

LYXOR ETF DJ STOXX 600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES

ATTESTATO DEL REVISORE DEI CONTI
Composizione dell'attivo del 30 dicembre 2009

PriceWaterhouseCoopers

PriceWaterhouseCoopers Audit
63, rue de Villiers
92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Tel.: 01 56 57 58 59
Fax: 01 56 57 58 60

ATTESTATO DEL REVISORE DEI CONTI **Composizione dell'attivo del 30 dicembre 2009**

LYXOR ETF DJ STOXX 600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES

Fondo comune di investimento

Regolato dal codice monetario e finanziario

Sociedad 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 DJ STOXX 600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES 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, 19 febbraio 2010

Il revisore dei conti

PriceWaterhouseCoopers Audit

Firma

Marie-Christine Jetil

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935837 LYXOR ETF DJ600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing (EUR)

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														
Az. & Valori ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
CH0012032048			ROCHE HOLDING AG-BJ	19,810.	P CHF	164.5628	M 30/12/09	175.8	2,149,759.03	189,596.11	0.00	2,339,355.14	5.38	
CH0012138530			CS GROUP AG-NOM	3,826.	P CHF	56.4019	M 30/12/09	51.2	142,852.87	-11,267.46	0.00	131,585.41	0.30	
CH0012221716			ABB LTD-NOM	4,389.	P CHF	19.8355	M 30/12/09	19.94	57,704.10	1,083.20	0.00	58,787.30	0.14	
CH0012332372			SCHWEITZ RUCKVERS.	14,052.	P CHF	45.8661	M 30/12/09	49.91	426,305.51	44,800.37	0.00	471,105.88	1.08	
CH0024899483			UBS AG NOM	62,662.	P CHF	18.4433	M 30/12/09	16.05	761,977.18	-86,404.47	0.00	675,572.71	1.55	
CH0038863350			NESTLE SA	19,997.	P CHF	40.8604	M 30/12/09	50.2	540,591.03	133,721.73	0.00	674,312.76	1.55	
Az. & valori ass. NMR o ass.														
									Accumulo (EUR)	4,079,189.72	271,529.48	0.00	4,350,719.20	10.00
Az. & valori ass. NMR o ass.														
									Accumulo (EUR)	4,079,189.72	271,529.48	0.00	4,350,719.20	10.00
Az. & Valori ass.														
									Accumulo (EUR)	4,079,189.72	271,529.48	0.00	4,350,719.20	10.00
FRANCO SVIZZERO														
									Accumulo (EUR)	4,079,189.72	271,529.48	0.00	4,350,719.20	10.00
EURO														
Az. & Valori ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
Az. & valori ass. NMR o ass.														
DE0005140008			DEUTSCHE BANK AG-NOM	58,505.	P EUR	52.3736	M 30/12/09	49.42	3,064,117.63	-172,800.53	0.00	2,891,317.10	6.65	
DE0005151005			BASF SE	36,263.	P EUR	35.9678	M 30/12/09	43.46	1,304,298.66	271,691.32	0.00	1,575,989.98	3.62	
DE0005190003			BMW	29,819.	P EUR	31.325	M 30/12/09	31.8	934,080.18	14,164.02	0.00	948,244.20	2.18	
DE0005552004			DEUTSCHE POST AG-NOM	29,447.	P EUR	13.59	M 30/12/09	13.485	400,184.73	-3,091.93	0.00	397,092.80	0.91	
DE0005557508			DEUTSCHE TEL AG-NOM	17,080.	P EUR	8.395	M 30/12/09	10.29	143,386.60	32,366.60	0.00	175,753.20	0.40	
DE0007037129			RWE AG	41,997.	P EUR	65.3	M 30/12/09	67.96	2,742,404.10	111,712.02	0.00	2,854,116.12	6.56	
DE0007100000			DAIMLER	37,175.	P EUR	27.1684	M 30/12/09	37.23	1,009,984.03	374,041.22	0.00	1,384,025.25	3.18	
DE0007236101			SIEMENS AG-NOM	848.	P EUR	46.3585	M 30/12/09	64.21	39,311.98	15,138.10	0.00	54,450.08	0.13	
DE0007297004			SUEDZUCKER	21,756.	P EUR	14.42	M 30/12/09	14.54	313,721.52	2,610.72	0.00	316,332.24	0.73	
DE0008404005			ALLIANZ SE-NOM	17,844.	P EUR	81.9	M 30/12/09	87.15	1,461,423.60	93,681.00	0.00	1,555,104.60	3.57	
DE0008404005			ALLIANZ SE-NOM	17,844.	P EUR	81.9	M 30/12/09	87.15	1,461,423.60	93,681.00	0.00	1,555,104.60	3.57	
DE0008404005			ALLIANZ SE-NOM	17,844.	P EUR	81.9	M 30/12/09	87.15	1,461,423.60	93,681.00	0.00	1,555,104.60	3.57	
DE000BAY0017			BAYER AG	42,732.	P EUR	43.337	M 30/12/09	55.96	1,851,876.25	539,406.47	0.00	2,391,282.72	5.50	
DE000ENAG999			E.ON AG	97,630.	P EUR	27.9142	M 30/12/09	29.23	2,725,259.61	128,465.29	0.00	2,853,724.90	6.56	
ES0113900137			BANCO SANTANDER SA	157,442.	P EUR	11.64	M 30/12/09	11.55	1,832,624.88	-14,169.78	0.00	1,818,455.10	4.18	
ES0147645016			IBERDROLA RENOVABL	119,874.	P EUR	3.27	M 30/12/09	3.32	391,987.98	5,993.70	0.00	397,981.68	0.91	
ES0178430E18			TELEFONICA SA	88,638.	P EUR	19.6	M 30/12/09	19.52	1,737,304.80	-7,091.04	0.00	1,730,213.76	3.98	
FI0009006829			SPONDA OYJ	60,933.	P EUR	2.61	M 30/12/09	2.73	159,035.13	7,311.96	0.00	166,347.09	0.38	
FR0000120271			TOTAL SA	42,310.	P EUR	42.6819	M 30/12/09	45.025	1,805,872.46	99,135.29	0.00	1,905,007.75	4.38	
FR0000120578			SANOFI-AVENTIS	29,944.	P EUR	49.5103	M 30/12/09	55.24	1,482,536.83	171,569.73	0.00	1,654,106.56	3.80	
FR0000127771			VIVENDI	23,724.	P EUR	18.79	M 30/12/09	20.845	445,773.96	48,752.82	0.00	494,526.78	1.14	
FR0000131104			BNP PARIBAS	16,458.	P EUR	55.1	M 30/12/09	55.78	906,835.80	11,191.44	0.00	918,027.24	2.11	
FR0000133308			FRANCE TELECOM SA	20,654.	P EUR	17.535	M 30/12/09	17.515	362,167.89	-413.08	0.00	361,754.81	0.83	
IT0000064854			UNICREDIT SPA	563,486.	P EUR	2.3536	M 30/12/09	2.3425	1,326,194.95	-6,228.99	0.00	1,319,965.96	3.03	

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935837 LYXOR ETF DJ600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing (EUR)

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 PRODUZ. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	>-----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET	
IT0000072618			339,872.	P EUR	2.6461	M 30/12/09	3.15		899,318.45	171,278.35	0.00	1,070,596.80	2.46	
IT0003132476			74,265.	P EUR	16.7424	M 30/12/09	17.8		1,243,376.95	78,540.05	0.00	1,321,917.00	3.04	
IT0003487029			40,525.	P EUR	9.895	M 30/12/09	10.04		400,994.88	5,876.12	0.00	406,871.00	0.94	
IT0003856405			42,308.	P EUR	11.41	M 30/12/09	11.19		482,734.28	-9,307.76	0.00	473,426.52	1.09	
LU0323134006			53,326.	P EUR	28.675	M 30/12/09	32.18		1,529,123.05	186,907.63	0.00	1,716,030.68	3.94	
NL000009538			36,819.	P EUR	20.47	M 30/12/09	20.685		753,684.93	7,916.09	0.00	761,601.02	1.75	
NL0000235190			8,079.	P EUR	11.92	M 30/12/09	13.7		96,301.68	14,380.62	0.00	110,682.30	0.25	
PTBES0AM0007			98,607.	P EUR	4.628	M 30/12/09	4.57		456,353.20	-5,719.21	0.00	450,633.99	1.04	
Az. & valori ass. NMR o ass.									Accumulo (EUR)	32,302,270.99	2,173,308.24	0.00	34,475,579.23	79.25
Az. & valori ass. NMR o ass.									Accumulo (EUR)	32,302,270.99	2,173,308.24	0.00	34,475,579.23	79.25
Az. & Valori ass.									Accumulo (EUR)	32,302,270.99	2,173,308.24	0.00	34,475,579.23	79.25
Strumenti finanziari a termine														
Contratti di swap di tasso														
Swaps														
Altre Swaps														
SWPEURG0			Swp reset pos. EUR G0	3,353,117.66	EUR	1.		1.	3,353,117.66	0.00	0.00	3,353,117.66	7.71	
Swaps									Accumulo (EUR)	3,353,117.66	0.00	0.00	3,353,117.66	7.71
Contratti di swap di tasso									Accumulo (EUR)	3,353,117.66	0.00	0.00	3,353,117.66	7.71
Strumenti finanziari a termine									Accumulo (EUR)	3,353,117.66	0.00	0.00	3,353,117.66	7.71
Tesoreria														
Liquidità														
Conti adeguamento														
PLMSEURG0			PMLEfit Swap escl. PTF	406,803.08	EUR	1.		1.	406,803.08	0.00	0.00	406,803.08	0.94	
Spese predisposte														
F120EUR			PrComGestAdmin	-10,458.36	EUR	1.		1.	-10,458.36	0.00	0.00	-10,458.36	-0.02	
Conti adeguamento									Accumulo (EUR)	396,344.72	0.00	0.00	396,344.72	0.91
Liquidità									Accumulo (EUR)	396,344.72	0.00	0.00	396,344.72	0.91

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935837 LYXOR ETF DJ600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing (EUR)

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 PRODUZ. TOT.	VALUTA PORTAFOGLIO PLUS O MINUSVAL.	COUPON CORSO TOT.	>-----> VALORE BORSA	PERC. AZ. NET
Altre disponibilità													
Conti finanziari													
<i>Operazioni a vista</i>													
BK065EUR	Banca EUR SGP		-0.75	EUR	1.		1.		-0.75	0.00	0.00	-0.75	0.00
Conti finanziari													
Accumulo (EUR)													
-0.75													
0.00													
0.00													
-0.75													
Altre disponibilità													
Accumulo (EUR)													
-0.75													
0.00													
0.00													
-0.75													
Tesoreria													
Accumulo (EUR)													
396,343.97													
0.00													
0.00													
396,343.97													
0.91													
EURO													
Accumulo (EUR)													
36,051,732.62													
2,173,308.24													
0.00													
38,225,040.86													
87.87													
YEN													
<i>Az. & Valori ass.</i>													
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>													
<i>Az. & valori ass. NMR o ass.</i>													
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP		12,257.	P JPY	3541.352	M 30/12/09	3880.		329,756.06	29,053.11	0.00	358,809.17	0.82
JP3667600005	JGC		10,029.	P JPY	1742.0821	M 30/12/09	1706.		129,537.33	-449.80	0.00	129,087.53	0.30
JP3743000006	NIPPON MEAT PACKER		9,577.	P JPY	1040.5523	M 30/12/09	1074.		76,565.63	1,037.89	0.00	77,603.52	0.18
JP3802300008	FAST RETAILING		2,722.	P JPY	13085.4533	M 30/12/09	17470.		269,886.26	88,894.09	0.00	358,780.35	0.82
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
805,745.28													
118,535.29													
0.00													
924,280.57													
2.12													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
805,745.28													
118,535.29													
0.00													
924,280.57													
2.12													
Az. & Valori ass.													
Accumulo (EUR)													
805,745.28													
118,535.29													
0.00													
924,280.57													
2.12													
YEN													
Accumulo (EUR)													
805,745.28													
118,535.29													
0.00													
924,280.57													
2.12													
PORTAFOGLIO: LYXOR ETF DJ600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES (935837)													
(EUR)													
40,936,667.62													
2,563,373.01													
0.00													
43,500,040.63													
100.00													

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935837 LYXOR ETF DJ600 INDUSTRIAL GOODS & SERVICES CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing (EUR)

Valuta portafoglio: EUR

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

Portafoglio titoli: 39,750,579.

Spese di gestione del giorno

PrComGestAdmin 357.54 EUR

Quota	Valuta	Attivo netto	Numero quote	Valore liquidativo	Coefficiente	Cambio	Prezzo stand. sottoscrittore	Prezzo stand. Riacquisto
D FR0010344887 QUOTE D	EUR	43,500,040.63	1,760,002	24.71	100.		24.71	24.71

Attivo netto totale in EUR: 43,500,040.63

Fiscalità del risparmio: peso e stato delle quote di portafoglio

Tope Reporting: TSIF TIS France

Pesi ufficiali e stato al 30/12/09:

Peso DD: 0. Stato DD: 0
 Peso DI: 0. Stato DI: 0

Pesi non ufficiali al 30/12/09:

Peso DD: 0.
 Peso DI: 0.