

Basisinformationsblatt

Zweck

Dieses Informationsblatt 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

| | |
|---|---|
| Name | Structured Investments SICAV - GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity Index Total Return Portfolio Class A Hedged (CHF Hedged) |
| PRIP-Hersteller | Structured Investments SICAV (der „Fonds“) |
| ISIN | LU0454946087 |
| Website | www.gsfundsolutions.com |
| Kontakt mit dem Hersteller | E-Mail: Structured-Investments-SICAV-PRIPs@gs.com, Tel.: +44 207 774 6366 |
| Zuständige Behörde | Die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ist für die Aufsicht des Fonds in Bezug auf dieses Basisinformationsblatt zuständig. |
| Einzelheiten zur Zulassung | Dieser Fonds und seine Teilfonds sind in Luxemburg zugelassen und stehen unter der Aufsicht der CSSF. |
| Verwaltungsgesellschaft | Amundi Luxembourg S.A. ist in Luxemburg zugelassen und steht unter der Aufsicht der CSSF. |
| Datum der Erstellung des Basisinformationsblatts | 2024-02-12 |

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

| | |
|----------------------------------|---|
| Art | <p>Der Fonds wurde als „société anonyme“ gegründet – ein offener Fonds, der nach dem geänderten Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen gegründet wurde. Der Fonds ist ein OGAW im Sinne der OGAW-Richtlinie. Der Fonds ist ein Umbrella-Fonds mit mehreren Teilfonds. Der GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity Index Total Return Portfolio (der „Teilfonds“) ist ein Teilfonds des Fonds. Structured Investments SICAV - GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity Index Total Return Portfolio Class A Hedged (CHF Hedged) (die „Anteile“) sind eine Anteilsklasse des Teilfonds. Der Teilfonds ist ein Teilfonds eines Investmentfonds, dessen Wertentwicklung von seinem Portfolio abhängt, wie im Abschnitt „Ziele“ in diesem KID näher beschrieben.</p> |
| Laufzeit | <p>Der Teilfonds und die Anteile haben kein Fälligkeitsdatum. Der PRIP-Hersteller kann die Anteile und/oder den Teilfonds einseitig kündigen. Die Anteile und/oder der Teilfonds und der Fonds können gemäß den im Verkaufsprospekt unter „ALL GEMEINE INFORMATIONEN ZUM UMBRELLA FONDS - Auflösung und Liquidation des Umbrellafonds, eines Portfolios oder einer Anteilsklasse“ dargelegten Standardverfahren liquidiert werden.</p> |
| Ziele | <p>Das Anlageziel des Teilfonds liegt in der Nachbildung des Goldman Sachs Modified Strategy D266 on the Bloomberg Commodity Index Total Return (die „Strategie“). Das Produkt bietet Potenzial für Kapitalzuwachs. Was Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer, wie weiter unten beschrieben, erhalten werden, ist nicht sicher und hängt von der Wertentwicklung der Strategie ab. Die Strategie zielt darauf ab, den Bloomberg Commodity Index Total Return (der „Index“) zu übertreffen, indem bestimmte Anpassungen an der Berechnungsmethodik des Index vorgenommen werden, um die vorherrschenden Marktbedingungen und/oder das saisonale Angebot und die saisonale Nachfrage nach oder die Handelsmuster der zugrunde liegenden Rohstoffe zu erfassen, wie nachstehend näher beschrieben. Mit diesen Anpassungen soll die Wertentwicklung der Strategie gegenüber der des Index verbessert werden. Wenn der Wert der Strategie steigt, sollte auch der Wert Ihrer Anlage steigen. Wenn der Wert der Strategie sinkt, sollte auch der Wert Ihrer Anlage sinken.</p> <p>Der Index zielt darauf ab, eine breit gestreute Darstellung der Rohstoffmärkte als Anlageklasse zu bieten. Im Index sind mehr als 20 Rohstoffe vertreten. Der Index und damit auch die Strategie sind nicht in gleichem Maße den einzelnen Rohstoffen ausgesetzt, aus denen er sich zusammensetzt. Wie der Index setzt sich auch die Strategie aus Rohstoff-Futures zusammen. Ein Rohstoff-Future ist eine Vereinbarung über den Kauf und Verkauf eines bestimmten Rohstoffs zu einem festen Preis an einem zukünftigen Liefertermin. Nähert sich der Liefertermin eines Rohstoff-Futures in der Strategie, wird die Strategie diesen Rohstoff-Future durch einen neuen mit einem späteren Liefertermin ersetzen. Dies wird als „Rolling“ bezeichnet.</p> <p>Der Teilfonds wird nicht direkt in die Futures investieren, aus denen sich die Strategie zusammensetzt. Der Teilfonds wird stattdessen im Rahmen von Finanzkontrakten, die mit Gegenparteien (zu denen auch Goldman Sachs International gehören kann) abgeschlossen werden, ein Engagement in der Strategie eingehen.</p> <p>Sie können Ihre Anteile täglich zurückgeben. Die Anteile schütten keine Dividenden aus. Anteile sind in anderen Anteilsklassen und wie unter „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen“ im Fondsprospekt beschrieben sowie in anderen Währungen erhältlich, die in der Liste der verfügbaren Anteilsklassen für den Teilfonds auf www.gsfundsolutions.com angegeben werden können. Anteilinhaber können den Umtausch ihrer Anteile einer beliebigen Anteilsklasse eines Teilfonds in eine beliebige Anteilsklasse eines anderen Teilfonds beantragen, vorbehaltlich der im Fondsprospekt genannten Bedingungen (es können Gebühren anfallen). Regelmäßige Berichte und der Verkaufsprospekt, wie im Abschnitt „Sonstige Informationen“ weiter unten beschrieben, werden für den Fonds als Ganzes erstellt.</p> |
| Verwahrstelle | The Bank of New York Mellon (Luxembourg) S.A. |
| Zusätzliche Informationen | <p>Weitere Informationen und die vollständigen rechtlichen Bedingungen für den Teilfonds sowie andere zweckdienliche Informationen entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt. Alle Dokumente (Fondsprospekt, Jahres- und Halbjahresberichte in englischer Sprache) sind auf Anfrage oder unter www.gsfundsolutions.com kostenlos erhältlich. Informationen über den Nettoinventarwert des Teilfonds und des Anteils sind beim Verwalter oder unter www.gsfundsolutions.com erhältlich. Structured Investments SICAV ist eine Investmentgesellschaft mit getrennter Haftung zwischen Teilfonds nach luxemburgischem Recht. Dies bedeutet, dass die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eines Teilfonds von den Vermögenswerten und Verbindlichkeiten eines anderen Teilfonds getrennt sind. Daher sollten die Vermögenswerte des Teilfonds, in den Sie investiert haben, nicht dazu verwendet werden, die Verbindlichkeiten anderer Teilfonds zu begleichen. Dies wurde jedoch nicht in anderen Gerichtsbarkeiten getestet.</p> |

Das Produkt soll Kleinanlegern angeboten werden, die alle nachstehenden Kriterien erfüllen:

1. sie sind in der Lage, eine fundierte Anlageentscheidung zu treffen, indem sie das Produkt und seine spezifischen Risiken und Chancen entweder selbstständig oder mit Hilfe professioneller Beratung ausreichend kennen und verstehen, und sie haben möglicherweise Erfahrung mit der Anlage in und/oder dem Halten einer Reihe ähnlicher Produkte, die ein ähnliches Engagement am Markt bieten;
2. sie streben Kapitalzuwachs an, erwarten eine renditeträchtige Entwicklung des Basiswerts und haben einen Anlagehorizont gemäß der unten angegebenen empfohlenen Haltedauer;
3. sie akzeptieren das Risiko eines Totalverlusts ihrer Anlage und;
4. aufgrund verschiedener Risiken, einschließlich des Markt- und Kreditrisikos, die sich erheblich auf Ihre Rendite auswirken können, haben sie einen mittel- bis langfristigen Anlagehorizont und sollten bereit sein, ein Risiko von 4 von 7 zu akzeptieren, was einer mittleren Risiko ist. Diese Risiken werden im Abschnitt „Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?“ näher beschrieben..

Kleinanleger-Zielgruppe

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

Gesamtrisikoindikator



← Niedrigeres Risiko

Höheres Risiko →

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder der Teilfonds nicht in der Lage ist, Sie auszubezahlen. Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 4 eingestuft, was einer mittleren Risikoklasse entspricht. Damit

werden die potenziellen Verluste aus der künftigen Wertentwicklung als einer mittleren eingestuft, und es ist bei ungünstigen Marktbedingungen ist es möglich, dass die Fähigkeit des Teilfonds beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen., dass sich schlechte Marktbedingungen auf die Fähigkeit des PRIIPs auswirken, Sie auszuzahlen. **Bitte beachten Sie das Währungsrisiko. Unter Umständen erhalten Sie Zahlungen in einer anderen Währung, sodass Ihre endgültige Rendite vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen wird. Im Indikator wird dieses Risiko nicht berücksichtigt. Weitere Informationen zu den Risiken finden Sie im Unterabschnitt „Spezifische Risiken einer Investition in das Portfolio“ in der Ergänzung des Fondsprospekts für den Teilfonds. Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten. Wenn der Teilfonds nicht in der Lage ist, Ihnen die geschuldeten Beträge auszuzahlen, könnten Sie Ihre gesamte Anlage verlieren.**

Performance-Szenarien

Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Das dargestellte pessimistische, mittlere und optimistische Szenario veranschaulichen die schlechteste, durchschnittliche und beste Wertentwicklung des Produkts in den letzten 10 Jahren.

| Empfohlene Haltedauer: Anlagebeispiel: | | 5 Jahre CHF 10,000 | |
|---|---|---------------------------------|-----------------------------------|
| Szenarien | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen |
| Minimum | Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren. | | |
| Stressszenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 4,100 CHF | 3,250 CHF |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -59.01% | -20.12% |
| Pessimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 7,060 CHF | 4,290 CHF |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -29.4% | -15.57% |
| Mittleres Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 9,610 CHF | 11,010 CHF |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -3.86% | 1.94% |
| Optimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 14,830 CHF | 15,810 CHF |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 48.33% | 9.6% |

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Bei den angeführten Zahlen ist Ihre persönliche steuerliche Situation nicht berücksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel Sie zurückerhalten.

- **Stressszenario:** zeigt, was Sie im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnten
- **Pessimistisches Szenario:** Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen Mai 2022 und Dezember 2023
- **Mittleres Szenario:** Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen Februar 2016 und Februar 2021
- **Optimistisches Szenario:** Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen Mai 2017 und Mai 2022

Was geschieht, wenn Structured Investments SICAV nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Der Anleger kann durch den Ausfall des PRIIP-Herstellers einen finanziellen Verlust erleiden. Die Vermögenswerte des Fonds werden von seiner Verwahrstelle, The Bank of New York Mellon SA/NV, Zweigstelle Luxemburg (die „Verwahrstelle“), verwahrt. Im Falle der Insolvenz der Verwahrstelle oder einer in ihrem Namen handelnden Person kann der Fonds jedoch einen finanziellen Verlust erleiden. Dieses Risiko wird jedoch bis zu einem gewissen Grad dadurch gemildert, dass die Verwahrstelle gesetzlich und aufsichtsrechtlich verpflichtet ist, ihr eigenes Vermögen vom Vermögen des Fonds zu trennen. Die Verwahrstelle haftet dem Fonds gegenüber auch für Verluste, die unter anderem durch ihre Fahrlässigkeit, ihren Betrug oder ihre vorsätzliche Nichterfüllung ihrer Pflichten entstehen (vorbehaltlich bestimmter Beschränkungen, die in der Vereinbarung mit der Verwahrstelle festgelegt sind). Verluste sind nicht durch ein Entschädigungs- oder Garantiesystem des Anlegers gedeckt.

Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen und wie lange Sie das Produkt halten. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume. Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt: Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0 % Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt. CHF 10,000 werden angelegt.

| Anlage CHF 10,000 | | |
|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| Szenarien | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen |
| Kosten insgesamt | 179 CHF | 1,024 CHF |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten (*) | 1.79 % | 1.83 % |

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie zum Beispiel am Fälligkeitsdatum aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 3.77 % vor Kosten und 1.94 % nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

| Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen |
|--|---|---------------------------------|
| Einstiegskosten | 0.0 % des Betrags, den Sie beim Einstieg in diese Anlage zahlen | 0 CHF |
| Ausstiegskosten | 0.0 % Ihrer Anlage, bevor sie an Sie ausgezahlt wird | 0 CHF |
| Laufende Kosten pro Jahr | | |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 1.15% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf der Grundlage der tatsächlichen Kosten des letzten Jahres. | 115 CHF |
| Transaktionskosten | 0.64 % des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen. | 64 CHF |
| Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen | | |
| Erfolgsgebühren | Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie gut sich Ihre Anlage entwickelt. Die vorstehende Schätzung der kumulierten Kosten enthält den Durchschnitt der letzten fünf Jahre. Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet. | 0 CHF |

Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre

Das Produkt zielt darauf ab, Ihnen die unter „1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?“ beschriebene Rendite zu bieten, wenn das Produkt mindestens 5 Jahre gehalten wird, was der empfohlenen Haltedauer entspricht. Wir haben die empfohlene Haltedauer von 5 Jahren gewählt, um Ihren Anteilsbesitz auf den mittel- bis langfristigen Charakter der Anlagen und die Annahme abzustimmen, dass der Teilfonds mittel- bis langfristig eine optimale Rendite erzielen wird. Haltedauer erhöht das Risiko geringerer Anlagerenditen. Sie können Anteile in der Häufigkeit verkaufen/zurückgeben, die im Abschnitt „Um welche Art von Produkt handelt es sich?“ angegeben ist. Weitere Informationen darüber, wie Sie Anteile zurückgeben können, finden Sie im Fondsprospekt unter „ZEICHNUNG, ÜBERTRAGUNG, UMTAUSCH UND RÜCKNAHME VON ANTEILEN“. Etwaige Ausstiegskosten werden im Abschnitt „Welche Kosten entstehen?“ oben angegeben.

Wie kann ich mich beschweren?

Beschwerden über die Person, die Sie über das Produkt berät oder es verkauft (z. B. Ihr Vermittler), können Sie direkt bei dieser Person einreichen. Wenn Sie sich über das Produkt und/oder die Dienstleistung, die Sie erhalten haben, beschweren möchten, wenden Sie sich bitte an Amundi Luxembourg S.A., 5, Allée Scheffer, L-2520 Großherzogtum Luxemburg oder senden Sie Ihre Beschwerde an info@Amundi.com oder über gsfundsolutions.com.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Zusätzliche Informationen in Bezug auf das Produkt, insbesondere Informationen über die Wertentwicklung des Produkts in den letzten 10 Jahren, finden Sie unter <https://iquant.space/>. Berechnungen früherer Performance-Szenarien finden Sie unter <https://iquant.space/>.

Die in diesem Basisinformationsblatt enthaltenen Informationen werden durch die Satzung und den Verkaufsprospekt ergänzt, die den Anlegern vor der Zeichnung zur Verfügung gestellt werden, sowie durch den letzten Jahresbericht und ggf. einen nachfolgenden Halbjahresbericht. Weitere Informationen über den Fonds, einschließlich eines Exemplars des Verkaufsprospekts, des letzten Jahresberichts und aller nachfolgenden Halbjahresberichte, sind in englischer Sprache unter www.gsfundsolutions.com oder am eingetragenen Sitz des Fonds bei The Bank of New York Mellon SA/NV Zweigstelle Luxemburg, Vertigo Building – Polaris, 2-4, rue Ruppert, L-2453 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, kostenlos erhältlich. Ein Exemplar der KID ist auf Anfrage kostenlos am eingetragenen Sitz des Fonds bei The Bank of New York Mellon SA/NV Zweigstelle Luxemburg, Vertigo Building – Polaris, 2-4, rue Ruppert, L-2453 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, erhältlich. Die KID sind erhältlich unter www.gsfundsolutions.com.