

BASISINFORMATIONSBLETT

Ziele

Dieses Dokument stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Produkt

SG29 MAS FUNDS – LOIM Tail Risk - CLASS EB - USD (Ein Teilfonds der Investmentgesellschaft namens SOLYS (die „Gesellschaft“)) Ein Investment-Teilfonds nach luxemburgischem Recht

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

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

Für mehr Informationen rufen Sie uns unter +33 1 58 98 89 11 an.

Die luxemburgische Finanzaufsichtsbehörde CSSF ist für die Überwachung der Einhaltung dieses Basisinformationsblattes durch Société Générale Investment Solutions (France) zuständig.

Société Générale Investment Solutions (France) ist in Frankreich unter der Lizenznummer GP-06000029 zugelassen und wird von der französischen Finanzmarktbeförde AMF reguliert. Erstellungsdatum des Dokumentes: 16.09.2025

Wichtige Merkmale dieses Produkts

Art: Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW)

Laufzeit: Dieser Teilfonds wurde für eine Laufzeit von 99 Jahren aufgelegt.

Ziele:

Das Anlageziel von SOLYS – SG29 MAS FUNDS– LOIM Tail Risk (der „Teilfonds“) besteht darin, langfristig einen Kapitalzuwachs zu erzielen und vor allem in Zeiten von Marktstress. Dies geschieht durch das Engagement in Tail- und Carry-Strategien, deren Wertentwicklung an ein breites Anlageuniversum in allen Regionen gekoppelt ist (zusammen „die Strategien“).

Dieser Teilfonds wird aktiv gemanagt und orientiert sich nicht an einer Benchmark.

Der Teilfonds zielt darauf ab, das Anlageziel zu erreichen, indem er ein Engagement in einem Korb verschiedener einzelner quantitativer systematischer Strategien bietet, deren Schwerpunkt darauf liegt, von Marktverwerfungen und -stress zu profitieren. Der Teilfonds zielt darauf ab, die normalerweise hohen Kosten für die Umsetzung von Tail-Strategien zu minimieren, indem er einen Ansatz verfolgt, der ein optimales Risiko-Ertrags-Verhältnis ermittelt und die Engagements in Abhängigkeit von diesem Risiko-Ertrags-Verhältnis erhöht oder verringert.

Der Teilfonds strebt an, durch gehebelte Long- und Short-Positionen unabhängig von makroökonomischen Trends konstante Renditen zu generieren, wobei der Teilfonds darauf abzielt, in Zeiten rückläufiger Märkte eine überdurchschnittliche Performance zu erzielen. Der Teilfonds setzt seine Anlagestrategie um, indem er (i) Strategien auswählt, die darauf abzielen, in Zeiten von Marktstress Gewinne zu erzielen („Tail-Strategien“) und (ii) Strategien, die darauf abzielen, Markteffizienzen auf allen Märkten zu nutzen („Carry-Strategien“).

Der Teilfonds versucht, die besten Gelegenheiten innerhalb eines breiten Anlageuniversums über alle Anlageklassen hinweg zu finden, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Aktien, Devisen, Rohstoffe, festverzinsliche Wertpapiere sowie über alle Regionen hinweg. Der Teilfonds wird hauptsächlich in Strategien investiert sein, die systematisch über Futures und/oder Optionen auf Aktienindizes, Dividenden-Futures, Volatilitäts-Futures, Zinsswaps und Swaptions, Staatsanleihen-Futures, Aktien, Devisentermingeschäfte oder Finanzindizes ein Engagement im oben beschriebenen Anlageuniversum eingehen.

Der Teilfonds erreicht sein Engagement entweder durch:

- Investitionen direkt in Aktien, börsennotierte oder OTC-Optionen und/oder börsennotierte Finanzterminkontrakte und/oder
- durch Engagements teilweise in Strategien oder in allen Strategien durch (i) den Einsatz strukturierter Wertpapiere wie EMTN (Euro Medium Term Note) und/oder (ii) OTC-Derivaten wie Swaptions auf US- und EU-Zinskurven und/oder Zinsswaps auf US- und EU-Zinskurven und/oder Devisentermingeschäften und/oder Total Return Swaps (TRS) und/oder vollständig finanzierten oder nicht finanzierten Swaps.

Darüber hinaus kann der Teilfonds, wenn er über eine oder mehrere OTC-Swap-Transaktionen ein Engagement eingeht, in einen Korb von hochliquiden Wertpapieren (der „Wertpapierkorb“) investieren und:

- OTC-Swap-Transaktionen abschließen, um sich zusätzlich zu den Strategien des Wertpapierkorbs zu engagieren und/oder,
- durch OTC-Swap-Transaktionen den Wert eines solchen Wertpapierkorbs gegen den Wert der Strategien tauschen.

Der Wertpapierkorb kann sich zusammensetzen aus:

- bis zu 110% des Nettovermögens des Teilfonds aus internationalen Aktien, die in einem wichtigen Aktienindex enthalten sind und/oder
- bis zu 110% des Nettovermögens des Teilfonds, OECD-Staatsanleihen mit einem

Mindestrating von BBB- (Standard and Poor's) (oder einem entsprechenden Rating einer anderen führenden Ratingagentur).

Die Anteilswährung ist Dollar (USD).

Finanzinstrumente, in die investiert wird: Internationale Aktien, OECD-Staatsanleihen, OTC-Derivate wie Total Return Swaps (TRS), voll finanzierte oder nicht finanzierte Swaps, EMTN (Euro Medium Term Note), Futures und/oder Optionen auf Aktienindizes, Dividenden-Futures, Volatilitäts-Futures, Zinsswaps und Swaptions, Staatsanleihen-Futures, Devisentermingeschäfte oder Finanzindizes (einschließlich Rohstoffindizes durch den Einsatz von Finanzderivaten).

Ausschüttungspolitik: Alle Anteilsklassen sind thesaurierend.

Nettoinventarwert: Wird täglich berechnet, sofern die betreffenden Börsenplätze für den Handel geöffnet sind und Aufträge abgewickelt werden können. Die genauen Werktage, wann der Nettoinventarwert berechnet wird, entnehmen Sie bitte dem Prospekt.

Zeichnungen und Rücknahmen: Ein Werktag vor einem Handelstag (wie im Prospekt festgelegt) bis spätestens 12.00 Uhr Luxemburger Zeit.

Zielgruppe: Diese Anteilsklasse steht institutionellen Anlegern gemäß Artikel 174 2c) des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in der jeweils gültigen Fassung und mit Ausnahme von US-Personen zur Verfügung.

Empfehlung: Dieser Teilfonds ist möglicherweise nicht für Anleger geeignet, die Ihr Geld innerhalb von weniger als fünf Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen.

Verwahrstelle: Société Générale Luxembourg S.A.

Zusätzliche Informationen: Weitere Informationen zu diesem Teilfonds einschließlich Prospekt und Jahresabschluss erhalten Sie auf Anfrage kostenlos direkt bei Société Générale Investment Solutions (France), 29 boulevard Haussmann, 75009 Paris und auf der Website unter: <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>

Der Nettoinventarwert des Teilfonds ist unter: <https://www.fundsquare.net> verfügbar.

Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

Synthetischer Risikoindikator:

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Niedrigeres Risiko



Höheres Risiko

Dieser Risikoindikator geht davon aus, dass Sie mindestens 5 Jahre investiert bleiben. Das tatsächliche Risiko kann ganz anders sein, wenn Sie den Teilfonds vorzeitig verlassen, was sich nachteilig auf Ihre Rendite auswirken kann. Dieser Risikoindikator misst das Risikoniveau des Produktes im Vergleich zu anderen Anlageprodukten. Er spiegelt die Wahrscheinlichkeit wider, dass ungünstige Marktbewegungen dazu führen, dass das Finanzprodukt Verluste verzeichnet oder dass wir nicht in der Lage sind, Sie auszuzahlen.

Wir haben dieses Produkt mit einer mittleren Risikoklasse von 4 von 7 eingestuft. Das bedeutet, dass es ein mittleres Verlustpotenzial hat und dass die Verwaltungsgesellschaft möglicherweise nicht in der Lage ist, Ihre Investition vollständig zurückzuzahlen, wenn sich die Marktbedingungen verschlechtern. Dies kann sich auf die Fähigkeit der Verwaltungsgesellschaft auswirken, Sie auszuzahlen.

Der Teilfonds kann auch den folgenden Risiken ausgesetzt sein, die nicht im Risikoindikator berücksichtigt werden.

Kontrahentenrisiko: Es handelt sich um das Risiko, dass eine Gegenpartei eines außerbörslichen Geschäfts mit dem Teilfonds nicht in der Lage ist, ihren vertraglichen Verpflichtungen nachzukommen.

Ausfallrisiko: Verschlechterung der Bonität des Emittenten.

Da dieses Produkt keinen Schutz gegen Marktschwankungen bietet, können Sie Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren.

Performance-Szenarien

In den nachstehenden Zahlen sind alle Kosten berücksichtigt, die mit dem Finanzprodukt verbunden sind, aber nicht notwendigerweise alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Vertriebspartner zahlen müssen. Die Zahlen berücksichtigen auch nicht Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf die Beträge auswirken kann, die Sie erhalten.

Ihre Rendite aus diesem Teilfonds hängt von der zukünftigen Wertentwicklung der Finanzmärkte ab. Zukünftige Marktbewegungen sind zufällig und können nicht genau vorhergesagt werden. Die ungünstigen, mittleren und günstigen Szenarien, die wir unten zeigen, sind Beispiele, die auf den schlechtesten, mittleren und besten Renditen des Teilfonds bzw. auf der durchschnittlichen Performance des entsprechenden Referenzindex in den letzten 10 Jahre beruhen.

Die Märkte können sich in der Zukunft ganz anders entwickeln. Das Stressszenario zeigt Ihre hypothetischen Renditen unter extremen Marktbedingungen.

Empfohlene Haltedauer: Investition 5 Jahre: USD
10.000

Szenarien		Wenn Sie aussteigen nach:	
		1 Jahr	5 Jahren
Mindestrendite Es wird keine Mindestrendite garantiert. Sie könnten Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren.			
Stressszenario	Ihre hypothetische Rendite nach Abzug der Kosten	USD 750	USD 950
	Durchschnittliche jährliche Rendite	-92,50%	-37,60%
Ungünstiges Szenario	Ihre hypothetische Rendite nach Abzug der Kosten	USD 9 900	USD 10 730
	Durchschnittliche jährliche Rendite	-1,00%	1,40%
Mittleres Szenario	Ihre hypothetische Rendite nach Abzug der Kosten	USD 10 340	USD 21 640
	Durchschnittliche jährliche Rendite	3,40%	16,70%
Mittleres Szenario	Ihre hypothetische Rendite nach Abzug der Kosten	USD 20 090	USD 25 990
	Durchschnittliche jährliche Rendite	100,90%	21,10%

Das ungünstige Szenario trat bei einer Investition in den Referenzwert zwischen Mai 2014 und Mai 2019 ein. Das mittlere Szenario trat bei einer Investition in den Referenzwert zwischen April 2016 und April 2021 ein. Das günstige Szenario trat bei einer Investition in den Referenzwert zwischen März 2019 und März 2024 ein.

Was passiert, wenn der Sponsor des Teilfonds nicht in der Lage ist, meine Anteile zurückzunehmen?

Wenn die Verwaltungsgesellschaft, die die Vermögenswerte Ihres Teilfonds verwaltet, zahlungsunfähig ist, hat das keine Auswirkungen auf Ihre Investition. Die Verwahrstelle des Teilfonds ist für die Verwahrung und sichere Aufbewahrung der Vermögenswerte Ihres Teilfonds verantwortlich.

Wie viel kostet mich diese Investition?

Wir können die Kosten mit der Person teilen, die Ihnen das Produkt verkauft, um die von ihr für Sie erbrachten Dienstleistungen zu decken. Diese Person wird Sie über den Betrag informieren.

KOSTEN ÜBER EINEN ZEITRAUM VON 5 JAHREN

Die Tabelle unten zeigt die Beträge, die von Ihrer Investition abgezogen werden, um verschiedene Kosten zu decken. Diese Beträge hängen davon ab, wie hoch der Betrag ist, den Sie investiert haben und wie lange Sie Ihre Investition halten. Die hier genannten Beträge sind Beispiele, die auf hypothetischen Anlagebeträgen und verschiedenen möglichen Anlagezeiträumen basieren.

Wir nehmen Folgendes an:

- Im ersten Jahr erhalten Sie den ursprünglich investierten Betrag zurück (0% jährliche Rendite);
- für die anderen Haltedauern wird sich das Produkt entwickeln, wie im mittleren Szenario angenommen,
- Es werden USD 10.000 investiert.

Investition: USD 10.000	Wenn Sie aussteigen nach:	
	1 Jahr	5 Jahren
Gesamtkosten	USD 45	USD 491
Jährliche Kosten in % (*)	0,45%	0,53% pro Jahr

(*) Diese Angaben zeigen, wie die Kosten Ihre jährliche Rendite während der Haltedauer verringern. So zeigt sich beispielsweise, dass bei einem Ausstieg am Ende der empfohlenen Haltedauer eine durchschnittliche Rendite von 17,23% pro Jahr vor Abzug der Kosten und 16,70% nach Abzug der Kosten zu erwarten ist.

ZUSAMMENSETZUNG DER KOSTEN

Einmalige Kosten bei Einstieg		Die Auswirkungen der jährlichen Kosten, wenn Sie bereits nach einem Jahr aussteigen. Investition: USD
Einstiegskosten	0,00% Ihrer Investition. Dies ist der Höchstbetrag den Sie zahlen werden, vielleicht werden Sie weniger zahlen.	USD 0
Ausstiegskosten	0,00% Ihrer Investition, bevor diese an Sie ausgezahlt wird. Dies ist der Höchstbetrag den Sie zahlen werden, vielleicht werden Sie	USD 0
Jährlich aus dem Teilfonds entnommene Gebühren		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- und Betriebskosten	0,45% des Wertes Ihrer Investition pro Jahr. Dies ist eine Schätzung.	USD 45
Transaktionskosten	0,00% des Wertes Ihrer Investition pro Jahr. Dies ist eine Schätzung der Kosten, die uns beim Kauf und Verkauf der dem Produkt zugrunde liegenden Investitionen entstehen. Der tatsächliche Betrag hängt von dem Volumen der von uns gekauften oder verkauften Wertpapiere ab.	USD 0
Nebenkosten, die dem Teilfonds unter bestimmten Bedingungen entnommen werden		
Leistungsabhängige Vergütungen	Die Performancegebühr entspricht einem Prozentsatz der Performance der jeweiligen Anteilsklasse im Referenzzeitraum, der die Hurdle Rate im Referenzzeitraum übersteigt. Der Prozentsatz für die Berechnung der Performancegebühr beträgt 20% und wird auf die Überschussrendite zwischen der Performance der Anteilsklasse und der „Hurdle Rate“ (SOFR) angewandt.	0 €

Wie lang muss ich meine Investition halten und kann ich mein Geld vorzeitig zurückbekommen?

EMPFOHLENER ANLAGEZEITRAUM: 5 JAHRE

Dieser Teilfonds ist möglicherweise nicht für Anleger geeignet, die Ihr Geld innerhalb von weniger als fünf Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen. Die empfohlene Haltedauer soll das Risiko eines Kapitalverlusts Ihrer Investition minimieren, wenn Sie Ihre Anteile nach diesem Zeitraum zurückgeben. Dies stellt jedoch keine Garantie dar. Sie können Ihre Anteile jedoch jederzeit zurückgeben. Der Teilfonds erhebt keine Rücknahmegebühr.

Wen kann ich bei Fragen oder Beschwerden kontaktieren?

Bei Fragen oder Beschwerden können Sie sich direkt an folgende Adresse wenden: Société Générale Investment Solutions (France), 29 boulevard Haussmann, 75009 Paris oder kontaktieren Sie uns über unsere Website unter <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr/fr/contact/>

Weitere wichtige Informationen

Alle Rechtsdokumente (zum Beispiel der Prospekt und die neuesten Jahres- und Halbjahresberichte) sind auf Anfrage kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft oder auf der Website unter <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr> verfügbar.