

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source ETF

10/2013

DESCRIPTION

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source ETF is a UCITS compliant exchange-traded fund incorporated in Ireland. The aim of the Fund is to track the performance of the BofA ML 0-5 Year US High Yield Constrained Index.

FICHE D'IDENTITE

| | | | |
|----------------|------------------|------------------|--------------------|
| Code ISIN | IE00B7N3YW49 | Type | ETF |
| Code Bloomberg | STHY LN Equity | Devise | USD |
| Date lancement | 15/03/2012 | Actifs | 570 MUSD (416MEUR) |
| | | Benchmark | - |
| | | Frais de gestion | 0,55% |
| Téléphone | +44-20-3370-1100 | P.E.A | N |
| | | Dépositaire | - |
| Web Address: | www.source.info | Auditeur | - |

DIVIDENDES

| | | | |
|----------------------|--------|-----------------------------|-------------------------|
| Capi. / Distr. | D | Périodicité | Monthly |
| Taux de rendement | - | Date dernier ex. - paiement | 16/10/2013 - 31/10/2013 |
| Taux de distribution | 4,98 % | Dernier dividende | 0,381488 USD |

STRUCTURE

| | | | |
|------------------|----------|----------------|---|
| Mode réplication | Physique | Prêt de Titres | N |
| UCITS | Y | | |

EXPOSITION

| | | | |
|-------------------|--------------|-----------------|-----------------------|
| Classe d'actifs | Fixed Income | Type | Corporate High Yield- |
| Zone Géographique | U.S. | Maturité | -Short-Term |
| Secteur | -- | Levier | N |
| Thème | - | Devise Couverte | N |

PEER GROUP

| Code Isin | Libellé |
|--------------|---|
| US72201R7834 | PIMCO 0-5 Year High Yield Corporate Bond Index Excha |
| IE00BCRY6003 | iShares \$ Short Duration High Yield Corporate Bond UCI |
| US46434V4077 | iShares 0-5 Year High Yield Corporate Bond ETF |
| IE00B7N3YW49 | PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Sou |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |

PERFORMANCES ET QUALITE DE REPLICATION

| Performances | | | | | |
|-----------------------------|---------|---------|---------|---------|---------------|
| | T3 2013 | T2 2013 | T1 2013 | T4 2012 | Cumul 12 mois |
| PIMCO SH TERM H/Y CORP BOND | 3,3 | -0,5 | 2,5 | 2,8 | 8,2 |
| - | - | - | - | - | - |

| Performances | | | | | |
|-----------------------------|------|------|------|------|------|
| | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 |
| PIMCO SH TERM H/Y CORP BOND | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - |

| Tracking Error NAV | | | | | |
|---------------------------------|-----------|-----------|-------|------|------|
| | 1 mois*** | 3 mois*** | 1yr** | 3yr* | 5yr* |
| NAV PIMCO SH TERM H/Y CORP BOND | - | - | - | - | - |
| Peer Group | - | - | - | - | - |

* : Mensuel ; ** : Hebdomadaire ; *** : Quotidien

| Prime / Décote vs NAV | Moyenne | + Bas | + Haut |
|-----------------------------|---------|------------|------------|
| Période/ Date | 1an | 28/11/2012 | 05/06/2013 |
| PIMCO SH TERM H/Y CORP BOND | 0,3 | -0,3 | 0,7 |
| Peer Group | 0,2 | -0,2 | 0,5 |

LIQUIDITE

| Liquidité (*) | STHY LN | Moyenne Peer Group |
|----------------------------|---------|--------------------|
| Actifs | 570,41 | 949,72 |
| Spread bid/ask moyen 30j | 0,43 | 0,32 |
| Spread bid/ask moyen 2 ans | 0,33 | - |

(*) Il n'existe pas de mesure totalement satisfaisante de la liquidité. Pour un indice donné, les ETF les plus gros sont souvent les plus liquides. Le spread bid-ask est un bon indicateur de la liquidité. Celui-ci doit être utilisé avec prudence car 1/ Vous obtiendrez un spread légèrement différent OTC (gré à gré), 2/ le spread affiché ne tient pas compte de la taille de votre ordre. L'amélioration n'est pas une fonction linéaire de la taille.

FRAIS

| Frais | STHY LN | Moyenne Peer Group |
|-------------------------|---------|--------------------|
| Gestion | 0,55 | 0,51 |
| Souscription / Rachat * | - | - |

(*) Les frais de souscription / rachat dans la mesure où l'opération est réalisée à la NAV comme un OPCVM classique. Dans ce cas, il n'y a pas de commission de bourse.

CONCENTRATION

| Concentration | STHY LN | Moyenne Peer Group |
|---------------------------|---------|--------------------|
| Pond. 10 premières lignes | 12,18 | 12,97 |

- : Données non disponibles