

Detta faktablad riktar sig till investerare och innehåller basfakta för investerare om denna delfond. Faktabladet är inte reklammaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå vad en investering i delfonden innebär och riskerna med detta. Vi uppmanar dig att läsa den så att du kan fatta ett välgrundat investeringsbeslut.

Förvaltningsbolag: FundRock Management Company S.A.

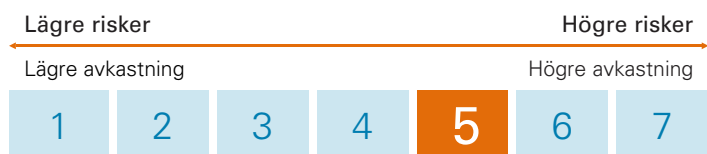
## Mål och placeringsinriktning

- Portföljens investeringsmål är att prestera bättre än Bloomberg Commodity Index Total Return ("indexet") genom att följa strategin Modified Strategy Goldman Sachs E166 på Bloomberg Commodity Index Total Return ("strategin"). Strategins syfte är att prestera bättre än indexet genom att göra vissa justeringar av metoden för beräkning av indexet, för att fånga de rådande marknadsvillkoren (när det gäller råolja) och/eller säsongsbaserad tillgång och efterfrågan på, eller handelsmönster för, de underliggande råvarorna enligt vad som anges nedan. Dessa justeringar är avsedda att förbättra strategins avkastning över indexets avkastning, men det finns inga garantier för att dessa justeringar kommer att få önskad effekt och det är möjligt att dessa justeringar faktiskt skulle kunna leda till att strategin presterar sämre än indexet.
- Om strategins värde stiger, bör även värdet på din investering öka. Om strategins värde sjunker, bör även värdet på din investering minska.
- Indexet syftar till att ge en brett spridd representation av råvarumarknaderna som tillgångsklass. Indexet representerar 20 råvaror (däribland råvaror som naturgas, guld, amerikansk råolja och koppar). Var och en av dessa råvaror påverkar i varierande grad indexet, och därmed strategin.
- I likhet med indexet består strategin av råvaruterminer. En råvarutermin är ett avtal om köp och försäljning av en viss råvara till en fast kurs på ett framtida leveransdatum. Då en

råvarutermin i strategin närmar sig leveransdatum, kommer strategin att ersätta den råvaruterminen med en ny med ett senare leveransdatum. Detta kallas "rullning".

- En allmän uppgång av råvaruterminskurserna bör leda till en ökning av strategins värde. Omvänt skulle en allmän nedgång av råvaruterminskurserna leda till en minskning av strategins värde.
- En viktig faktor är dock att avkastningen på ett investeringsindex som består av råvaruterminer (som till exempel indexet och strategin) kommer att likna, men ändå skilja sig från, avkastningen på köp och innehav av själva råvaran. Den "rullande" effekten av de underliggande råvaruterminerna kan särskilt i vissa fall leda till att strategin ger en sämre (eller bättre) avkastning än en direkt fysisk investering.
- Portföljen kommer inte att investera direkt i de terminer som strategin består av. Istället kommer portföljen att skaffa sig exponering mot strategin i form av finansiella kontrakt som ingås med motparter (vilka kan omfatta Goldman Sachs International ("GSI")).
- Likviditet:** Du kan dagligen lösa in dina andelar.
- Inga intäkter:** Portföljen lämnar inte någon utdelning.

## Risk/avkastningsprofil



Denna indikator mäter risken för kurssvängningar baserade på simulerade historiska data. Historiska data, som till exempel används vid beräkning av samlingsindikatorn, bör inte anses som en tillförlitlig indikation på portföljens framtida riskprofil. Det finns ingen garanti för att portföljens risk/avkastningskategori förblir oförändrad. Den kan ändras efter hand. Den lägsta riskkategorin innebär inte att investeringen är riskfri.

Portföljen hör till kategori 5, då den huvudsakligen investerar i globala råvarumarknader som i regel uppvisar större kursfluktuationer än marknader som handlar med andra typer av tillgångar.

### Andra risker som i väsentlig grad är relevanta för portföljen ingår inte i ovanstående indikator. De omfattar:

- Motpartsrisk:** Portföljens avtal med motparter (inklusive GSI) exponerar den för risken att sådana motparter kan komma att misslyckas med att uppfylla sina åtaganden. Denna risk

minskas, men elimineras inte nödvändigtvis, av att motparten tillhandahåller kontanter och värdepapper till portföljen från tid till annan för att understödja motpartens åtaganden.

- Garanteras ej:** Det finns inga garantier för portföljen och en investering utgör en risk. Värdet på din investering kan både öka och minska. Tidigare resultat är inte någon tillförlitlig indikator på framtida resultat.
- Intressekonflikter:** GSI och dess närstående bolag kan ha flera funktioner i förhållande till portföljen som till exempel grundare, distributör och motpart, vilket kan innebära intressekonflikter. Sådana företag kan även ha flera roller i förhållande till strategin och de investeringar som strategin direkt eller indirekt hänvisar till. Detta kan också innebära intressekonflikter.
- Investeringsmetoder:** Portföljen kommer att använda traditionella och icke-traditionella investeringsmetoder, däribland att inneha finansiella derivatinstrument och andra liknande kontrakt i riskhanterings-, kurssäkrings- och investerings syfte, vilket även kan medföra hävstångseffekt. Marknadsvärdet på sådana instrument och därmed portföljens substansvärde kan fluktueras regelbundet, och sådana fluktuationer kan vara stora.
- Ingen garanti:** Det finns inga garantier för att strategin eller understrategierna kommer att uppnå det avsedda resultatet. Om så inte blir fallet, kan det resultat som strategin uppnår vara negativt och det kan påverka värdet på din investering negativt.

## Avgifter

Avgifterna du betalar används för att bekosta driften av portföljen, inklusive kostnader för marknadsföring och distribution. Dessa avgifter minskar investeringens potentiella tillväxt.

### Engångsavgifter som debiteras före eller efter investeringstillfället

Teckningsavgift: 5,00%

Inlösenavgift: ingen

Följande maximibelopp kan tas ut av dina pengar innan de investeras.

### Avgifter som debiterats portföljen under året

Årlig avgift: 1,13%

### Avgifter som debiteras portföljen under särskilda omständigheter

Resultatrelaterad avgift: ingen

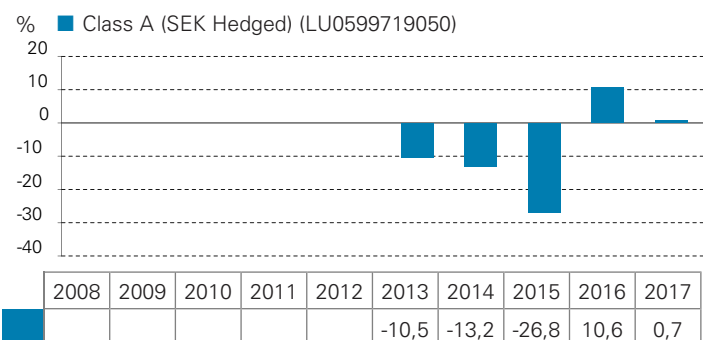
Angivna tecknings- och inlösenavgifter utgör maximibelopp. I vissa fall betalar du kanske mindre. Din ekonomiska rådgivare har mer information om detta.

Siffran för årliga avgifter grundas på kostnaderna för året som slutar i december 2017. Denna siffra kan variera från år till år. Den omfattar inte:

- Portföljens transaktionskostnader, utom vid en tecknings-/inlösenavgift som betalas av portföljen vid köp eller försäljning av andelar i en annan kollektiv investeringsfond. Portföljens transaktionskostnader ska betalas ur portföljens tillgångar, vilket kan påverka resultatet på din investering.

För mer information om avgifter, se portföljens bilaga som kan erhållas på begäran eller på [www.gsfundsolutions.com](http://www.gsfundsolutions.com).

## Tidigare resultat



Du bör vara medveten om att tidigare resultat inte är en tillförlitlig indikator för framtida resultat vilka kan variera.

Portföljen lanserades den 2009. Andelsklassen lanserades den 02/08/2012.

Tidigare resultat har beräknats i SEK och visas som en procentuell förändring av Portföljens substansvärde vid varje årsslut (minus alla avgifter).

## Praktisk information

**Förvaringsinstitut:** Bank of New York Mellon (Luxembourg) S.A. fungerar som portföljens förvaringsinstitut.

**Mer information:** Ytterligare information samt de fullständiga juridiska villkoren för portföljen och annan praktisk information finns i prospektet. Alla dokument (prospekt, års- och halvårsrapporter på engelska) kan erhållas kostnadsfritt på begäran eller på [www.gsfundsolutions.com](http://www.gsfundsolutions.com). Information om portföljens substansvärde kan erhållas från portföljens administratör eller på [www.gsfundsolutions.com](http://www.gsfundsolutions.com).

Structured Investments SICAV är ett investeringsbolag med separat ansvar mellan portföljerna enligt luxemburgsk lag. Detta innebär att en portföljs tillgångar och skulder är separerade från andra portföljers tillgångar och skulder. Tillgångarna i den portfölj du investerat i ska därför inte användas för att betala andra portföljers skulder. Detta har dock ej prövats i andra jurisdiktioner.

**Skattelagstiftning:** Portföljens investeringar kan vara föremål för beskattning i de länder där investeringar görs. Dessutom är denna portfölj föremål för Luxemburgs skattelagstiftning vilket kan påverka din personliga skattesituation och din investering.

**Byte mellan portföljer:** Andelar finns i andra andelsklasser och beskrivs under rubriken "Teckning, överföring, konvertering och inlösen av andelar" i prospektet och i andra valutor vilket kan anges i listan över tillgängliga andelsklasser för portföljen på [www.gsfundsolutions.com](http://www.gsfundsolutions.com). Andelsägare kan begära att deras andelar i en av portföljernas andelsklasser konverteras till en andelsklass i en annan portfölj, enligt villkoren som anges i prospektet (avgifter kan tas ut).

**Ansvar:** Structured Investments SICAV kan hållas ansvarigt endast om ett påstående i detta faktablad är vilseledande, felaktigt eller oförenligt med de relevanta delarna av fondens prospekt.

**Ersättningspolicy:** Uppgifter om den aktuella ersättningspolicyn för förvaltningsbolaget, inklusive men inte begränsat till en beskrivning av hur ersättningar och förmåner bestäms och styrs av förvaltningsbolaget, finns på [https://www.fundrock.com/pdf/FundRock\\_Remuneration\\_policy.pdf](https://www.fundrock.com/pdf/FundRock_Remuneration_policy.pdf) och en papperskopia är tillgänglig kostnadsfritt på begäran.