatz	
	EUR	Reinvermogen	Gesamtaktiva
EUR	4 809 812,00	1,70	1,46
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Andere Wahrungen	-	-	-
Insgesamt	4 809 812,00	1,70	1,46

Aufteilung der Vermögenswerte nach Land des Sitzes des Emittenten

Lander (die 10 wichtigsten)	Prozentsatz	
	Reinvermogen	Gesamtaktiva
Frankreich	1,70	1,46
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
Andere Lander	-	-
Insgesamt	1,70	1,46

Aufteilung der Vermögenswerte nach Wirtschaftssektor

Wirtschaftssektor <i>(die 10 wichtigsten)</i>	Prozentsatz	
	Reinvermögen	Gesamtaktiva
Staat	1,70	1,46
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
Andere Sektoren	-	-
Insgesamt	1,70	1,46

Aufschlüsselung der anderen Vermögenswerte nach Typ

Typ der Vermögenswerte*	Prozentsatz	
	Reinvermögen	Gesamtaktiva
ANTEILE ODER AKTIEN DER ANLAGEGESELLSCHAFT:	113,15	97,06
- allgemein ausgerichtete professionelle Fonds	-	-
- Feeder-Anlagegesellschaft	-	-
- spezialisierte professionelle Fonds	-	-
- Risikokapitalfonds (FCPR), gemeinsame Investmentfonds in Innovationen (FCPI), Investmentfonds im Nahbereich (FIP)	-	-
- Immobilienanlagegesellschaften (OPCI) und professionelle Immobilienanlagegesellschaften (OPPCI)	-	-
- Andere	113,15	97,06
ANDERE TYPEN VON ANLAGEN:	-	-
- Optionsscheine	-	-
- Kassascheine	-	-
- Wechsel	-	-
- Hypothekenscheine	-	-
- Andere	-	-
INSGESAMT	113,15	97,06

Angabe der in der Zusammensetzung des Wertpapierportfolios im Verlauf der Referenzperiode eingetretenen Bewegungen

Gegenstände des Wertpapierportfolios	Bewegungen (in Beträgen)	
	Akquisitionen	Abtretungen/ Rückzahlungen
<i>Buchhaltungswährung der Anlagegesellschaft: EUR</i>		
a) Die zulässigen Wertpapiere und die Instrumente des Geldmarktes, die zum Handel auf einem geregelten Markt im Sinne des Artikels L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches zugelassen sind. und b) die zugelassenen Wertpapiere und Finanzinstrumente des Geldmarktes, die zum Handel auf einem anderen geregelten Markt zugelassen sind, der einen regelmäßigen Betrieb aufweist, anerkannt ist, der Öffentlichkeit zugänglich ist und dessen Sitz sich in einem Mitgliedstaat der europäischen Union oder in einem anderen Staat befindet, der das Abkommen über den europäischen Wirtschaftsraum unterzeichnet hat.	204 276 871,69	513 575 539,98
c) Die zugelassenen Wertpapiere und Finanzinstrumente des Geldmarktes, die zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse eines Drittlandes zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt eines Drittlandes gehandelt werden, der einen regelmäßigen Betrieb aufweist, anerkannt ist und der Öffentlichkeit zugänglich ist, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Kapitalmarktaufsichtsbehörde erstellten Liste steht oder die Wahl dieser Börse oder dieses Marktes per Gesetz oder per Vorschrift oder in den Statuten der Anlagegesellschaft / des allgemein ausgerichteten Investmentfonds vorgesehen ist.	-	-
d) Die neu ausgegebenen Wertpapiere, die im 4. Absatz des 1. Punkts des Artikels R. 214-11 / im 4. Absatz des 1. Punkts des Artikels R. 214-32-18 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuches genannt werden.	-	-
e) Die anderen Vermögenswerte	446 688 277,00	270 834 007,71
Gesamtsumme über den Zeitraum	650 965 148,69	784 409 547,69

Angabe der bezifferten Daten bezüglich der nach Steuerabzug über den Zeitraum ausgeschütteten oder auszuschüttelnden Dividenden pro Anteil aus dem Ergebnis und/oder aus dem erzielten Minder-oder Mehrertrag („EMME“)

Datum	Kategorie der Anteile / Aktien	Währung Anteile / Aktien	Typ	Einheitsbetrag netto	Einheitliche Steuergutschrift	Einheitsbetrag brutto
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

**Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung von Finanzinstrumenten (SFTR-Verordnung)
(in der Fondswährung)**

1. Allgemeine Angaben

1.1 Betrag der verliehenen Wertpapiere und Waren, ausgedrückt als Anteil an den verleihbaren Vermögenswerten insgesamt, d. h. definitionsgemäß ausschließlich Barmitteln oder Barmitteläquivalenten

Wertpapier- verleihgeschäfte	
% der geliehenen Vermögenswerte	-

1.2 Betrag der Vermögenswerte, die bei den einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamttrendite-Swaps eingesetzt worden sind, ausgedrückt als absoluter Betrag (in der Währung der Anlagengesellschaft) und als Anteil an den von der Anlagengesellschaft verwalteten Vermögenswerten.

	Wertpapier- verleihgeschäfte ⁽¹⁾	Wertpapier- entleihgeschäfte ⁽²⁾	Pensionsgeschäfte ⁽³⁾	Umgekehrte Pensionsgeschäfte ⁽⁴⁾	TRS ⁽⁵⁾
Absoluter Wert	-	-	-	-	4 645 564,39
% der verwalteten Vermögenswerte	-	-	-	-	1,64

⁽¹⁾ Der Betrag der in Wertpapierverleihgeschäfte eingebrachten Vermögenswerte entspricht dem Marktwert der zum buchhalterischen Abschlussstichtag verliehenen Wertpapiere.

⁽²⁾ Der Betrag der in Wertpapierentleihgeschäfte eingebrachten Vermögenswerte entspricht dem Marktwert der von dem Fonds im Rahmen von Wertpapierentleihgeschäften zum buchhalterischen Abschlussstichtag gelieferten Garantien (Bargeld oder Wertpapiere).

⁽³⁾ Der Betrag der in Pensionsgeschäfte eingebrachten Vermögenswerte entspricht dem Marktwert der zum buchhalterischen Abschlussstichtag in Pension gegebenen Wertpapiere.

⁽⁴⁾ Der Betrag der in umgekehrte Pensionsgeschäfte eingebrachten Wertpapiere entspricht dem Marktwert der zum buchhalterischen Abschlussstichtag in Pension genommenen Wertpapiere.

⁽⁵⁾ Die Höhe des in die TRS angelegten Kapitals entspricht (i) bei den TRS, bei denen die Verwaltungsgesellschaft sich verpflichtet hat, einen Wertpapierkorb im Gegenwert des TRS zu liefern, dem Marktwert des Wertpapierkorbes, der in die TRS angelegt ist, zuzüglich des Marktwertes der TRS zum buchhalterischen Abschlussstichtag und/oder (ii) bei den TRS, bei denen die Verwaltungsgesellschaft keinen Wertpapierkorb liefert, dem Nennwert der TRS zum buchhalterischen Abschlussstichtag.

2. Angaben zur Konzentration.

2.1 Die zehn wichtigsten Emittenten von Sicherheiten für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps (aufgeschlüsselt nach Volumen der als Sicherheit gestellten Wertpapiere und Waren für jeden Emittenten).

1	Bezeichnung	-
	Betrag	-

2.2 Die zehn wichtigsten Gegenparteien für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamttrendite-Swaps (Name der Gegenpartei und Bruttovolumen der ausstehenden Geschäfte).

	Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
1	Bezeichnung	-	-	-	SOCIETE GENERALE
	Betrag	-	-	-	4 645 564,39

3. Aggregierte Transaktionsdaten für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamtrendite-Swaps, getrennt aufgeschlüsselt nach:

3.1 Art und Qualität der Sicherheiten

	Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
Cash	-	-	-	-	-
Wertpapiere	-	-	-	-	-

LIAM achtet darauf, eine gute Diversifizierung der als Garantie erhaltenen Wertpapiere zu gewährleisten und achtet ebenfalls darauf, den Wert seiner Garantien durch Anwenden von Valorisierungsabschlägen auf die erhaltenen Wertpapiere zu erhöhen.

3.2 Laufzeit der Sicherheiten

	Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-	-	-
Offen	-	-	-	-	-

3.3 Währung der Sicherheiten

		Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
1	Währung	-	-	-	-	-
	Betrag	-	-	-	-	-

3.4 Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps

	Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
weniger als 1 Tag	-	-	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-	-	-
Offen	-	-	-	-	4 645 564,39

3.5 Land, in dem die Gegenparteien niedergelassen sind

		Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
1	Land	-	-	-	-	FRANKREICH
	Betrag	-	-	-	-	4 645 564,39

3.6 Abwicklung und Clearing

	Wertpapier- verleihgeschäfte	Wertpapier- entleihgeschäfte	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	TRS
Trilateral	-	-	-	-	-
Zentrale Gegenpartei	-	-	-	-	-
Bilateral	-	-	-	-	4 645 564,39

4. Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Dieser Fond ist nicht kollateralisiert.

5. Verwahrung von Sicherheiten, die die Anlagengesellschaft im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamrendite-Swaps erhalten hat.

Anzahl der Verwahrer		-
1	Bezeichnung	-
	Betrag	-

6. Verwahrung von Sicherheiten, die der Organismus für gemeinsame Anlagen im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamrendite-Swaps gestellt hat

Entfällt.

7. Angaben zu Rendite und Kosten der einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Gesamrendite-Swaps.

Die Anlagengesellschaft verwendet außerbörslich gehandelte Index-linked Swaps.

Die diese Total Return Swaps (TRS) betreffenden Erträge und Kosten werden bei der Bewertung der Finanzinstrumente.