

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/N	Dépositaire	BNP Paribas Securities Services/Luxembourg
		Auditeur	PricewaterhouseCoopers SARL

DIVIDENDES

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

STRUCTURE

Mode réplication	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