

# TRIOPLUS

FORME JURIDIQUE DE L'OPCVM  
SOCIETE DE GESTION  
DEPOSITAIRE  
ETABLISSEMENTS DESIGNES POUR RECEVOIR  
LES SOUSCRIPTIONS ET LES RACHATS  
COMMISSAIRE AUX COMPTES

FONDS COMMUN DE PLACEMENT  
LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT  
SOCIETE GENERALE  
SOCIETE GENERALE

PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

COMPARTIMENT	Non
NOURRICIER :	Non
CODE ISIN	FR0000971871

## CARACTERISTIQUES FINANCIERES

CLASSIFICATION : Fonds à formule.

Garantie intégrale du capital à l'échéance (hors droit d'entrée).

OBJECTIF DE GESTION : L'objectif de gestion du FCP est de garantir à échéance le capital initialement investi. Le capital remboursé à échéance sera égal montant le plus élevé entre un pourcentage variable (compris entre 100% et 300%) du capital initial et une participation (comprise entre 80% et 120%) à la valeur moyenne d'un panier d'actions internationales.

Les Actions composant initialement le Panier (tels que définis ci-dessous) sont les suivantes :

Dénomination	Secteur	Code Reuter	Pays	Bourse
Canon	Electronique	7751.T	Japon	Tokyo
Carrefour	Distribution	CARR.PA	France	Paris
CGNU	Assurance	CGNU.L	Royaume-Uni	Londres
Chevron	Pétrole	CHV.N	Etats-Unis	NYSE
Commerzbank	Banque	CBKG.DE	Allemagne	Francfort (Xetra)
Danone	Agroalimentaire	DANO.PA	France	Paris
Du Pont de Nemours	Chimie	DD.N	Etats-Unis	NYSE
Ericsson	Télécommunications	LMEb.ST	Suède	Stockholm
General Motors	Automobile	GM.N	Etats-Unis	NYSE
Lafarge	Matériaux de construction	LAFF.PA	France	Paris
Pfizer	Pharmacie	PFE.N	Etats-Unis	NYSE
Sony	Electronique	6758.T	Japon	Tokyo
Total Fina Elf	Pétrole	TOTF.PA	France	Paris
Toyota	Automobile	7203.T	Japon	Japon
UBS	Banque	UBSZn.S	Suisse	Zürich

Risque de change : Non.

Au cours de la période de souscription comprise entre le 16 avril 2001 et le 27 juin 2001, la valeur liquidative progressera régulièrement selon un taux proche du marché monétaire.

GARANTIE : **Etablissement garant** : SOCIETE GENERALE.

La garantie donnée par la Société Générale au FCP porte sur la valeur liquidative finale, soit celle du 24 juin 2009. Cette valeur liquidative garantie (ci-après, la « **Valeur Liquidative Garantie** ») est définie comme étant celle qui permet, à tout porteur ayant souscrit ses parts entre le 16 avril 2001 (inclus) et le 27 juin 2001 (inclus), et en demandant le rachat sur la base de la valeur liquidative du 24 juin 2009, de bénéficier d'une valeur liquidative de rachat définie selon les cas ci-dessous :

**Premier cas** : Lors des 7<sup>ème</sup> et 8<sup>ème</sup> années, le cours de clôture de chacune des 15 Actions du Panier constaté à chacune des 8 Dates de Constatations Trimestrielles (telles que définies ci-après) a toujours été supérieur à 60% de son Cours Initial

La Valeur Liquidative Garantie est alors égale au plus élevé des deux montants suivants :

- (i) VLR x 300%.
- (ii) VLR x 120% x Valeur Finale du Panier.

Où VLR signifie la valeur liquidative de référence, soit la plus haute valeur liquidative constatée entre le 16 avril 2001 inclus et le 27 juin 2001 inclus (hors commissions de souscription).

### Exemples chiffrés :

Ces exemples chiffrés sont donnés à titre indicatif uniquement, et ne préjugent en rien des performances passées, présentes ou futures du FCP.

#### Hypothèses ;

- Aucune action ne cote en dessous de 60% de son Cours Initial lors des 8 Dates de Constatations Trimestrielles ;
- La Valeur Finale du Panier est de 200% ;
- L'investissement initial du porteur de parts est de 100 EUR ;

A l'échéance, l'investisseur reçoit le montant le plus élevé entre les deux montants suivants :

**Montant 1** = VLR x 300% = **300 EUR**

**Montant 2** = VLR x 120% x Valeur Finale du Panier = 100 x 120% x 200% = **240 EUR**

L'investisseur qui a initialement investi 100 Euros reçoit donc, le 24 juin 2009, un montant égal à **300 Euros**. Il réalise une performance de 200% et le taux actuariel de son investissement est de 14,72%.

**Deuxième cas** : Lors des 7<sup>ème</sup> et 8<sup>ème</sup> années, au moins une des 15 Actions du Panier a connu un cours de clôture inférieur ou égal à 60% de son Cours Initial à l'une des 8 Dates de Constatations Trimestrielles.

La Valeur Liquidative Garantie est alors égale au plus élevé des deux montants suivants :

- (i)  $VLR \times [100\% + (25\% \times N)]$   
 (ii)  $VLR \times [80\% + (5\% \times N)] \times \text{Valeur Finale du Panier}$

Où :

- N est égal au nombre de Dates de Constatations Trimestrielles successives à partir du 28 septembre 2007 précédant celle à laquelle, pour la première fois, une Action du Panier a un cours de clôture inférieur ou égal à 60% de son Cours Initial.
- Les Dates de Constatations Trimestrielles sont les suivantes: le 28 septembre 2007, 31 décembre 2007, 31 mars 2008, 30 juin 2008, 30 septembre 2008, 31 décembre 2008, 31 mars 2009 et 22 juin 2009. Si, pour une Action du Panier, l'un de ces jours n'est pas un Jour de Bourse, le calcul prendra en compte son cours de clôture du Jour de Bourse suivant ;
- Valeur Finale du Panier : moyenne arithmétique, calculée le 24 juin 2009, des Valeurs du Panier ;
- Valeur du Panier : calculée à chaque Date de Constatation Annuelle, elle est égale à la moyenne arithmétique des Evolutions de chaque Action du Panier ; les Valeurs du Panier inférieures à 100% seront réputées être égales à 100%.
- Evolution : signifie, à une Date de Constatation Annuelle, pour une Action du Panier donnée, le rapport entre (i) son cours de clôture constaté à cette date et (ii) son Cours Initial. Ce résultat est exprimé en pourcentage ;
- Cours Initial : signifie pour une Action du Panier, son cours de clôture sur la bourse y afférente constaté le 27 juin 2001 ou si ce jour n'est pas un Jour de Bourse, son cours de clôture du Jour de Bourse suivant ;
- Les Dates de Constatations Annuelles sont les suivantes: le 27 juin 2002, 27 juin 2003, 28 juin 2004, 27 juin 2005, 27 juin 2006, 27 juin 2007, 27 juin 2008, 22 juin 2009. Si, pour une Action du Panier, l'un de ces jours n'est pas un Jour de Bourse, le calcul prendra en compte son cours de clôture du Jour de Bourse suivant ;
- Panier : signifie le panier équilibré composé des 15 Actions ;
- Action : signifie une action de la liste ci-dessus ;
- Jour de Bourse : signifie, pour chaque Action, tout jour où la bourse sur laquelle l'Action est cotée, est ouverte et en fonctionnement régulier ;

*Ces exemples chiffrés sont donnés à titre indicatif uniquement, et ne préjugent en rien des performances passées, présentes ou futures du FCP.*

**Exemples chiffrés :**

Vous avez investi initialement 100 Euros, et la Valeur Finale du Panier est de 200%.				
Si une action au moins clôture en-dessous de 60% de sa valeur initiale,		Vous recevez à l'échéance le montant le plus élevé entre :		
A la date...	N	Le montant (i) ci-dessous, soit $VLR \times (100\% + 25\% \times N)$	Et le montant (ii) ci-dessus, soit $VLR \times (80\% + 5\% \times N) \times \text{Valeur Finale du Panier}$	Soit une Valeur Liquidative Garantie en Euros
28-Sep-07	0	100	160	160
31-Dec-07	1	125	170	170
31-Mar-08	2	150	180	180
30-Jun-08	3	175	190	190
30-Sep-08	4	200	200	200
31-Dec-08	5	225	210	225
31-Mar-09	6	250	220	250
22-Jun-09	7	275	230	275

Les porteurs ayant souscrit des parts du FCP entre le 16 avril 2001 (inclus) et le 27 juin 2001 (inclus) et demandant le rachat de ces mêmes parts sur la base de la valeur liquidative du 24 juin 2009 bénéficieront de la Valeur Liquidative Garantie.

Les parts du FCP souscrites postérieurement au 27 juin 2001 (sur la base de la valeur liquidative du jour de souscription de ces parts) et dont le rachat est demandé sur la base de la valeur liquidative du 24 juin 2009 bénéficieront d'une protection à hauteur de la Valeur Liquidative Garantie.

Les porteurs, quelque soit la date de souscription de leur parts, demandant le rachat de ces mêmes parts sur la base d'une valeur liquidative autre que celle du 24 juin 2009 ne bénéficieront pas de la Valeur Liquidative Garantie.

La société de gestion du FCP exercera la garantie pour le compte du fonds. Dans l'hypothèse où, le 24 juin 2009 l'actif net du FCP ne serait pas suffisant, Société Générale versera au FCP le complément pour atteindre la Valeur Liquidative Garantie.

En dehors de la date de mise en jeu de la garantie (le 24 juin 2009), la valeur liquidative soumise à l'évolution des marchés peut être différente de la Valeur Liquidative Garantie.

**ORIENTATION DES PLACEMENTS :**

Le FCP gère, dans le respect des ratios prévus par la réglementation, des instruments financiers français ou des pays de l'OCDE : actions et autres titres de capital, obligations et autres titres de créance ainsi que leurs produits dérivés.

Dans les limites prévues par la réglementation, le FCP pourra intervenir sur des instruments financiers à terme fermes ou conditionnels négociés sur des marchés réglementés (français ou étrangers) ou de gré à gré. Dans ce cadre, le FCP pourra prendre des positions en vue de couvrir son portefeuille et/ou de l'exposer à des secteurs d'activités, zones géographiques, taux, indices, actions, titres ou valeurs mobilières assimilées pour bénéficier de la garantie ou protection définie ci-dessus. Ces opérations seront effectuées dans la limite de l'engagement maximum d'une fois l'actif du FCP. Dans ce cadre, le FCP pourra également prendre des positions en vue de couvrir son portefeuille au risque de devises.

Le FCP se réserve la possibilité d'effectuer des opérations de pensions, prêts et emprunts de titres.

**AVERTISSEMENT**

L'attention des souscripteurs est attirée sur les points suivants:

(i) une action du Panier (l' "Action") pourra être remplacée, par la société de gestion, par une autre action si l'un des événements suivants affectait l'Action:

- offre publique d'achat ou offre publique d'échange sur l'Action;
- fusion ou absorption de l'émetteur de l'Action avec ou par un tiers;
- fusion ou absorption de l'émetteur de l'Action avec ou par l'émetteur d'une autre action comprise dans le Panier;
- scission de l'émetteur de l'Action donnant lieu à la création d'actions nouvelles;
- prise de participation supérieure à 20 % dans le capital de l'émetteur de l'Action par l'émetteur d'une autre action du Panier;
- interruption définitive de la cotation de l'Action sur la bourse considérée (autre que dans le cas de liquidation défini ci-dessous), changement de compartiment de la cotation ou transfert de la cotation de l'Action sur une autre bourse (sauf si le mode de publication de son cours résultant du changement ou du transfert est reconnu comme étant satisfaisant par l'autorité de tutelle du FCP);
- nationalisation de l'émetteur de l'Action;
- tout autre événement de même nature pouvant entraîner des effets similaires, si l'un de ces événements survient à ou avant le 24 juin 2009.

(ii) une Action ne pourra être remplacée, par la société de gestion, que par :

- une action cotée en bourse à laquelle a droit le titulaire d'une Action en conséquence de la survenance d'un des événements ci-dessus, ou
- une action qui (a) ne fait pas partie du Panier, et (b) appartient au même secteur d'activité économique que l'Action qui est remplacée, ou dont l'émetteur a une qualité de crédit équivalente à celle de l'émetteur de l'Action qui est remplacée, et (c) fait l'objet d'un marché large et liquide et dont le mode de publication du cours est reconnu comme étant satisfaisant par l'autorité de tutelle du FCP.

(iii) la liquidation de l'émetteur de l'Action donnera lieu à la prise en compte d'une valeur de marché de l'Action qui pourra entraîner une évolution négative de ladite Action.

(iv) les porteurs de parts du FCP seront informés du remplacement d'une Action par une autre action selon les modalités suivantes :

- affichage au siège social de la société de gestion; et
- information particulière par la société de gestion ou la personne assurant la commercialisation des parts du FCP.

DUREE MINIMALE DE

PLACEMENT RECOMMANDEE: 8 ans.

SOUSCRIPTEURS :

Offert au public (personnes physiques et personnes morales).

DOMINANTE FISCALE

Le FCP peut servir de support de contrat en assurance-vie

AFFECTATION DES  
RÉSULTATS:

FCP de capitalisation. Comptabilisation selon la méthode des coupons encaissés.

## MODALITES DE FONCTIONNEMENT

---

DATE DE CLÔTURE DE L'EXERCICE :	Dernier jour de calcul de la valeur liquidative du mois d'avril. Première clôture : 30 avril 2002.
VALEUR LIQUIDATIVE D'ORIGINE :	100 EUR (soit la contrevaletur de 655,96 FRF)
PÉRIODICITÉ DE CALCUL DE LA VALEUR LIQUIDATIVE:	Quotidienne à l'exception des jours fériés au sens du Code du travail français ainsi que du calendrier de fermeture de la Bourse de Paris.
CONDITIONS DE SOUSCRIPTIONS ET DE RACHATS:	Les souscriptions et les rachats sont centralisés, à 13h00 (heure de Paris) le jour de calcul de la valeur liquidative par Département des Titres et de la Bourse de la Société Générale et réalisés sur la valeur liquidative de ce jour.
COMMISSION DE SOUSCRIPTION :	- Jusqu'au 27 juin 2001 (inclus) : 4,50% maximum de la valeur liquidative rétrocédable aux tiers. - A compter du 28 juin 2001 : 4,50% maximum de la valeur liquidative rétrocédable aux tiers, dont 2% maximum acquis à Lyxor International Asset Management.
COMMISSION DE RACHAT :	2% maximum de la valeur liquidative dont 1% maximum acquis à la société de gestion.
FRAIS DE GESTION MAXIMUM :	1,50% T.T.C. par an de l'actif net imputé sur le compte de résultats du fonds.
LIBELLÉ DE LA DEVISE DE COMPTABILITÉ :	EUR

**Adresse de la Société de Gestion**  
LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT  
17, cours Valmy - 92800 PUTEAUX  
www.lyxor.fr

**Adresse du dépositaire**  
SOCIETE GENERALE  
50, boulevard Haussmann - 75009 PARIS  
**Adresse des Etablissements désignés pour recevoir  
les souscriptions et les rachats**

SOCIETE GENERALE  
29, boulevard Haussmann - 75009 Paris

Lieu ou mode de publication de la valeur liquidative : LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT, et les guichets des Etablissements domiciles des souscriptions et des rachats.

La présente notice doit obligatoirement être proposée aux souscripteurs préalablement à la souscription, remise à la souscription et mise à la disposition du public sur simple demande.

La note d'information complète de l'OPCVM et le dernier document périodique sont disponibles auprès de la Société de Gestion.

Date d'agrément de l'OPCVM : 12 avril 2001  
Date d'agrément de la transformation de l'OPCVM : 7 novembre 2003  
Date d'édition de la notice d'information : 24 août 2004.