

# 領先日本 ETF\*

(\*此基金為一隻合成立交易所買賣基金) (2814.HK)

EXCHANGE TRADED FUNDS BY

LYXOR

SOCIETE GENERALE GROUP

股票國家及地區

二零一一年十一月

## 重要事項：投資涉及風險。投資者投資領先ETF可能會損失所有相關投資。投資者務須留意：

- 各領先ETF均按法國法律註冊成為 *fonds commun de placement* (互惠投資基金)，主要受法國金融監管機構 AMF 規管，以合約及非法團互惠基金的形式組成。與根據香港法例組成的單位信託的單位持有人比較，持有人可能只享有有限權利，詳情載於本章程「證監會批准的豁免」一節。
- 各領先 ETF 的投資目標是提供緊貼有關相關指數表現的投資業績，按有關相關指數成分股可分派的潛在股息增加（如適用）及扣除任何適用稅項後計算。
- 有關相關指數所代表的若干市場，尤其是發展中市場，較其他市場涉及更大風險，有關該等市場涉及更大風險之原因將於本章程第 2 部分的相關章節內詳述。
- 任何領先 ETF 的價值可能會反覆波動，且可能會在短時間內大幅下挫。投資者可能會損失部分或全部投資有關領先 ETF 的金額。
- 各領先 ETF 不一定投資於組成有關相關指數的股份或期貨，反而會採取「合成複製」投資策略（據此，基金經理已代表各領先 ETF 與根據法國法律註冊成立的持牌銀行 Société Générale 訂立指數掉期協議，其為一項場外議價金融衍生工具，惟對手方風險不得超過有關領先 ETF 資產淨值的 10%（就有關指數掉期協議的市價計值價值），以及投資於上市股份組合（可能不包括組成有關相關指數的股份或期貨）。因此，各領先 ETF 將承受有關 Société Générale 可能無力履行承諾的對手方風險。有關風險不得超過領先 ETF 資產淨值的 10%，並且不可出現被動性違反該限額。
- 倘 Société Générale 作為有關指數掉期協議下各領先 ETF 的對手方無力償債或 Société Générale 在有關指數掉期協議下發生任何有關失責事件，可能會導致有關領先 ETF 的單位暫停買賣，有關領先 ETF 甚至會因而終止或蒙受重大損失，此取決於 Société Générale 在有關指數掉期協議下無力償債及／或（視情況而定）發生有關失責事件時，有關領先 ETF 持有的上市股份組合的市值而定。
- 由於基金經理、託管人、指數掉期協議的對手方、莊家、參與交易商及香港代表全屬法國興業集團旗下，故可能會有利益衝突。
- 領先 ETF 的單位在聯交所進行交易，其在聯交所的價格乃按第二市場交易因素而定，可能會大幅偏離其資產淨值。
- 有意投資者應採取措施確保其完全理解交易及就交易的適合性按其本身目標和情況（包括訂立該交易涉及的潛在風險與利益）已作出獨立評估。有意投資者亦應考慮就作出上述評估時，尋求獨立專業建議。

# 領先日本 ETF\*

(\*此基金為一隻合成立交易所買賣基金) (2814.HK)

股票國家及地區

二零一一年十一月

EXCHANGE TRADED FUNDS BY

**LYXOR**

SOCIETE GENERALE GROUP

## 交易所買賣基金

### 領先日本ETF\*

領先日本ETF透過追蹤一項國際認可的指數，為投資者提供一個即時參與日本市場投資的獨特投資機會，當中包括1,662間日本的上市公司。

### 投資目標：

領先日本ETF旨在追蹤 TOPIX® Gross Total Return指數(「指數」)的表現，按該指數成分股可分派的潛在股息增加及扣除任何適用稅項後淨額計算(「基準指數」)。

### 領先資產管理：

2011年8月31日

Lyxor International Asset Management (「領先」)是領先資產管理的全資附屬公司，兩者均是法國興業集團的附屬公司，並屬於法國興業集團的企業及投資銀行業務部旗下，現時管理公超過819億歐元的資產。專門從事三類業務：結構性另類投資、結構性基金、指數追蹤。

## ETF 資料

	TOPIX® Gross Total Return
法定形式	French Mutual Fund
成立日期	二零零五年十一月十日
港交所上市日期	二零零八年六月三日
貨幣	美元
報價貨幣	港幣
最低投資額	500 單位
管理費	0.50% 每年
股息	每年
資產淨值	0.95 美元
管理資產	17.33 百萬美元

資料來源：領先資產管理 截至2011年11月30日

## 編號

港交所	2814
ISIN	FR0010477430
路透社	2814.HK
彭博	2814 HK

## 指數

## 指數資料

資料來源：彭博及領先資產管理，截至2011年9月30日

ETF*	基準指數*
<b>每年表現 (年率)</b>	
2011	
6/6/2011前	-15.79%
6/6/2011後	-17.94%
2010	14.03%
2009	2.94%
2008	-26.13%

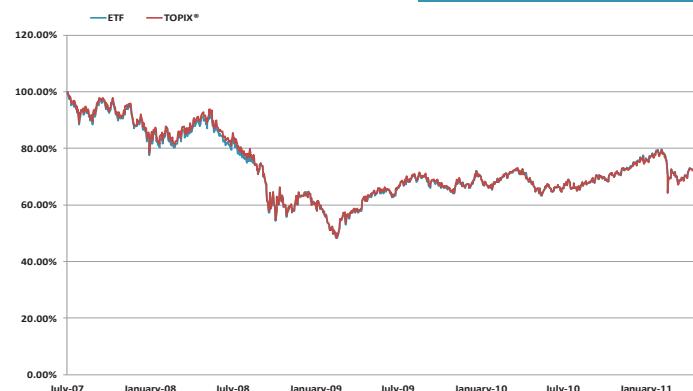
ETF*	基準指數*
<b>每月表現 (年率)</b>	
Jan-11	11.71%
Feb-11	77.80%
Mar-11	-66.54%
Apr-11	-3.88%
May-11	-13.68%
6/1 - 6/3	-88.10%

累計表現 (年率)	ETF*	基準指數**
1年	8.48%	9.27%
3年	-5.62%	-6.30%
自成立日	-8.30%	-8.34%

ETF*	基準指數**
6/6/30	92.22%
Jul-11	60.08%
Aug-11	-73.88%
Sep-11	14.32%
Oct-11	48.10%
Nov-11	-77.23%
Dec-11	-

\*\*基準指數：總回報指數

\* 基準指數：價格回報加股息(扣除稅項)。  
ETF表現：資產淨價值變化(美元)，包括股息。



\*\*\* 相關指數於2011年6月6日由TOPIX®轉為TOPIX® Gross Total Return；ETF表現亦於2011年6月6日重置為100%。  
上圖表述的ETF表現按資產淨價值變化(美元)計算。過往表現並非未來表現的可靠根據。

## 分佈

資料來源：彭博，截至2011年11月30日

### 指數主要持股

Toyota Motor Corp	汽車及零件	3.25%
Mitsubishi Ufj Financial Gro	銀行	2.47%
Canon Inc	科技	2.14%
Honda Motor Co Ltd	汽車及零件	2.03%
Nippon Telegraph & Telephone	電訊	1.73%
Sumitomo Mitsui Financial Gr	銀行	1.57%
Fanuc Corp	工業物品	1.29%
Mizuho Financial Group Inc	銀行	1.28%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	保健	1.24%
Softbank Corp	電訊	1.15%

### 10個主要行業

工業物品	20.07%
汽車及零件	10.57%
銀行	9.25%
個人及家庭用品	8.00%
科技	6.19%
保健	5.97%
化學	4.80%
電訊	4.78%
旅遊及休閒	4.68%
零售	4.64%

## 每月報告

網絡: [www.lyxoretf.com.hk](http://www.lyxoretf.com.hk)

電話: +852 2166 4266

電郵: [info@lyxoretf.com.hk](mailto:info@lyxoretf.com.hk)

# 領先日本 ETF\*

(\*此基金為一隻合成立交易所買賣基金) (2814.HK)

股票國家及地區

二零一一年十一月

EXCHANGE TRADED FUNDS BY

LYXOR

SOCIETE GENERALE GROUP

## 免責聲明:

本文件旨在提供有關領先領先日本ETF(「領先ETF」)的資料，並不構成任何對領先ETF的發售及沽出的邀請或要約。指數的表現並不代表領先ETF將來之表現及指數過往表現並不代表將來之表現。投資者需細閱載於領先ETF章程的投資目標及風險因素，包括對手方風險及領先ETF或可能取消上市地位的可能。掉期協議的對手方將由Société Générale擔任。

領先ETF章程可於[www.lyxoretf.com.hk](http://www.lyxoretf.com.hk)或[www.hkex.com.hk](http://www.hkex.com.hk)下載。

投資者注意，ETF與傳統互惠基金單位不同，只可以通過市場作價者作出大額增設/贖回單位數目贖回。領先ETF單位的交易會涉及經紀佣金。

## 指數免責聲明:

TOPIX®指數值及TOPIX®商標須受東京證券交易所擁有的知識產權所規限，而東京證券交易所擁有所有有關TOPIX®指數的權利（如計算、發佈及使用TOPIX®指數值）及有關TOPIX®商標的權利。東京證券交易所保留權利可改變計算或發佈的方法、終止計算或發佈TOPIX®指數值或改變TOPIX®商標或終止有關使用。東京證券交易所就使用TOPIX®指數值及TOPIX®商標所產生的業績，或TOPIX®指數值於任何特定日子的數字概不發表任何保證或聲明。

東京證券交易所亦不保證TOPIX®指數值或當中所載任何數據的準確性或詳盡性。此外，東京證券交易所對TOPIX®指數值計算錯誤、不實發佈、發佈延誤或中斷概不承擔任何責任。領先日本ETF並非由東京證券交易所保薦、認可或推介。東京證券交易所並無義務須向任何領先日本ETF的買家或公眾人士解釋領先日本ETF或提供投資意見。東京證券交易所於計算TOPIX®指數值時，並無挑選特定股票或組別，亦無考慮發行公司或任何領先日本ETF買家的任何需要。包括但可限於上述各項，東京證券交易所將不會就因發行及銷售領先日本ETF而導致的任何損害負責。

本文件並未為香港證監會所審核。基金經理為領先資產管理。本文件的發佈人為法國興業證券(香港)有限公司，其為領先資產管理的香港代表。