

LYXOR ETF COMMODITIES CRB (REUTERS/JEFFERIES CRB INDEX)

ATTESTATO DEL REVISORE DEI CONTI
Composizione dell'attivo del 31 luglio 2009

ATTESTATO DEL REVISORE DEI CONTI

Composizione dell'attivo del 31 luglio 2009

LYXOR ETF COMMODITIES CRB (REUTERS/JEFFERIES CRB INDEX)

Fondo comune di investimento

Regolato dal codice monetario e finanziario

Società Gestora

LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT

Tour Société Générale

17, cours Valmy

92800 Puteaux

Nella nostra qualità di revisore dei conti del fondo comune di investimento LYXOR ETF COMMODITIES CRB (REUTERS/JEFFERIES CRB INDEX) e in esecuzione delle disposizioni previste dall'articolo L.214-8 del Codice monetario e finanziario e dall'articolo 38 VI della direttiva n.2005-01 AMF in applicazione del Regolamento generale AMF, abbiamo verificato l'affidabilità della composizione dell'attivo così come è allegata al presente attestato.

La composizione dell'attivo è stata stabilita sotto la responsabilità della società di gestione. Nostro compito è attestarne l'affidabilità in base alle nostre verifiche.

Abbiamo applicato i provvedimenti ritenuti necessari secondo la dottrina professionale della Compagnia nazionale dei Revisori dei conti per questo incarico. Tali provvedimenti consistono nella valutazione dell'autenticità di queste informazioni esaminandone la coerenza, la verosimiglianza e la pertinenza.

Una verifica di questa natura, limitata nell'obiettivo, comporta essenzialmente procedure analitiche e colloqui con le persone responsabili delle informazioni fornite.

Non abbiamo osservazioni da formulare in merito alla sincerità delle informazioni date nei documenti pubblicati.

Neuilly sur Seine, 11 settembre 2009

Il revisore dei conti

PriceWaterhouseCoopers Audit

Firma

Marie-Christine Jetil

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09

PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing

Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) -> GLOBALE, Smistamenti: BV)

VALORE	STATUTI CONV. / LINEA	DOSSIER	QUANTITÀ E ESPR. QUANTITÀ	VAL QUOT	P.R.U. IN VALUTA E ESPR. CORSO	DATA QUOT.	CORSO VALORE	I F	<-----> COSTO PROD. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	<-----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET	
FRANCO SVIZZERO														
<i>Az. & Valori ass.</i>														
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
CH0012005267			NOVARTIS AG-NOM	106,946.	P CHF	45.34	M 31/07/09	48.94	3,210,575.14	219,715.36	0.00	3,430,290.50	0.59	
CH0012032048			ROCHE HOLDING AG-BJ	216,262.	P CHF	150.0916	M 31/07/09	168.5	21,392,753.60	2,489,896.16	0.00	23,882,649.76	4.14	
CH0012138530			CS GROUP AG-NOM	294,115.	P CHF	48.5718	M 31/07/09	50.5	9,352,193.30	382,246.01	0.00	9,734,439.31	1.69	
CH0012138605			ADECCO	89,032.	P CHF	43.46	M 31/07/09	51.5	2,568,594.48	436,483.51	0.00	3,005,077.99	0.52	
CH0012255144			THE SWATCH GROUP N	24.	P CHF	34.2	M 31/07/09	39.65	544.88	78.79	0.00	623.67	0.00	
CH0012255151			THE SWATCH GROUP	14,355.	P CHF	166.3	M 31/07/09	195.3	1,584,729.49	252,687.93	0.00	1,837,417.42	0.32	
CH0012271687			HELVETIA HOLDING	3,107.	P CHF	327.6412	M 31/07/09	297.75	675,277.78	-68,966.83	0.00	606,310.95	0.11	
CH0012332372			SCHWEIZ.RUCKVERS.	6,649.	P CHF	39.5472	M 31/07/09	41.	1,74,427.51	4,238.76	0.00	178,666.27	0.03	
CH0012410517			BALOISE-HOLD. NOM.	16,428.	P CHF	78.05	M 31/07/09	85.2	851,171.93	66,160.35	0.00	917,332.28	0.16	
CH0038863350			NESTLE SA	113,259.	P CHF	40.8148	M 31/07/09	43.98	3,031,091.92	233,510.79	0.00	3,264,602.71	0.57	
CH0045039655			CIE FIN RICHEMONT	68,218.	P CHF	22.5512	M 31/07/09	26.26	1,013,869.00	160,206.68	0.00	1,174,075.68	0.20	
US87162M4096			SYNTHESES INC	37,471.	P CHF	105.3243	M 31/07/09	120.1	2,595,938.23	353,509.34	0.00	2,949,447.57	0.51	
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
									Accumulo (EUR)	46,451,167.26	4,529,766.85	0.00	50,980,934.11	8.84
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
									Accumulo (EUR)	46,451,167.26	4,529,766.85	0.00	50,980,934.11	8.84
<i>Az. & Valori ass.</i>														
									Accumulo (EUR)	46,451,167.26	4,529,766.85	0.00	50,980,934.11	8.84
FRANCO SVIZZERO														
									Accumulo (EUR)	46,451,167.26	4,529,766.85	0.00	50,980,934.11	8.84
EURO														
<i>Az. & Valori ass.</i>														
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
DE0008404005			ALLIANZ SE-NOM	145,709.	P EUR	70.2131	M 31/07/09	69.2	10,230,678.02	-147,615.22	0.00	10,083,062.80	1.75	
ES0113211835			BCO BILBAO VIZCAYA	808,836.	P EUR	10.	M 31/07/09	11.52	8,088,360.00	1,229,430.72	0.00	9,317,790.72	1.62	
FI0009005987			UPM KYMMENE OYJ	651,796.	P EUR	6.64	M 31/07/09	7.35	4,327,925.44	462,775.16	0.00	4,790,700.60	0.83	
IT0000062957			MEDIOBANCA SPA	521,335.	P EUR	9.215	M 31/07/09	9.85	4,804,102.03	331,047.72	0.00	5,135,149.75	0.89	
NL0000352565			FUGRO NV-CVA	8,724.	P EUR	30.	M 31/07/09	31.485	261,720.00	12,955.14	0.00	274,675.14	0.05	
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
									Accumulo (EUR)	27,712,785.49	1,888,593.52	0.00	29,601,379.01	5.13
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>														
									Accumulo (EUR)	27,712,785.49	1,888,593.52	0.00	29,601,379.01	5.13

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09

PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing

Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) → GLOBALE, Smistamenti: BV)

VALORE	STATUTI CONV. / LINEA	DOSSIER	QUANTITÀ E ESPR. QUANTITÀ	VAL QUOT	P.R.U. IN VALUTA E ESPR. CORSO	DATA QUOT.	CORSO VALORE	I F	< -----> COSTO PROD. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	> -----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET	
Az. & Valori ass.														
Accumulo (EUR)														
										27,712,785.49	1,888,593.52	0.00	29,601,379.01	5.13
Strumenti finanziari a termine														
Contratti di swap di tasso														
Swaps														
<i>Altre Swaps</i>														
SWNEURG0			Swp reset neg. EUR G0	-154,928,101.2	EUR	1.	1.		-154,928,101.20	0.00	0.00	-154,928,101.20	-26.85	
Swaps														
Accumulo (EUR)														
										-154,928,101.20	0.00	0.00	-154,928,101.20	-26.85
Contratti di swap di tasso														
Accumulo (EUR)														
										-154,928,101.20	0.00	0.00	-154,928,101.20	-26.85
Strumenti finanziari a termine														
Accumulo (EUR)														
										-154,928,101.20	0.00	0.00	-154,928,101.20	-26.85
Tesoreria														
Liquidità														
Crediti e conti collegati														
<i>Vendite regolamenti differiti</i>														
SDS065EUR			Vend. diff. titoli EUR	7,526,982.12	EUR	1.	1.		7,526,982.12	0.00	0.00	7,526,982.12	1.30	
Crediti e conti collegati														
Accumulo (EUR)														
										7,526,982.12	0.00	0.00	7,526,982.12	1.30
Conti adeguamento														
PLMSEURG0			PMLFtit Swap escl. PTF	7,443,392.1	EUR	1.	1.		7,443,392.10	0.00	0.00	7,443,392.10	1.29	
<i>Spese predisposte</i>														
F120EUR			PrComGestAdmin	-158,807.16	EUR	1.	1.		-158,807.16	0.00	0.00	-158,807.16	-0.03	
Conti adeguamento														
Accumulo (EUR)														
										7,284,584.94	0.00	0.00	7,284,584.94	1.26
Liquidità														
Accumulo (EUR)														
										14,811,567.06	0.00	0.00	14,811,567.06	2.57
Altre disponibilità														
Conti finanziari														
<i>Operazioni a vista</i>														
BK065EUR			Banca EUR SGP	-7,526,982.12	EUR	1.	1.		-7,526,982.12	0.00	0.00	-7,526,982.12	-1.30	
Conti finanziari														
Accumulo (EUR)														
										-7,526,982.12	0.00	0.00	-7,526,982.12	-1.30

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09

PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing

Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) → GLOBALE, Smistamenti: BV

VALORE	STATUTI CONV. / LINEA	DOSSIER	QUANTITÀ E ESPR. QUANTITÀ	VAL QUOT	P.R.U. IN VALUTA E ESPR. CORSO	DATA QUOT.	CORSO VALORE	I F	<-----> COSTO PROD. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	>-----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET
Altre disponibilità													
Accumulo (EUR)									-7,526,982.12	0.00	0.00	-7,526,982.12	-1.30
Tesoreria													
Accumulo (EUR)									7,284,584.94	0.00	0.00	7,284,584.94	1.26
EURO													
Accumulo (EUR)									-119,930,730.77	1,888,593.52	0.00	-118,042,137.25	-20.46
YEN													
<i>Az. & Valori ass.</i>													
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>													
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>													
JP3126400005	ALPS ELECTRIC CO		506,685.	P	JPY	552.51	M 31/07/09	528.	2,110,863.55	-128,615.26	0.00	1,982,248.29	0.34
JP3160400002	EISAI		274,434.	P	JPY	3266.8953	M 31/07/09	3370.	6,694,406.22	158,170.36	0.00	6,852,576.58	1.19
JP3165700000	NTT DATA		873.	P	JPY	269034.7423	M 31/07/09	319000.	1,769,562.07	293,873.95	0.00	2,063,436.02	0.36
JP3205800000	KAO CORP		166,392.	P	JPY	2037.9485	M 31/07/09	2145.	2,527,572.15	116,941.54	0.00	2,644,513.69	0.46
JP3271400008	CREDIT SAISON CO LTD		325,315.	P	JPY	1201.509	M 31/07/09	1236.	2,917,681.11	61,580.50	0.00	2,979,261.61	0.52
JP3300200007	KONAMI CORP		6,767.	P	JPY	1832.	M 31/07/09	2015.	93,091.43	7,940.19	0.00	101,031.62	0.02
JP3368000000	SHOWA DENKO KK		422,768.	P	JPY	161.1138	M 31/07/09	176.	515,161.38	36,154.95	0.00	551,316.33	0.10
JP3421800008	SECOM CO LTD		238,324.	P	JPY	3979.4672	M 31/07/09	4050.	7,126,931.54	24,761.80	0.00	7,151,693.34	1.24
JP3436100006	SOFTBANK CORP		72,704.	P	JPY	1747.4058	M 31/07/09	2015.	964,109.05	121,364.98	0.00	1,085,474.03	0.19
JP3452000007	TAIYO YUDEN CO LTD		5,972.	P	JPY	957.1328	M 31/07/09	1295.	43,089.02	14,213.75	0.00	57,302.77	0.01
JP3463000004	TAKEDA PHARMA CO LTD		15,463.	P	JPY	3710.4987	M 31/07/09	3830.	442,593.37	-3,781.25	0.00	438,812.12	0.08
JP3475350009	DAIICHI SANKYO CO		33,016.	P	JPY	1670.2583	M 31/07/09	1720.	419,667.13	1,097.27	0.00	420,764.40	0.07
JP3481800005	DAIKIN INDUSTRIES		25,109.	P	JPY	3100.	M 31/07/09	3440.	584,492.80	55,498.31	0.00	639,991.11	0.11
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP		111,933.	P	JPY	3675.8738	M 31/07/09	3990.	3,100,786.06	208,369.02	0.00	3,309,155.08	0.57
JP3670800006	NISSAN CHEM IND		99,503.	P	JPY	971.5312	M 31/07/09	1274.	735,681.42	203,591.25	0.00	939,272.67	0.16
JP3718800000	NIPPON SUISAN KAIS		16,742.	P	JPY	280.2415	M 31/07/09	260.	35,734.11	-3,481.36	0.00	32,252.75	0.01
JP3720800006	NSK LTD		42,700.	P	JPY	479.6023	M 31/07/09	513.	152,867.75	9,437.03	0.00	162,304.78	0.03
JP3743000006	NIPPON MEAT PACKER		40,776.	P	JPY	1020.5663	M 31/07/09	1160.	313,781.86	36,686.40	0.00	350,468.26	0.06
JP3787000003	HITACHI CONST MACH		430,904.	P	JPY	1638.4878	M 31/07/09	1679.	5,164,027.09	196,621.06	0.00	5,360,648.15	0.93
JP3788600009	HITACHI LTD		565,908.	P	JPY	307.5991	M 31/07/09	318.	1,307,130.49	26,265.16	0.00	1,333,395.65	0.23
JP3802400006	FANUC LTD		76,412.	P	JPY	6862.5937	M 31/07/09	7770.	4,151,385.27	247,763.68	0.00	4,399,148.95	0.76
JP3870400003	MARUI GROUP CO LTD		125,266.	P	JPY	546.4149	M 31/07/09	679.	520,327.42	109,888.06	0.00	630,215.48	0.11
JP3888300005	MIITSUI CHEMICALS		98,021.	P	JPY	312.0234	M 31/07/09	347.	227,371.29	24,648.52	0.00	252,019.81	0.04
JP3892100003	CHUO HITSUI TRUST		15,339.	P	JPY	364.4577	M 31/07/09	330.	41,730.24	-4,224.56	0.00	37,505.68	0.01
JP3902900004	MIITSUBISHI UFJ FIN		422,608.	P	JPY	615.	M 31/07/09	566.	1,951,645.28	-179,333.08	0.00	1,772,312.20	0.31
JP3904400003	MIITSUMI ELECTRIC		31,710.	P	JPY	1677.2846	M 31/07/09	2335.	404,762.13	143,854.80	0.00	548,616.93	0.10
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC		23,434.	P	JPY	3221.7622	M 31/07/09	3610.	588,584.26	38,231.21	0.00	626,815.47	0.11
JP3973400009	RICOH COMPANY LTD		175,468.	P	JPY	1228.0037	M 31/07/09	1242.	1,618,026.66	-3,275.51	0.00	1,614,751.15	0.28
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>													
Accumulo (EUR)									46,523,062.15	1,814,242.77	0.00	48,337,304.92	8.38

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09
PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing
Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) → GLOBALE, Smistamenti: BV

VALORE	STATUTI CONV. / LINEA	DOSSIER	QUANTITÀ E ESPR. QUANTITÀ	VAL QUOT	P.R.U. IN VALUTA E ESPR. CORSO	DATA QUOT.	CORSO VALORE	I F	<-----> COSTO PROD. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	>-----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET	
Az. & valori ass. NMR o ass.														
									Accumulo (EUR)	46,523,062.15	1,814,242.77	0.00	48,337,304.92	8.38
Az. & Valori ass.														
									Accumulo (EUR)	46,523,062.15	1,814,242.77	0.00	48,337,304.92	8.38
YEN														
									Accumulo (EUR)	46,523,062.15	1,814,242.77	0.00	48,337,304.92	8.38
DOLLARO DEGLI STATI UNITI														
Az. & Valori ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
US02209S1033 ALTRIA GROUP INC			1,015,799.	P USD	16.4136	M 31/07/09	17.53		11,974,398.77	585,612.85	0.00	12,560,011.62	2.18	
US1248572026 CBS CORP-B			1,191,342.	P USD	8.05	M 31/07/09	8.19		6,743,761.41	138,334.15	0.00	6,882,095.56	1.19	
US1264081035 CSX CORP			1,038,787.	P USD	39.2076	M 31/07/09	40.12		28,678,341.64	717,626.93	0.00	29,395,968.57	5.10	
US1296031065 CALGON CARBON			472,660.	P USD	12.13	M 31/07/09	12.67		4,031,619.30	192,399.18	0.00	4,224,018.48	0.73	
US17275R1023 CISCO SYSTEMS INC			215,875.	P USD	18.5174	M 31/07/09	22.01		2,889,884.34	461,488.43	0.00	3,351,372.77	0.58	
US24702R1014 DELL INC			1,920,586.	P USD	13.3	M 31/07/09	13.38		17,978,458.47	147,050.74	0.00	18,125,509.21	3.14	
US2545461046 DIONEX CORP			65,504.	P USD	48.3503	M 31/07/09	65.91		2,502,675.18	542,550.45	0.00	3,045,225.63	0.53	
US26483E1001 DUN & BRADSTREET			86,760.	P USD	82.15	M 31/07/09	71.99		5,011,837.42	-606,369.32	0.00	4,405,468.10	0.76	
US26817G1022 DYNEGY INC A			2,013,520.	P USD	1.6377	M 31/07/09	2.01		2,459,719.03	394,927.56	0.00	2,854,646.59	0.49	
US29267A203U ENER1			61,870.	P USD	7.9808	M 31/07/09	6.38		392,020.49	-113,600.04	0.00	278,420.45	0.05	
US336433107A FIRST SOLAR			78,308.	P USD	131.6861	M 31/07/09	154.39		8,068,959.14	458,617.74	0.00	8,527,576.88	1.48	
US3825501014 GOODYEAR T&RUBBER			33,320.	P USD	13.05	M 31/07/09	17.02		310,445.86	89,558.65	0.00	400,004.51	0.07	
US4062161017 HALLIBURTON CO			466,666.	P USD	21.83	M 31/07/09	22.09		7,347,772.21	-76,637.00	0.00	7,271,135.21	1.26	
US4282361033 HEWLETT PACKARD CO			700,101.	P USD	40.5698	M 31/07/09	43.3		19,983,280.83	1,398,749.36	0.00	21,382,030.19	3.71	
US465741106U ITRON INC			114,838.	P USD	57.9824	M 31/07/09	52.17		5,174,587.26	-948,808.06	0.00	4,225,779.20	0.73	
US46612J5074 JDS UNIPHASE CORP			1,334,407.	P USD	3.8256	M 31/07/09	5.86		3,846,208.68	1,669,308.88	0.00	5,515,517.56	0.96	
US46625H1005 J.P. MORGAN CHASE			1,000,000.	P USD	36.83	M 31/07/09	38.65		25,922,015.77	1,339,490.14	0.00	27,261,505.91	4.73	
US4781601046 JOHNSON & JOHNSON			250,725.	P USD	55.2	M 31/07/09	60.89		9,982,343.39	785,877.56	0.00	10,768,220.95	1.87	
US50075N1046 KRAFT FOODS INC-A			101,699.	P USD	28.26	M 31/07/09	28.34		2,020,964.59	11,939.42	0.00	2,032,904.01	0.35	
US5441471019 LORILLARD			400,000.	P USD	65.87	M 31/07/09	73.72		18,811,266.20	1,987,887.39	0.00	20,799,153.59	3.61	
US5949181045 MICROSOFT CORP			2,744,864.	P USD	22.5732	M 31/07/09	23.52		44,208,594.59	1,327,784.38	0.00	45,536,378.97	7.89	
US62985Q1013 NALCO HOLDING			575,309.	P USD	16.9655	M 31/07/09	17.69		6,907,071.30	271,356.64	0.00	7,178,427.94	1.24	
US68389X1054 ORACLE CORP			1,174,428.	P USD	21.75	M 31/07/09	22.13		17,978,469.18	353,459.33	0.00	18,331,928.51	3.18	
US7134481081 PEPSICO			1,100,000.	P USD	53.36	M 31/07/09	56.75		41,906,257.81	2,124,777.28	0.00	44,031,035.09	7.63	
US7433151039 PROGRESSIVE			187,753.	P USD	15.75	M 31/07/09	15.58		2,079,396.49	-16,133.05	0.00	2,063,263.44	0.36	
US78388J1060 SBA COMMUNICATIONS			1,200,000.	P USD	22.4	M 31/07/09	26.09		19,365,994.24	2,716,883.56	0.00	22,082,877.80	3.83	
US8668102036 SUN MICROSYSTEMS INC			474,915.	P USD	6.471	M 31/07/09	9.17		2,315,456.95	756,290.93	0.00	3,071,747.88	0.53	
US8676521094 SUNPOWER CLASS A			46,408.	P USD	32.18	M 31/07/09	32.2		1,066,226.00	-12,205.47	0.00	1,054,020.53	0.18	
US8715031089 SYMANTEC CORP			3,347,916.	P USD	15.6346	M 31/07/09	14.93		37,327,591.09	-2,071,455.75	0.00	35,256,135.34	6.11	
US88162G1031 TETRA TECH			186,378.	P USD	20.9643	M 31/07/09	30.12		3,097,049.78	862,537.85	0.00	3,959,587.63	0.69	
US91324P1021 UNITEDHEALTH GROUP			580,000.	P USD	23.8858	M 31/07/09	28.06		10,722,315.82	757,000.00	0.00	11,479,315.82	1.99	
US92343E1029 VERISIGN			383,218.	P USD	23.4865	M 31/07/09	20.44		6,670,958.07	-1,146,023.55	0.00	5,524,934.52	0.96	
US9830241009 WYETH			12,579.	P USD	45.0056	M 31/07/09	46.55		403,870.38	9,144.93	0.00	413,015.31	0.07	

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09

PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing

Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) → GLOBALE, Smistamenti: BV)

VALORE		STATUTI CONV. / LINEA	DOSSIER	QUANTITÀ E ESPR. QUANTITÀ	VAL QUOT	P.R.U. IN VALUTA E ESPR. CORSO	DATA QUOT.	CORSO VALORE	I F	< -----> COSTO PROD. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	> -----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET
Az. & valori ass. NMR o ass.														
							Accumulo (EUR)			378,179,811.68	15,109,422.09	0.00	393,289,233.77	68.17
Az. & valori ass. NMR o ass.														
							Accumulo (EUR)			378,179,811.68	15,109,422.09	0.00	393,289,233.77	68.17
Az. & Valori ass.														
							Accumulo (EUR)			378,179,811.68	15,109,422.09	0.00	393,289,233.77	68.17
Strumenti finanziari a termine														
Contratti di swap di tasso														
Swaps														
<i>Altre Swaps</i>														
SWPUSDG0	Swp reset pos. USD G0			194,243,491.13	USD	0.71805551		0.7053429		139,477,608.25	-2,469,326.73	0.00	137,008,281.52	23.75
SWPUSDG1	Swp reset pos. USD G1			78,330,072.38	USD	0.74390924		0.7053429		58,270,464.85	-3,020,898.72	0.00	55,249,566.13	9.58
Swaps														
							Accumulo (EUR)			197,748,073.10	-5,490,225.45	0.00	192,257,847.65	33.32
Contratti di swap di tasso														
							Accumulo (EUR)			197,748,073.10	-5,490,225.45	0.00	192,257,847.65	33.32
Strumenti finanziari a termine														
							Accumulo (EUR)			197,748,073.10	-5,490,225.45	0.00	192,257,847.65	33.32
Tesoreria														
Liquidità														
Conti adeguamento														
PLMSUSDG0	PMLEflit Swap escl. PTF			278,808.58	USD	0.70534296		0.7053429		196,655.67	0.00	0.00	196,655.67	0.03
PLMSUSDG1	PMLEflit Swap escl. PTF			14,043,220.77	USD	0.70465853		0.7053429		9,895,675.25	9,611.84	0.00	9,905,287.09	1.72
Conti adeguamento														
							Accumulo (EUR)			10,092,330.92	9,611.84	0.00	10,101,942.76	1.75
Liquidità														
							Accumulo (EUR)			10,092,330.92	9,611.84	0.00	10,101,942.76	1.75
Tesoreria														
							Accumulo (EUR)			10,092,330.92	9,611.84	0.00	10,101,942.76	1.75
DOLLARO DEGLI STATI UNITI														
							Accumulo (EUR)			586,020,215.70	9,628,808.48	0.00	595,649,024.18	103.25
PORTAFOGLIO: LYXOR ETF COMMODITIES CRB (935826)														
							(EUR)			559,063,714.34	17,861,411.62	0.00	576,925,125.96	100.00

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 31/07/09

PORTFOLIO: 935826 LYXOR ETF COMMODITIES CRB

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing

Valuta portafoglio: EUR

(Stato semplificato, trama: Valuta quotazione / Smistamento contabile (4) → GLOBALE, Smistamenti: BV

Portafoglio titoli:		522,208,851.81						
<u>Spese di gestione del giorno</u>								
PrComGestAdmin		3,591.76 EUR						
PrComGestAdmin		1,315.68 EUR						
PrComGestAdmin		624,78 EUR						
Quota	Valuta	Attivo netto	Numero quote	Valore liquidativo	Coefficiente	Cambio	Prezzo stand. sottoscrittore	Prezzo stand. Riacquisto
AD FR0010270033 QUOTE AD	EUR	374,565,335.55	21,250,001.	17.62	64.924427571159		17.62	17.62
BD FR0010318998 QUOTE B	EUR	137,204,937.18	7,785,000.	17.62	23.782104646217		17.97	17.26
CD FR0010414813 QUOTE E	EUR	65,154,853.23	37,000,000.	1.76	11.293467782625		1.79	1.72
Attivo netto totale in EUR:		576,925,125.96						
BD	USD	194,522,299.69		24.98		1,41775	25.47	24.48
CD	USD	92,373,293.17		2.49		1,41775	2.53	2.44
Fiscalità del risparmio: peso e stato delle quote di portafoglio								
Tope Reporting: TSIF TIS France								
Pesi ufficiali al 31/07/09:		Pesi non ufficiali al 31/07/09:						
Peso DD:	0.	Stato DD:	0	Peso DD:	0.			
Peso DI:	0.	Stato DI:	0	Peso DI:	0.			