

BASFAKTA FÖR INVESTERARE

Mål

Detta faktablad innehåller viktig information om investeringsprodukten. Detta är inte reklamaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå vad den här produkten är och vilka risker, kostnader och eventuella vinster och förluster som är förknippade med den, samt att hjälpa dig att jämföra den med andra produkter.

Produkt

SG29 MAS Funds – LOIM Tail Risk – CLASS EB – USD (en delfond i investeringsbolaget SOLYS ("Företaget")) En

investeringsdelfond som följer den luxemburgska lagen

Société Générale Investment Solutions (Frankrike), SOCIÉTÉ GÉNÉRALE Group
LU3047433522

<https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>

För mer information kan du ringa +33 1 58 98 89 11.

CSSF, Luxemburgs finansmyndighet, ansvarar för att övervaka att Société Générale Investment Solutions (Frankrike) följer det som anges i detta faktablad.

Société Générale Investment Solutions (Frankrike) har godkänts för att bedriva verksamhet i Frankrike under licensnummer GP-06000029 och regleras av AMF, den franska finansmyndigheten. Datum för upprättande av dessa basfakta för investerare: 2026-01-31

Huvudegenskaper för den här produkten

Typ: Företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag)

Löptid: Denna delfond har inrättats för en löptid på 99 år.

Mål:

Investeringsmålet för SOLYS – SG29 MAS Funds – LOIM Tail Risk ("Delfonden") är att uppnå kapitaltillväxt på lång sikt, särskilt under perioder då det råder stressade förhållanden på marknaden genom att exponeras för svans- och ägandestrategier vars resultat är kopplade till ett brett investeringsområde i alla regioner (gemensamt "Strategierna").

Delfonden förvaltas aktivt och förvaltas inte i linje med något jämförelseindex.

Delfonden strävar efter att uppnå sitt investeringsmål genom att ge exponering mot en korg med olika enskilda kvantitativa investeringsstrategier som strävar efter dra nytta av störningar och stressade förhållanden på marknaden. Delfonden strävar efter att minska de traditionellt höga ägandekostnaderna för att försöka investera i svansstrategier genom att ha ett tillvägagångssätt för att identifiera optimal risk/belöning och försöka öka och minska exponeringen i förhållande till denna risk/belöning.

Delfonden strävar efter att utnyttja hävstångseffekter på långa och korta positioner för att generera konsekvent avkastning, oavsett makrotrender, men det är delfondens avsikt att prestera bättre under perioder av marknadsnedgång. Delfonden kommer att genomföra sin investeringsstrategi genom att välja (i) strategier som strävar efter att uppnå hög lönsamhet under perioder av marknadsstress ("svansstrategier") och (ii) strategier som syftar till att ta tillvara marknadens ineffektivitet på alla marknader ("ägandestrategier").

Delfonden strävar efter att hitta de bästa möjligheterna inom ett brett investeringsområde inom alla tillgångsklasser, däribland eget kapital, utländsk valuta, råvaror, räntebärande instrument, samt i alla regioner. Delfonden kommer huvudsakligen att exponeras för strategier som systematiskt tar exponering mot det ovan beskrivna investeringsområdet genom terminer och/eller optioner på aktieindex, utdelningsterminer, volatilitetsterminer, ränteswappar och swaptioner, statsobligationsterminer, värdepapper, valutaterminer eller finansiella index.

Delfonden kommer att uppnå sin exponering antingen genom att:

- investera direkt i börshandlade optioner eller OTC-optioner och/eller börshandlade finansiella terminer och/eller
- söka exponering mot vissa eller alla strategierna genom att (i) använda strukturerade produkter såsom EMTN (Euro Medium Term Note), och/eller (ii) OTC-derivat såsom ränteswapoptioner på amerikanska och europeiska räntekurvor och/eller totalavkastningsswappar (TRS) och/eller fullt finansierade eller ofinansierade swappar.

När delfonden exponeras mot en eller flera OTC-swaptransaktioner kan den dessutom investera i en korg med värdepapper med hög likviditet ("korgen med värdepapper") och:

- genomföra OTC-swaptransaktioner för att få exponering mot strategier utöver den för korgen av värdepapper och/eller
- utbyta, genom OTC-swaptransaktioner, värdet av en sådan korg av

värdepapper mot värdet för strategierna.

Korgen med värdepapper kan bestå av:

- med högst 110 procent av delfondens nettotillgångar, internationella stamaktier som ingår i ett större aktieindex och/eller
- med högst 110 procent av delfondens nettotillgångar, statsobligationer från OECD-länder med ett kreditbetyg på minst BBB- (Standard & Poors) (eller motsvarande kreditbetyg från ett annat ledande kreditvärderingsinstitut).

Aktievalutan är amerikanska dollar (USD).

Investerade finansiella instrument: Internationella värdepapper, statsobligationer från OECD-länder, OTC-derivat såsom totalavkastningsswappar (TRS), fullt finansierade eller ofinansierade swappar, EMTN (Euro Medium Term Note), terminer och/eller optioner på aktieindex, utdelningsterminer, volatilitetsterminer, ränteswappar och swaptioner, statsobligationsterminer, forwardkontrakt för valuta eller finansiella index (däribland råvaruindex genom användning av derivatinstrument).

Utdelningspolicy: Alla andelsklasser är kapitaliseringsandelar.

Substansvärde: Substansvärdet beräknas dagligen förutsatt att de relevanta börserna är öppna för handel och att orderna kan täckas. Se prospektet för de exakta arbetsdagarna då substansvärdet kommer att beräknas.

Teckning och inlösen: En arbetsdag före varje handelsdag (enligt definitionen i prospektet) senast kl. 12.00 luxemburgsk tid.

Berättigade investerare: Denna andelsklass är öppen för institutionella investerare i den betydelse som avses i artikel 174 2c) i luxemburgsk lag av den 17 december 2010 om investeringsbolag för kollektiva investeringar, som ibland kan ändras, förutom för U.S. Persons.

Rekommendation: Delfonden kanske inte är lämplig för investerare som planerar att lösa in sitt innehav inom ett år.

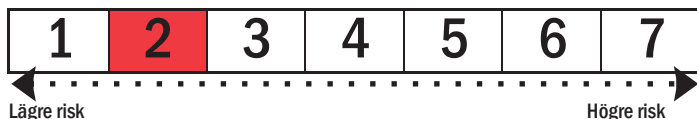
Fondförvaltare: Société Générale Luxembourg S.A.

Ytterligare information: Du kan få mer information om den här delfonden, däribland tillhörande prospekt och finansiella rapporter, kostnadsfritt på begäran direkt till Société Générale Investment Solutions (Frankrike), 29 boulevard Haussmann, 75009 Paris och på webbplatsen på: <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>

Information om delfondens substansvärde finns på: <https://www.fundsquare.net>

Vilka är riskerna och vad kan jag få ut av det?

Syntetisk riskindikator:



Denna riskindikator förutsätter att du behåller ditt innehav i minst ett år. Den faktiska risken kan vara helt annorlunda om du lämnar delfonden i förtid, vilket kan påverka avkastningen negativt. Riskindikatorn mäter produktens risknivå i förhållande till andra investeringsprodukter. Den anger sannolikheten för att denna produkt ska göra förluster i händelse av marknadsrörelser eller vår oförmåga att betala dig.

Vi har klassificerat denna produkt i en låg riskklass på 2 av 7. Det innebär att de potentiella förlusterna ligger på en låg nivå, och om situationen på marknaderna skulle förvärras är det möjligt att förvaltningsbolaget kanske inte kan lösa in din investering till fullo. Det kan påverka förvaltningsbolagets förmåga att betala dig.

Delfonden kan också exponeras för följande risker som inte omfattas av riskindikatorn:

Motpartsrisker: Detta innebär risken för att en motpart i en onoterad transaktion med delfonden kan vara oförmögen att uppfylla sina avtalsförpliktelser. **Kreditrisk:** Emittentens försämrade kreditbetyg.

Eftersom denna produkt inte ger något skydd mot marknadsrisker kan du förlora din investering, helt eller delvis.

Resultatscenarier

I siffrorna ingår alla kostnader för själva den finansiella produkten, men eventuellt inte alla kostnader som du betalar till din rådgivare eller distributör. I siffrorna tas heller ingen hänsyn till din personliga beskattningssituation, som också kan påverka hur mycket du får tillbaka.

Vad du får ut av denna produkt beror på framtida marknadsresultat. Marknadens framtida utveckling är slumpmässig och kan inte förutsägas exakt. De ogynnsamma, neutrala och gynnsamma scenarierna visar exempel som utgår ifrån de bästa, sämsta och genomsnittliga resultaten för det relevanta jämförelseindexet under de senaste tio åren.

Marknaderna kan utvecklas i en annan riktning i framtiden. Det stressade scenariot visar vad du kan få tillbaka under extrema marknadsförhållanden.

Rekommenderad investeringsperiod: 1 år

Investering: 10 000 US-dollar

Scenarier		Vid utträde efter: 1 år
Minimiavkastning	Det finns ingen garanterad minimiavkastning. Du kan förlora din investering, helt eller delvis.	
Stressat scenario	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	7 400 US-dollar
	Genomsn. avkastning	- 26,00 %
Negativt scenario	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	9 920 US-dollar
	Genomsn. avkastning	- 0,90 %
Neutralt scenario	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	10 300 US-dollar
	Genomsn. avkastning	3,00 %
Positivt scenario	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	18 520 US-dollar
	Genomsn. avkastning	85,20 %

Den här typen av negativt scenario inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan maj 2018 och maj 2019.

Den här typen av neutralt scenario inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan oktober 2020 och oktober 2021.

Den här typen av positivt scenario inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan december 2019 och december 2020.

Vad händer om delfondens sponsor inte kan betala ut?

Om förvaltningsbolaget som förvaltar delfondens tillgångar går i konkurs påverkar det inte din investering. Förvaringsinstitutet för delfonden ansvarar för att förvalta och förvara delfondens tillgångar.

Hur mycket kommer denna investering att kosta?

Vi kan eventuellt dela kostnaderna med den person som säljer produkten till dig för att täcka de tjänster de tillhandahåller. Personen i fråga informerar dig om beloppet.

KOSTNADER UNDER EN ETTÅRSPERIOD

Tabellerna visar de belopp som dras från din investering för att täcka olika typer av kostnader. Beloppens storlek beror på hur mycket du investerar och hur länge du behåller investeringen. Beloppen som visas är exempel baserade på hypotetiska investeringsbelopp och olika möjliga investeringsperioder.

Vi har antagit att:

- du under det första året skulle återfå det belopp du investerat (årlig avkastning om 0 %)
- produkten under de övriga innehavsperioderna utvecklas i enlighet med det neutrala scenariot.
- 10 000 US-dollar investeras.

Investering: 10 000 US-	Vid utträde efter: 1 år
Kostnader totalt	46 US-dollar
Kostnad i % (*)	0,46 %

(*) Visar hur kostnaderna minskar ditt resultat årligen under innehavsperioden. Du kan t.ex. se att om du begär utträde i slutet av den rekommenderade innehavsperioden beräknas det att din genomsnittliga avkastning per år blir 3,46 % innan kostnaderna har dragits och 3,00 % efter kostnadsavdraget.

KOSTNADSFÖRDELNING

Engångskostnader vid inträde	Effekten av årliga kostnader om du begär utträde efter bara ett år. Investering: 10 000 US-dollar	
Inträdeskostnad	0,00 % av investeringen. Detta är det högsta belopp du kan betala och du kan eventuellt betala mindre.	0 US-dollar
Utträdeskostnad	0,00 % av investeringen innan den betalas ut till dig. Detta är det högsta belopp du kan betala och du kan eventuellt betala mindre.	0 US-
Löpande kostnader som dras från delfonden varje år		
Förvaltningskostnader och övriga administrativa kostnader samt driftskostnader	0,46 % av värdet av din investering per år. Uppskattningen grundas på siffrorna från föregående räkenskapsår.	46 US-dollar
Transaktionskostnader	0,00 % av värdet av din investering per år. Detta är en uppskattning av kostnaderna för att vi köper och säljer underliggande investeringar för produkten. Det faktiska beloppet varierar beroende på hur mycket värdepapper vi köper och säljer.	0 US-dollar
Engångsavgifter som tas ut under vissa förhållanden		
Resultatrelaterade avgifter	Beloppet för den resultatrelaterade avgiften är en andel av resultatet för det relevanta aktieslaget under referensperioden som överstiger tröskelnivån under referensperioden (enligt definitionen i prospektet). Andelen för beräkningen av den resultatrelaterade avgiften är 20 %, som tillämpas på överskottsavkastningen mellan aktieklassens resultat och "tröskelnivån" (SOFR, Secured Overnight Financing Rate).	0 US-dollar

Hur länge ska jag behålla min investering och kan jag ta ut pengar i förtid?

REKOMMENDERAD INNEHAVSPERIOD: 1 ÅR

Delfonden kanske inte är lämplig för investerare som planerar att lösa in sitt innehav inom ett år. Avsikten med den rekommenderade innehavsperioden är att minska risken för kapitalförlust för din investering om du löser in den efter denna period. Det utgör emellertid ingen garanti. Du kan dock välja att lösa in din investering när som helst. Delfonden tar inte ut någon inlösenavgift.

Vem kan jag kontakta om jag har en fråga eller ett klagomål?

Du kan ställa alla frågor eller lämna in klagomål direkt till: Société Générale Investment Solutions (Frankrike), 29 boulevard Haussmann, 75009 Paris, Frankrike), eller via webbplatsen på <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr/fr/contact/>

Annan relevant information

Alla juridiska dokument (dvs. prospektet och de senaste års- och halvårsrapporterna) går att få kostnadsfritt på begäran från förvaltningsbolaget eller på tillhörande webbplats på <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>