

NYCKELINFORMATIONSDOKUMENT

Syfte

Detta dokument ger väsentlig information om investeringsprodukten. Den är inte avsedd för marknadsföringsändamål. Denna information tillhandahålls enligt lag och har som syfte att ge en förståelse för produktens karaktär, risker och kostnader, dess möjliga risker och avkastning samt att möjliggöra jämförelser med andra produkter.

Produkt

SG29 MAS FUNDS – LOIM Tail Risk - CLASS EB - USD (En delfond tillhörande investeringsbolaget SOLYS ("Bolaget")) En

investeringsdelfond som regleras av luxemburgsk lagstiftning

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

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

för mer information eller ring +33 1 58 98 89 11.

CSSF, den luxemburgska finansinspektionen, ansvarar för att säkerställa att Société Générale Investment Solutions (France) följer detta nyckelinformationsdokument.

Société Générale Investment Solutions (France) är auktoriserat att verka i Frankrike under tillstånd nr. GP-06000029 och står under tillsyn av AMF.

Datum för upprättande av detta dokument: 2025-09-16

Produktens huvudsakliga egenskaper

Typ: Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities (UCITS)

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

Målsättningar:

Investeringsmålet för SOLYS – SG29 MAS FUNDS – LOIM Tail Risk ("Delfonden") är att uppnå kapitaltillväxt på lång sikt, särskilt under perioder av marknadsstress, genom exponering mot tail- och carry-strategier vars avkastning är kopplad till ett brett investeringsområde över alla regioner (gemensamt benämnda "Strategierna")

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

Delfonden strävar efter att uppnå sitt investeringsmål genom exponering mot en portfölj av olika enskilda kvantitativa systematiska strategier som fokuserar på att dra nytta av marknadsstörningar och stress. Delfonden syftar till att minimera den traditionellt höga kostnaden för carry vid investering i tail-strategier genom en metod som identifierar optimal risk/avkastning och ökar eller minskar exponeringar i förhållande till denna risk/avkastning.

Delfonden syftar till att använda hävstång för att ta långa och korta positioner och därigenom skapa en jämn avkastning oberoende av makroekonomiska trender, med avsikten att prestera bättre under perioder av marknadsnedgång. Delfonden anpassar sin investeringsstrategi genom att (i) välja strategier som syftar till att generera avkastning under perioder av marknadsstress ("tail-strategier") och (ii) strategier som syftar till att utnyttja marknadsineffektiviteter på alla marknader ("carry-strategier").

Delfonden strävar efter att identifiera de bästa möjligheterna inom ett brett investeringsområde som omfattar olika tillgångsslag, inklusive, men inte begränsat till, aktier, valutor, råvaror och räntebärande instrument, samt investeringar i samtliga regioner. Delfonden kommer huvudsakligen att exponeras mot strategier som systematiskt exponeras mot det tidigare beskrivna investeringsområdet genom aktieindex-terminer och/eller optioner, utdelningsterminer, volatilitets-terminer, ränteswappar, swaptions, statsobligationsterminer, aktier, valutaterminer samt finansiella index.

Delfonden kommer att exponeras antingen genom att:

- investera direkt i aktier, noterade eller OTC-optioner och/eller noterade finansiella terminer och/eller

- exponeras mot delar av eller samtliga Strategier genom att (i) använda strukturerade produkter såsom EMTN (Euro Medium Term Note), och/eller, (ii) OTC-derivat såsom swaptions på amerikanska och europeiska räntekurvor, och/eller ränteswappar på amerikanska och europeiska räntekurvor, och/eller valutaterminer, och/eller Total Return Swaps (TRS), och/eller fullt finansierade eller ofinansierade swappar.

Därutöver, när exponering sker genom en eller flera OTC-swaptransaktioner, kan Delfonden investera i en portfölj av höglikvida värdepapper ("Portföljen av värdepapper") och:

- ingå i OTC-swaptransaktioner för att exponeras mot Strategier utöver Portföljen och/eller,
- utbyta, genom OTC-swaptransaktioner, värdet av en sådan Portfölj

mot värdet av Strategierna.

Portföljen kan bestå av:

- upp till 110% av Delfondens netto-tillgångar, internationella aktier som ingår i ett större aktieindex och/eller,
- upp till 110 % av Delfondens nettotillgångar i statsobligationer utgivna av OECD-länder med kreditbetyg om minst BBB- (Standard & Poor's) (eller med en likvärdig rating från ett annat ledande kreditvärderingsinstitut).

Andelsvalutan är amerikanska dollar (USD).

Investerade finansiella instrument: internationella aktier, statsobligationer utgivna av OECD-länder, OTC-derivat såsom Total Return Swaps (TRS), fullt finansierade eller ofinansierade swappar, EMTN (Euro Medium Term Note), terminer och/eller optioner på aktieindex, utdelningsterminer, volatilitets-terminer, ränteswappar och swaptions, statsobligationsterminer, valutaterminer samt finansiella index (inklusive råvaruindex genom användning av finansiella derivatinstrument).

Utdelningspolicy: samtliga andelsklasser är ackumulerande.

Nettotillgångsvärde (NAV): beräknas dagligen under förutsättning att de relevanta börserna är öppna för handel och att order kan täckas. Se prospektet för de bankdagar då NAV beräknas.

Teckningar och inlösen: senast en bankdag före varje handelsdag (såsom definierat i prospektet), dock senast kl. 12.00 luxemburgsk tid.

Behöriga investerare: denna andelsklass riktar sig till institutionella investerare enligt artikel 174 punkt 2 c) i den luxemburgska lagen av den 17 december 2010 om företag för kollektiva investeringar, i dess nuvarande lydelse, med undantag för amerikanska investerare. Personer.

Rekommendation: denna delfond kan vara olämplig för investerare som planerar att ta ut sina pengar inom en period under 5 år.

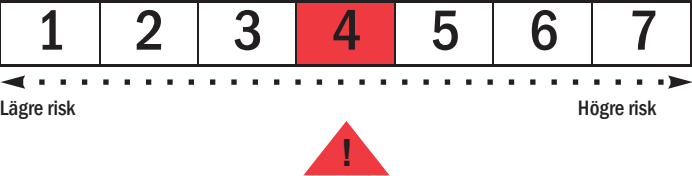
Depåbank: Société Générale Luxembourg S.A.

Ytterligare information: mer information om denna delfond, inklusive prospekt och finansiella rapporter, tillhandahålls kostnadsfritt på begäran från Société Générale Investment Solutions (France), 29 boulevard Haussmann, 75009 Paris, samt på webbplatsen: <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>

Delfondens nettotillgångsvärde (NAV) finns tillgängligt på: <https://www.fundsquare.net>

Vilka är riskerna och den potentiella avkastningen?

Syntetisk riskindikator:



Denna riskindikator förutsätter att investeringen innehas i minst 5 år. Den faktiska risken kan skilja sig avsevärt om delfonden innehas under en kortare period, vilket kan ha en negativ inverkan på avkastningen. Riskindikatorn mäter denna produkts risknivå i förhållande till andra investeringsprodukter. Den återspeglar sannolikheten för att negativa marknadsrörelser kan orsaka förluster i denna finansiella produkt eller att betalning inte kan genomföras.

Produkten har tilldelats riskklass 4 av 7, vilket motsvarar en medelrisk. Detta innebär att produkten har en medelhög förlustrisk och att förvaltningsbolaget kanske inte kan lösa in investeringen fullt ut om marknadsförhållandena försämras. Detta kan påverka förvaltningsbolagets förmåga att betala ut. Delfonden kan även exponeras mot följande risker som inte omfattas av riskindikatorn:

Motpartsrisk: risken att en motpart i en OTC-transaktion med delfonden inte kan uppfylla sina avtalsenliga förpliktelser.

Kreditrisk: försämrade kreditvärdighet hos en emittent.

Eftersom denna produkt inte erbjuder något skydd mot marknadsfluktuationer kan hela eller delar av investeringen gå förlorad.

Prestandascenarier

Nedanstående siffror inkluderar samtliga kostnader som avser den finansiella produkten, men inte nödvändigtvis alla avgifter som ska betalas till rådgivare eller distributör. De tar inte heller hänsyn till den personliga skattesituationen, vilket också kan påverka de belopp som betalas ut. Avkastningen från denna delfond beror på finansmarknadernas framtida utveckling. Framtida marknadsrörelser är slumpmässiga och kan inte fastställas med säkerhet på förhand. De ogynnsamma, mellanliggande och gynnsamma scenarierna som presenteras nedan är exempel baserade på delfondens lägsta, median- och högsta avkastning samt på den genomsnittliga utvecklingen för relevant jämförelseindex under de senaste 10 åren. Marknaderna kan utvecklas helt annorlunda i framtiden. Stresscenariot visar hypotetisk avkastning under extrema marknadsförhållanden.

Rekommenderad innehavsperiod: 5 år Investering: 10 000 USD			
Scenarier		Om investeringen avslutas efter:	
		1 år	5 år
Minimiavkastning	Ingen lägsta avkastning är garanterad. Hela eller delar av investeringen kan gå förlorad.		
Stressscenario	Hypotetisk avkastning efter kostnader	750 USD	950 USD
	Genomsnittlig årlig avkastning	-92.50%	-37.60%
Ogynnsamt scenario	Hypotetisk avkastning efter kostnader	9 900 USD	10 730 USD
	Genomsnittlig årlig avkastning	-1.00%	1.40%
Mellanliggande scenario	Hypotetisk avkastning efter kostnader	10 340 USD	21 640 USD
	Genomsnittlig årlig avkastning	3.40%	16.70%
Gynnsamt scenario	Hypotetisk avkastning efter kostnader	20 090 USD	25 990 USD
	Genomsnittlig årlig avkastning	100.90%	21.10%

Det ogynnsamma scenariot inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan maj 2014 och maj 2019. Det mellanliggande scenariot inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan april 2016 och april 2021. Det gynnsamma scenariot inträffade för en investering i jämförelseindexet mellan mars 2019 och mars 2024.

Vad händer om delfondens sponsor inte kan lösa in andelarna?

Om förvaltningsbolaget som förvaltar delfondens tillgångar brister i sina åtaganden har detta ingen inverkan på investeringen. Delfondens depåbank ansvarar för förvaring och skydd av delfondens tillgångar.

Hur mycket kostar denna investering?

Kostnaderna kan delas med distributören för att täcka de tjänster som tillhandahålls. Distributören informerar om beloppet.

KOSTNADER ÖVER EN 5-ÅRSPERIOD

Tabellerna nedan visar de belopp som tas från investeringen för att täcka olika kostnader. Dessa belopp beror på hur mycket som investeras och på hur länge investeringen innehas. Beloppen som visas här är exempel baserade på ett hypotetiskt investeringsbelopp och olika möjliga investeringsperioder.

Vi har antagit följande:

- att det första året återfås det investerade beloppet (0 % årlig avkastning);
- att produkten för de övriga innehavsperioderna utvecklas i enlighet med det mellanliggande scenariot;
- 10 000 USD investeras.

Investering: 10 000 USD	Om investeringen avslutas efter:	
	1 år	5 år
Totala kostnader	45 USD	491 USD
Årlig kostnad i % (*)	0.45%	0.53% per år

(*) Det visar hur mycket kostnaderna minskar avkastningen årligen under innehavsperioden. Det visar till exempel att om investeringen avslutas vid slutet av den rekommenderade innehavsperioden förväntas den genomsnittliga årliga avkastningen uppgå till 17,23 % före kostnader och 16,70 % efter kostnader.

KOSTNADSFÖRDELNING

Engångsavgifter vid teckning			Effekten av årliga kostnader om investeringen avslutas efter endast 1 år. Investering: 10 000 USD
Teckningsavgift	0.00% av investeringen. Detta är det högsta belopp som kan betalas och det faktiska beloppet kan vara lägre.	0 USD	
Inlösenavg	0.00% av investeringen innan den betalas ut. Detta är det högsta belopp som kan betalas och det faktiska beloppet kan vara lägre.	0 USD	
Avgifter som tas ut från delfonden årligen			
Förvaltningsavgifter och andra administrativa och driftsrelaterade kostnader	0.45% av värdet av investeringen per år. Detta är en uppskattning.	45 USD	
Transaktionskostnader	0.00% av värdet av investeringen per år. Detta är en uppskattning av de kostnader som uppstår när investeringar köps och säljs och som ligger till grund för produkten. Det faktiska beloppet beror på volymen av värdepapper som vi köper eller säljer.	0 USD	
Tilläggsavgifter som tas ut från delfonden under särskilda omständigheter			
Prestationsrelaterade avgifter	Prestationsavgiften uppgår till en procentsats av avkastningen för den relevanta andelsklassen under referensperioden, i den mån den överstiger tröskelräntan (enligt definitionen i prospektet). Procentsatsen för beräkningen av prestationsavgiften är 20 % som tillämpas på den överavkastning som överstiger skillnaden mellan andelsklassens avkastning och "Tröskelräntan" (SOFR).	0 €	

Hur länge måste investeringen innehas och kan den lösas in i förtid?

REKOMMENDERAD INVESTERINGSPERIOD: 5 ÅR

Denna delfond kan vara olämplig för investerare som planerar att ta ut sina pengar inom en period under 5 år. Den rekommenderade innehavsperioden är avsedd att minimera risken för kapitalförlust på investeringen om den löses in efter denna period. Den utgör dock ingen garanti. Investeringen kan dock lösas in när som helst. Delfonden tar inte ut någon inlösenavgift.

Vem kontaktar jag om jag har en fråga eller ett klagomål?

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

Övrig relevant information

Samtliga juridiska dokument (dvs. prospektet och de senaste års- och halvårsrapporterna) finns tillgängliga kostnadsfritt på begäran från förvaltningsbolaget eller på dess webbplats: <https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr>