

Lyxor Japan (TOPIX) (DR) UCITS ETF - Dist JPY

1. INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

Objetivo de inversión

El Lyxor Japan (TOPIX) (DR) UCITS ETF - Dist JPY es un fondo cotizado (ETF) que cumple con la normativa UCITS, cuyo objetivo consiste en replicar el índice de referencia Topix Total Return Index JPY. El Topix Total Return Index JPY es un índice ponderado en función de la capitalización bursátil ajustada por el capital flotante calculado considerando todas las acciones ordinarias domésticas cotizadas en la TSE Primera Sección. Los ETF de Lyxor constituyen vehículos de inversión eficaces que cotizan en mercados bursátiles y ofrecen una exposición de bajo coste, líquida y transparente al índice de referencia subyacente.

Información sobre las operaciones

| Bolsa de valores          | Horario (GMT) | Divisa | Ticker Bloomberg | RIC Reuters | Distribución | Fx Hedge |
|---------------------------|---------------|--------|------------------|-------------|--------------|----------|
| SIX Swiss Exchange*       | 08:00 / 16:20 | JPY    | LYJPN SW         | LYJPN.S     | Sí           | No       |
| NYSE Euronext Paris**     | 08:00 / 16:30 | EUR    | JPNH FP          | JPNH.PA     | Sí           | Sí       |
| Borsa Italiana (Milano)** | 08:00 / 16:30 | EUR    | JPNH IM          | JPNH.MI     | Sí           | Sí       |
| Deutsche Boerse (Xetra)** | 08:00 / 19:00 | EUR    | JPNH GY          | JPNH.DE     | Sí           | Sí       |
| SIX Swiss Exchange**      | 08:00 / 16:20 | EUR    | JPNH SW          | JPNH.S      | Sí           | Sí       |
| NYSE Euronext Paris**     | 08:00 / 16:30 | EUR    | JPN FP           | JPN.PA      | Sí           | No       |
| Borsa Italiana (Milano)** | 08:00 / 16:30 | EUR    | JPN IM           | JPN.MI      | Sí           | No       |
| Deutsche Boerse (Xetra)** | 08:00 / 19:00 | EUR    | LYXJPN GY        | LYXJPN.DE   | Sí           | No       |
| Bolsa de Madrid**         | 08:00 / 16:30 | EUR    | JPN SM           | JPN.MC      | Sí           | No       |
| LSE**                     | 08:00 / 16:30 | GBP    | JPNL LN          | JPNL.L      | Sí           | No       |
| LSE**                     | 08:00 / 16:30 | USD    | JPNL LN          | JPNL.L      | Sí           | No       |
| SIX Swiss Exchange**      | 08:00 / 16:20 | CHF    | JPNC SW          | JPNC.S      | Sí           | No       |

\* Primer lugar de cotización de esta clase de participaciones    \*\* Cotización de las demás clases de participaciones

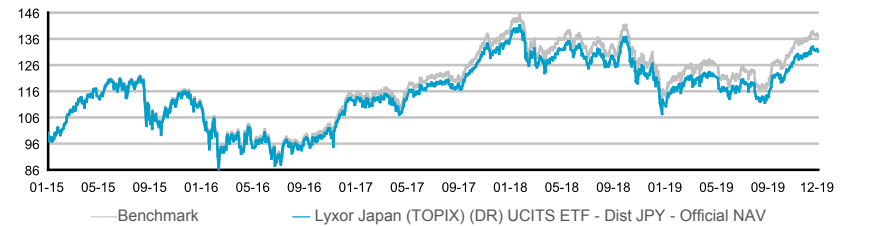
Ticker: LYJPN SW

Características principales del Fondo

|                                        |                   |
|----------------------------------------|-------------------|
| Ticker                                 | LYJPN SW          |
| Forma jurídica                         | SICAV             |
| Domiciliación                          | Francia           |
| UCITS                                  | Sí                |
| ISIN                                   | FR0010377028      |
| UKFRS                                  | Sí                |
| Método de replicación                  | Directa (Física)  |
| Muestreo                               | No                |
| Préstamos de valores                   | No                |
| Divisa de la clase                     | JPY               |
| Fecha de inicio                        | 11/12/2006        |
| Valor liquidativo al inicio (JPY)      | 16279,19          |
| Ratio total de gasto (TER)             | 0,45%             |
| Riesgo de cambio                       | No                |
| Valor Liquidativo (NAV) (JPY)          | 16356,58          |
| Activos bajo gestión por clase (M JPY) | 11.837,13         |
| Activos bajo gestión (M JPY)           | 122.917,27        |
| Fondo Umbrella (M JPY)                 | 2.994.329,32      |
| Mínimo de negociación                  | 1                 |
| Condición                              | Distribución      |
| Fecha de si la distribución            | Julio y diciembre |
| Última Monto (JPY)                     | 128,00            |
| Fuente: Lyxor AM, 30 diciembre 2019    |                   |

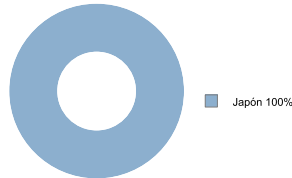
2. Información sobre el índice

Fuente: Bloomberg, Lyxor AM, hasta 30 diciembre 2019

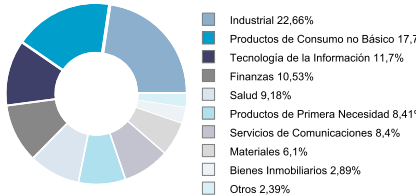


|                             |                              |
|-----------------------------|------------------------------|
| Nombre                      | Topix Total Return Index JPY |
| Exposición                  | Asia Pacific                 |
| Clase de activos            | Renta variable               |
| Tipo de índice              | Rentabilidad bruta           |
| Divisa                      | JPY                          |
| Reuters RIC del índice      | .TOPXDV                      |
| Ticker Bloomberg del índice | TPXDDVD                      |
| Más información             | www.tse.or.jp/english        |

Composición del Índice por Países



Composición sectorial del Índice



Diez principales compañías

|                                |       |
|--------------------------------|-------|
| Toyota Motor Corp              | 3,53% |
| Sony Corp                      | 1,93% |
| Mitsubishi Ufj Financial Group | 1,66% |
| Softbank Corp                  | 1,52% |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd   | 1,48% |
| Nippon Telegraph & Telephone   | 1,47% |
| Keyence Corp                   | 1,43% |
| Recruit Holdings Co Ltd        | 1,16% |
| Sumitomo Mitsui Financial Gr   | 1,13% |
| Nintendo Co Ltd                | 1,10% |

3. Rentabilidad del ETF

|                                               | 1 mes  | 3 meses | 6 meses | 3 años | 5 años |
|-----------------------------------------------|--------|---------|---------|--------|--------|
| Lyxor Japan (TOPIX) (DR) UCITS ETF - Dist JPY | 1,39%  | 8,43%   | 11,79%  | 18,20% | 30,52% |
| Benchmark                                     | 1,45%  | 8,59%   | 12,27%  | 21,31% | 36,37% |
| Brecha de rendimiento                         | -0,06% | -0,16%  | -0,48%  | -3,11% | -5,85% |
|                                               | YTD    | 2018    | 2017    | 2016   | 2015   |
| Lyxor Japan (TOPIX) (DR) UCITS ETF - Dist JPY | 17,04% | -16,57% | 21,05%  | -0,72% | 11,23% |
| Benchmark                                     | 18,12% | -15,97% | 22,23%  | 0,31%  | 12,06% |
| Brecha de rendimiento                         | -1,08% | -0,59%  | -1,18%  | -1,04% | -0,83% |
| Tracking Error                                | -      | 0,17%   | 0,32%   | 0,56%  | 0,02%  |

Fuente: Bloomberg, Lyxor AM, hasta 30 diciembre 2019  
Las cifras de [rentabilidad histórica / rentabilidad histórica simulada / rentabilidad histórica y rentabilidad histórica simulada] hacen referencia o están asociadas a periodos pasados y no constituyen un indicador fiable de los resultados futuros. Esto también se aplica a los datos de mercado históricos.

La rentabilidad de los ETF que distribuyen dividendos se calcula teniendo en cuenta la reinversión de estos dividendos  
La diferencia de rentabilidad representa las diferencias de rentabilidad entre la rentabilidad del ETF y la del índice  
El Tracking Error representa la volatilidad anualizada de las diferencias de rentabilidad entre el ETF y el índice de referencia

El índice de referencia puede registrar cambios. Para comparar la evolución del ETF con su índice de referencia, utilizaremos los índices que se indican a continuación:

|                                              | Desde      | Hasta      |
|----------------------------------------------|------------|------------|
| Tokyo Stock Exchange Tokyo Price Index TOPIX | 10/11/2005 | 06/06/2011 |
| Topix Total Return Index JPY                 | 06/06/2011 |            |

|                           | 1Y     | 3Y     | 5Y     |
|---------------------------|--------|--------|--------|
| Volatilidad del fondo     | 12,25% | 13,14% | 17,79% |
| Volatilidad de referencia | 12,27% | 13,15% | 17,78% |
| Ratio Sharpe              | 1,41   | 0,44   | 0,31   |

## Factores de Riesgo

Es importante que los inversores evalúen los riesgos descritos a continuación así como en el folleto del fondo ([www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com)).

**CAPITAL EN RIESGO:** los ETF son instrumentos de réplica: su perfil de riesgo es similar al de una inversión directa en el Índice subyacente. Todo el capital de los inversores está en riesgo y cabe la posibilidad de que los inversores no recuperen el importe invertido originalmente.

**RIESGO DE REPLICACIÓN:** es posible que no se alcancen los objetivos del fondo a causa de acontecimientos inesperados de los mercados subyacentes que repercutirán en el cálculo del índice y en la replicación eficiente por parte del fondo.

**RIESGO SUBYACENTE:** El Índice subyacente de un ETF de Lyxor puede ser complejo y volátil. Al invertir en materias primas, el Índice subyacente se calcula haciendo referencia a los contratos de futuros sobre materias primas, lo que expone al inversor a un riesgo de liquidez vinculado a los costes, como el coste de transporte. Los ETF expuestos a los Mercados emergentes conllevan un riesgo de pérdida potencial superior a las inversiones en Mercados desarrollados, puesto que están expuestos a un amplio abanico de riesgos impredecibles de los Mercados emergentes.

**RIESGO DE CAMBIO:** los ETF pueden estar expuestos al riesgo de cambio si el ETF está denominado en una divisa diferente de la del Índice subyacente al que replica. Esto significa que las fluctuaciones del tipo de cambio pueden tener una repercusión positiva o negativa en la rentabilidad.

**RIESGO DE LIQUIDEZ:** la liquidez la proporcionan los creadores de mercado registrados del mercado bursátil correspondiente donde cotiza el ETF, entre los que se incluye Société Générale. La liquidez disponible en el mercado puede verse limitada como consecuencia de una suspensión en el mercado subyacente representado por el Índice subyacente que replica el ETF; una avería en los sistemas de uno de los mercados bursátiles correspondientes, los sistemas de Société Générale o de otro creador de mercado; o una situación o un acontecimiento de negociación anómalos.

## Aviso del Inversor