

LYXOR ETF DJ STOXX 600 AUTOMOBILE & PARTS

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 AUTOMOBILE & PARTS

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 AUTOMOBILE & PARTS 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: 935833 LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS

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
FRANCO SVIZZERO													
Az. & Valori ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
CH0010570759		LINDT & SPRUENGLI	9.	P CHF	27086,7933	M 30/12/09	25405.		161,375.00	-7,787.98	0.00	153,587.02	0.17
CH0012032048		ROCHE HOLDING AG-BJ	33,631.	P CHF	162,4643	M 30/12/09	175.8		3,619,896.98	351,574.64	0.00	3,971,471.62	4.38
CH0012138530		CS GROUP AG-NOM	10,533.	P CHF	50,5281	M 30/12/09	51.2		352,365.08	9,890.31	0.00	362,255.39	0.40
CH0024899483		UBS AG NOM	18,925.	P CHF	16,8995	M 30/12/09	16.05		211,663.25	-7,628.69	0.00	204,034.56	0.23
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
									4,345,300.31	346,048.28	0.00	4,691,348.59	5.17
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
									4,345,300.31	346,048.28	0.00	4,691,348.59	5.17
Az. & Valori ass.													
Accumulo (EUR)													
									4,345,300.31	346,048.28	0.00	4,691,348.59	5.17
FRANCO SVIZZERO													
Accumulo (EUR)													
									4,345,300.31	346,048.28	0.00	4,691,348.59	5.17
CORONA DANESE													
Az. & Valori ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
DK0010274414		DANSKE BANK A/S	42,011.	P DKK	119,7395	M 30/12/09	118.		676,017.02	-9,852.31	0.00	666,164.71	0.73
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
									676,017.02	-9,852.31	0.00	666,164.71	0.73
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
									676,017.02	-9,852.31	0.00	666,164.71	0.73
Az. & Valori ass.													
Accumulo (EUR)													
									676,017.02	-9,852.31	0.00	666,164.71	0.73
CORONA DANESE													
Accumulo (EUR)													
									676,017.02	-9,852.31	0.00	666,164.71	0.73
EURO													
Az. & Valori ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
AT0000743059		OMV AG	35,899.	P EUR	28.8	M 30/12/09	30.7		1,033,891.20	68,208.10	0.00	1,102,099.30	1.22
BE0003739530		UCB SA	12,840.	P EUR	30.6	M 30/12/09	30.16		392,904.00	-5,649.60	0.00	387,254.40	0.43
BE0003793107		AHNEUSER-BUSH INBEV	67,371.	P EUR	35,2415	M 30/12/09	36.25		2,374,252.16	67,946.59	0.00	2,442,198.75	2.69
DE0005140008		DEUTSCHE BANK AG-NOM	2,822.	P EUR	43.67	M 30/12/09	49.42		123,236.74	16,226.50	0.00	139,463.24	0.15
DE0005552004		DEUTSCHE POST AG-NOM	52,075.	P EUR	12,5693	M 30/12/09	13.485		654,547.60	47,683.78	0.00	702,231.38	0.77
DE0005557508		DEUTSCHE TEL AG-NOM	74,521.	P EUR	8,3416	M 30/12/09	10.29		621,625.39	145,195.70	0.00	766,821.09	0.85
DE0006483001		LINDE AG	28,019.	P EUR	81.88	M 30/12/09	84.16		2,294,195.72	63,883.32	0.00	2,358,079.04	2.60

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935833 LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS

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	
DE0007100000 DAIMLER			43,271.	P EUR	28.881	M 30/12/09	37.23		1,249,708.78	361,270.55	0.00	1,610,979.33	1.78	
DE0007236101 SIEMENS AG-NOM			72,533.	P EUR	59.9722	M 30/12/09	64.21		4,349,961.06	307,382.87	0.00	4,657,343.93	5.14	
DE0007257503 METRO			179.	P EUR	42.28	M 30/12/09	42.57		7,568.12	51.91	0.00	7,620.03	0.01	
DE0007480204 DEUTSCHE EUROSHOP AG			16,750.	P EUR	23.2	M 30/12/09	23.67		388,600.00	7,872.50	0.00	396,472.50	0.44	
DE0008404005 ALLIANZ SE-NOM			2,376.	P EUR	71.2	M 30/12/09	87.15		169,171.20	37,897.20	0.00	207,068.40	0.23	
DE0008430026 WUENCHENER RU AG-NOM			8,536.	P EUR	106.49	M 30/12/09	108.67		908,998.64	18,608.48	0.00	927,607.12	1.02	
DE0008BAY0017 BAYER AG			16,226.	P EUR	40.6	M 30/12/09	55.96		658,775.60	249,231.36	0.00	908,006.96	1.00	
DE0008ENAG999 E.ON AG			237,297.	P EUR	28.0323	M 30/12/09	29.23		6,651,985.23	284,206.08	0.00	6,936,191.31	7.65	
ES0113900J37 BANCO SANTANDER SA			544,360.	P EUR	11.7067	M 30/12/09	11.55		6,372,656.68	-85,298.68	0.00	6,287,358.00	6.94	
ES0178430E18 TELEFONICA SA			103,404.	P EUR	19.32	M 30/12/09	19.52		1,997,765.28	20,680.80	0.00	2,018,446.08	2.23	
FI0009000681 NOKIA OYJ			51,087.	P EUR	8.8571	M 30/12/09	8.92		452,481.05	3,214.99	0.00	455,696.04	0.50	
FR0000045072 CREDIT AGRICOLE SA			31,039.	P EUR	13.515	M 30/12/09	12.39		419,492.09	-34,918.88	0.00	384,573.21	0.42	
FR0000053225 NG			19,284.	P EUR	18.2	M 30/12/09	17.95		350,968.80	-4,821.00	0.00	346,147.80	0.38	
FR0000120271 TOTAL SA			103,868.	P EUR	42.6985	M 30/12/09	45.025		4,435,009.25	241,647.45	0.00	4,676,656.70	5.16	
FR0000120354 VALLOUREC			71,307.	P EUR	125.15	M 30/12/09	127.7		8,924,071.05	181,832.85	0.00	9,105,903.90	10.04	
FR0000120537 LAFARGE SA			7,884.	P EUR	55.11	M 30/12/09	58.07		434,487.24	23,336.64	0.00	457,823.88	0.51	
FR0000120578 SANOFI-AVENTIS			81,000.	P EUR	53.3395	M 30/12/09	55.24		4,320,495.52	153,944.48	0.00	4,474,440.00	4.94	
FR0000120628 AXA			85,566.	P EUR	19.2832	M 30/12/09	16.625		1,649,984.60	-227,449.85	0.00	1,422,534.75	1.57	
FR0000124141 VEOLIA ENVIRONNEME			33,577.	P EUR	22.785	M 30/12/09	23.13		765,051.95	11,584.06	0.00	776,636.01	0.86	
FR0000125585 CASINO GUICHARD			5,678.	P EUR	48.745	M 30/12/09	62.52		276,774.11	78,214.45	0.00	354,988.56	0.39	
FR0000131104 BNP PARIBAS			58,813.	P EUR	54.36	M 30/12/09	55.78		3,197,074.68	83,514.46	0.00	3,280,589.14	3.62	
FR0000133308 FRANCE TELECOM SA			220,839.	P EUR	17.3844	M 30/12/09	17.515		3,839,153.84	28,841.25	0.00	3,867,995.09	4.27	
FR0010221234 EUTELSAT COMMUNICA			26,839.	P EUR	22.505	M 30/12/09	22.495		604,011.70	-268.39	0.00	603,743.31	0.67	
FR0010613471 SUEZ ENVIRONNEMENT			8,984.	P EUR	16.19	M 30/12/09	16.1		145,450.96	-808.56	0.00	144,642.40	0.16	
GB00B03MLX29 ROYAL DUTCH SHELL			116,133.	P EUR	20.6069	M 30/12/09	21.13		2,393,142.37	60,747.92	0.00	2,453,890.29	2.71	
IT0000064854 UNICREDIT SPA			876,409.	P EUR	2.3395	M 30/12/09	2.3425		2,050,316.98	2,671.10	0.00	2,052,988.08	2.26	
IT0000072618 INTESA SANPAOLO SPA			76,935.	P EUR	2.8843	M 30/12/09	3.15		221,906.63	20,438.62	0.00	242,345.25	0.27	
IT0001233417 AZA			28,061.	P EUR	1.34	M 30/12/09	1.466		37,601.74	3,535.69	0.00	41,137.43	0.05	
IT0003128367 ENEL SPA			437,345.	P EUR	4.045	M 30/12/09	4.0475		1,769,060.53	1,093.36	0.00	1,770,153.89	1.95	
IT0003497168 TELECOM ITALIA SPA			908,396.	P EUR	1.199	M 30/12/09	1.088		1,089,166.81	-100,831.96	0.00	988,334.85	1.09	
IT0003977540 ANSALDO STS SPA			39,011.	P EUR	12.81	M 30/12/09	13.31		499,730.91	19,505.50	0.00	519,236.41	0.57	
LU0323134006 ARCELORMITTAL SA			144,569.	P EUR	30.5288	M 30/12/09	32.18		4,413,513.01	238,717.41	0.00	4,652,230.42	5.13	
NL0000235190 EADS			56,682.	P EUR	12.155	M 30/12/09	13.7		688,969.71	87,573.69	0.00	776,543.40	0.86	
NL0000288967 CORIO			16,320.	P EUR	48.03	M 30/12/09	46.735		783,849.60	-21,134.40	0.00	762,715.20	0.84	
NL0006034001 ASML HOLDING NV			23,022.	P EUR	24.24	M 30/12/09	23.95		558,053.28	-6,676.38	0.00	551,376.90	0.61	
Az. & valori ass. NMR o ass.									Accumulo (EUR)	74,569,661.81	2,448,901.96	0.00	77,018,563.77	84.96
Az. & valori ass. NMR o ass.									Accumulo (EUR)	74,569,661.81	2,448,901.96	0.00	77,018,563.77	84.96
Az. & Valori ass.									Accumulo (EUR)	74,569,661.81	2,448,901.96	0.00	77,018,563.77	84.96

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935833 LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS

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
Strumenti finanziari a termine													
Contratti di swap di tasso													
Swaps													
<i>Altre Swaps</i>													
SWPEURG0			Swp reset pos. EUR G0	7,843,768.75	EUR	1.	1.		7,843,768.75	0.00	0.00	7,843,768.75	8.65
Swaps													
Accumulo (EUR)													
7,843,768.75													
0.00													
0.00													
7,843,768.75													
8.65													
Contratti di swap di tasso													
Accumulo (EUR)													
7,843,768.75													
0.00													
0.00													
7,843,768.75													
8.65													
Strumenti finanziari a termine													
Accumulo (EUR)													
7,843,768.75													
0.00													
0.00													
7,843,768.75													
8.65													
Tesoreria													
Liquidità													
Conti adeguamento													
PLMSEURG0			PMLEfit Swap escl. PTF	-695,684.06	EUR	1.	1.		-695,684.06	0.00	0.00	-695,684.06	-0.77
<i>Spese predisposte</i>													
F120EUR			PrComGestAdmin	-21,698.73	EUR	1.	1.		-21,698.73	0.00	0.00	-21,698.73	-0.02
Conti adeguamento													
Accumulo (EUR)													
-717,382.79													
0.00													
0.00													
-717,382.79													
-0.79													
Liquidità													
Accumulo (EUR)													
-717,382.79													
0.00													
0.00													
-717,382.79													
-0.79													
Tesoreria													
Accumulo (EUR)													
-717,382.79													
0.00													
0.00													
-717,382.79													
-0.79													
EURO													
Accumulo (EUR)													
81,696,047.77													
2,448,901.96													
0.00													
84,144,949.73													
92.82													
YEN													
Az. & Valori ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
JP342060003			SEKISUI HOUSE LTD	26,677.	P JPY	770.8627	M 30/12/09	839.	157,173.72	11,693.98	0.00	168,867.70	0.19
JP3633400001			TOYOTA MOTOR CORP	28,984.	P JPY	3677.8368	M 30/12/09	3880.	813,737.72	34,734.59	0.00	848,472.31	0.94
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
970,911.44													
46,428.57													
0.00													
1,017,340.01													
1.12													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)													
970,911.44													
46,428.57													
0.00													
1,017,340.01													
1.12													

Inventario cronistoria di valorizzazione (HISINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935833 LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS

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
Az. & Valori ass.													
Accumulo (EUR)									970,911.44	46,428.57	0.00	1,017,340.01	1.12
YEN													
Accumulo (EUR)									970,911.44	46,428.57	0.00	1,017,340.01	1.12
CORONA SVEDESE													
Az. & Valori ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Az. & valori ass. NMR o ass.													
SE0000255648	ASSA	ABLOY B	10,127	P SEK	136.5692	M-30/12/09	137.8		132,239.80	3,734.15	0.00	135,973.95	0.15
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)									132,239.80	3,734.15	0.00	135,973.95	0.15
Az. & valori ass. NMR o ass.													
Accumulo (EUR)									132,239.80	3,734.15	0.00	135,973.95	0.15
Az. & Valori ass.													
Accumulo (EUR)									132,239.80	3,734.15	0.00	135,973.95	0.15
CORONA SVEDESE													
Accumulo (EUR)									132,239.80	3,734.15	0.00	135,973.95	0.15
PORTAFOGLIO: LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS (935833)													
(EUR)									87,820,516.34	2,835,260.65	0.00	90,655,776.99	100.00

Inventario cronistoria di valorizzazione (H/SINV)

Stock: Stock ammesso principale al 30/12/09

PORTAFOGLIO: 935833 LYXOR ETF DJ600 AUTOMOBILE & PARTS

CONVALIDA PARZIALE

Valuta fixing: WMC WM Closing (EUR)

Valuta portafoglio: EUR

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

Portafoglio titoli: 83,529,391.03

Spese di gestione del giorno

PrComGestAdmin 745.12 EUR

Quota	Valuta	Attivo netto	Numero quote	Valore liquidativo	Coefficiente	Cambio	Prezzo stand. sottoscrittore	Prezzo stand. Riacquisto
D FR0010344630 QUOTE D	EUR	90,655,776.99	3,844,764.	23.57	100.		23.57	23.57

Attivo netto totale in EUR: 90,655,776.99

Fiscalità del risparmio: peso e stato delle quote di portafoglio

Tope Reporting: TSIF TIS France

Pesi ufficiali e stato al 30/06/09:

Peso DD: 0. Stato DD: 0

Peso DI: 0. Stato DI: 0