

PanEuroLife Top Return Fd

Données



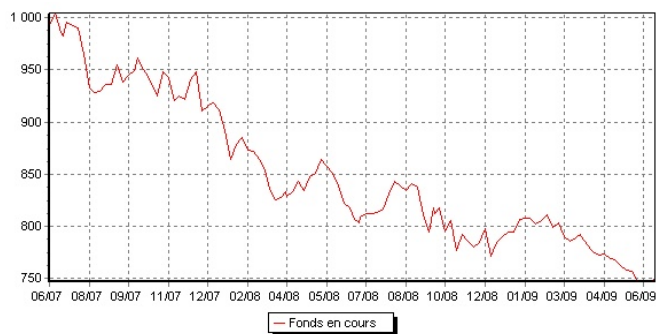
Performances

Valeur d'inventaire (VI) *

Performance (%) 1 mois 3 mois 6 mois 1 an

2009 2008 2007 2006

Rendement annuel (depuis lancement - %)

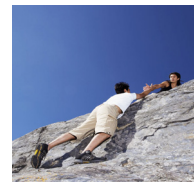


Disponibilité

Description

PanEuroLife Top Return

Bilan mensuel du 03 juin 2009



Caractéristiques

Type	EMTN
Garantie	Caisse Centrale de Crédit Immobilier de France
Devise	EUR
Date de lancement	11/06/2007
Date d'échéance	12/06/2015
Garantie du capital	Automatique
Remboursement	L'objectif du fonds est de verser un coupon annuel indexé sur la performance d'un panier de 20 actions et de rembourser à maturité 100% de la valeur nominale de l'investissement.

Chaque année, le souscripteur perçoit un coupon variable égal à la moyenne des Taux de Rendement Interne de chaque action (ce coupon ne pouvant être négatif).

Le Taux de Rendement Interne est calculé comme suit:

$$TRI = [(\text{valeur de l'action depuis l'origine})^{(1/n)}] - 1$$

A maturité, le souscripteur reçoit 100% de la valeur nominale de son investissement majorée du dernier coupon potentiel.

Valorisation

VNI au	03/06/2009	75.69%
--------	------------	--------

Versement des coupons

Date de versement	Montant	Date de versement	Montant
11/06/2008	0.00%	11/06/2012	-
11/06/2009	-	11/06/2013	-
11/06/2010	-	11/06/2014	-
11/06/2011	-	12/06/2015	-

Valeur potentielle au 03/06/2009

Simulation de la performance à maturité

Performance du panier cible	Performance au 02/06/2009
Performance théorique du panier cible	-18.78%
Valeur potentielle du coupon variable en année 2	0.00%
Valeur de remboursement théorique	100.00%
Taux de rendement théorique ⁽¹⁾	0.00%

⁽¹⁾ Coupons réinvestis à 3%

La composition du panier cible, le calcul de sa performance, la valeur de remboursement et le taux de rendement théorique correspondant ont été simulés sur la base des cours de clôture du 02/06/2009.

Il s'agit d'une simulation de la valeur potentielle de remboursement en prenant comme hypothèse que la maturité intervient au 03/06/2009.

Performance du panier et rappel des constatations

Sous-jacents	Performances constatées du panier intermédiaire au								TRI au 02/06/09
	04/06/08	04/06/09	04/06/10	04/06/11	04/06/12	04/06/13	04/06/14	04/06/15	
ALLEANZA	- 18.85%	- 26.00%
IMPERIAL TOBACCO	- 1.03%	- 11.39%
ASTELLAS	- 18.40%	- 21.09%
BAT	+ 14.88%	+ 0.99%
CON EDISON	- 12.27%	- 12.23%
DEUTSCHE TELEKOM	- 21.61%	- 22.71%
ENI	- 3.55%	- 17.81%
FRANCE TEL.	- 9.42%	- 11.73%
MEDIASET	- 34.28%	- 25.85%
MITSUBISHI	+ 15.92%	- 22.83%
NESTLE	+ 10.40%	- 8.01%
NTT DOCOMO	- 17.95%	- 15.21%
RD SHELL	- 8.20%	- 17.22%
RENTOKIL	- 40.83%	- 30.34%
RWE	+ 3.57%	- 13.24%
SEVEN & I HOLDINGS	- 8.99%	- 18.35%
STORA ENSO	- 43.74%	- 43.36%
SWISSCOM	- 13.45%	- 12.60%
TOKYO GAS	- 33.72%	- 24.38%
TOKYO POWER	- 33.42%	- 22.30%
Performance du panier cible	-13.75%	-	-	-	-	-	-	-	- 18.78%

Les informations proviennent de sources considérées comme fiables, sous réserve d'erreur ou d'omission, auquel cas Private Estate Life s'arroge le droit d'y apporter ultérieurement toute modification utile. Private Estate Life ne saurait être tenue responsable pour tout préjudice direct ou indirect qui pourrait résulter de l'utilisation par le souscripteur de ces informations. Si vous souhaitez prendre connaissance des caractéristiques détaillées du fonds, nous vous invitons à consulter la note d'information.