

ComStage ETF PSI 20 Leverage

10/2013

DESCRIPTION

ComStage ETF PSI 20 Leverage is an ETF incorporated in Portugal. The objective of the Fund is to reproduce the performance of the PSI 20 Leverage Index. The Fund will mainly invest in equity securities that compose the theoretical portfolio of said index.

FICHE D'IDENTITE

| | | | |
|----------------|----------------------------------|------------------|--|
| Code ISIN | LU0444605306 | Type | ETF |
| Code Bloomberg | PP2 PL Equity | Devise | EUR |
| Date lancement | 06/09/2010 | Actifs | 8 MEUR |
| | | Benchmark | - |
| Téléphone | 352-2696-2030 | Frais de gestion | 0,35% |
| | | P.E.A | N |
| Web Address: | www2.comstage.commerzbank.com/Nr | Dépositaire | BNP Paribas Securities Services/Luxembourg |
| | | Auditeur | PricewaterhouseCoopers SARL |

DIVIDENDES

| | | | |
|----------------------|--------|-----------------------------|-------|
| Capi. / Distr. | C | | |
| Taux de rendement | 3,98 % | Date dernier ex. - paiement | - - - |
| Taux de distribution | - | Dernier dividende | - |

STRUCTURE

| | | | |
|---------------|-------------|----------------|---------|
| Mode réplique | Synthétique | Prêt de Titres | Unknown |
| UCITS | Y | | |

EXPOSITION

| | | | |
|-------------------|----------|-----------------------|-------|
| Classe d'actifs | Equity | Taille Capitalisation | Large |
| Zone Géographique | Portugal | Style | Blend |
| Secteur | -- | Levier | N |
| Thème | - | Devise Couverte | N |

PEER GROUP

| Code Isin | Libellé |
|--------------|------------------------------|
| LU0444605306 | ComStage ETF PSI 20 Leverage |
| LU0444605215 | ComStage ETF PSI 20 |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |

PERFORMANCES ET QUALITE DE REPLICATION

| Performances | | | | | |
|-----------------------------|---------|---------|---------|---------|---------------|
| | T3 2013 | T2 2013 | T1 2013 | T4 2012 | Cumul 12 mois |
| COMSTAGE ETF PSI 20 LEVERAG | 13,1 | -5,1 | 5,3 | 17,2 | 32,3 |
| - | - | - | - | - | - |

| Performances | | | | | |
|-----------------------------|------|-------|------|------|------|
| | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 |
| COMSTAGE ETF PSI 20 LEVERAG | 12,7 | -49,0 | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - |

| Tracking Error NAV | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|-------|------|------|
| | 1 mois*** | 3 mois*** | 1yr** | 3yr* | 5yr* |
| NAV COMSTAGE ETF PSI 20 LEV | 9,3 | 5,9 | 3,5 | 5,9 | - |
| Peer Group | 7,0 | 4,4 | 2,7 | 4,1 | - |

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

| Prime / Décote vs NAV | Moyenne | + Bas | + Haut |
|-----------------------------|---------|------------|------------|
| Période/ Date | 1an | 12/10/2012 | 21/06/2013 |
| COMSTAGE ETF PSI 20 LEVERAG | 0,1 | -1,3 | 1,5 |
| Peer Group | 0,0 | -1,1 | 1,2 |

LIQUIDITE

| Liquidité (*) | PP2 PL | Moyenne Peer Group |
|----------------------------|--------|--------------------|
| Actifs | 7,62 | 20,30 |
| Spread bid/ask moyen 30j | 0,80 | 0,52 |
| Spread bid/ask moyen 2 ans | 0,65 | - |

(*) 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 | PP2 PL | Moyenne Peer Group |
|-------------------------|--------|--------------------|
| Gestion | 0,35 | 0,35 |
| 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 | PP2 PL | Moyenne Peer Group |
|---------------------------|--------|--------------------|
| Pond. 10 premières lignes | 51,57 | 48,89 |

- : Données non disponibles