

# WESENTLICHE ANLEGERINFORMATIONEN

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

## THREADNEEDLE (LUX) - AMERICAN ABSOLUTE ALPHA (DER „FONDS“)

Klasse DU (USD Thesaurierungsanteile) LU0515764115, ein Teilfonds von Threadneedle (Lux) (die „SICAV“), die durch die CSSF reguliert wird.

Die Verwaltungsgesellschaft der SICAV ist Threadneedle Management Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) verwaltet (Teil der Unternehmensgruppe Columbia und Threadneedle).

### Ziele und Anlagepolitik

Das Ziel des Fonds ist es, ungeachtet der sich ändernden Marktbedingungen langfristig eine positive Rendite für Sie zu erzielen. Weder die Generierung positiver Renditen noch der Kapitalerhalt werden garantiert.

Der Fonds wird aktiv verwaltet und investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in Form von Long- und Short-Positionen in Unternehmen in Nordamerika oder in Unternehmen, die dort eine wesentliche Geschäftstätigkeit ausüben, sowie gegebenenfalls in Barmittel.

Der Fonds investiert direkt oder durch den Einsatz von Derivaten in Anteile. Derivate sind anspruchsvolle Anlageinstrumente, die an den Preisanstieg und -rückgang anderer Vermögenswerte gekoppelt sind. Derivate werden verwendet, um ein Engagement in Basiswerten zu erhalten, zu erhöhen oder zu reduzieren. Sie können eine Hebelwirkung erzeugen. Wenn eine Hebelwirkung erzeugt wird, kann der Nettoinventarwert des Fonds stärker schwanken als ohne Hebelwirkung. Der Fonds wird zudem Derivate für Leerverkäufe verwenden (um von fallenden Kursen zu profitieren).

Der Fonds kann auch in andere als die oben angegebenen Anlageklassen und Instrumente investieren.

Zum Zweck der Berechnung der Performancegebühr bezieht sich der Fonds auf den 90-Tage-Durchschnitt des Secured Overnight Financing Rate (SOFR).

Die Erträge aus den Anlagen im Fonds werden zum Wert Ihrer Anteile hinzugerechnet.

Sie können die Anteile des Fonds an jedem Tag kaufen oder verkaufen, der in Luxemburg ein Geschäftstag ist, es sei denn, der Verwaltungsrat hat entschieden, dass nicht genügend Märkte geöffnet sind. Diese Tage werden auf [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com) veröffentlicht. Nähere Angaben zu Anlagezielen und Anlagepolitik des Fonds finden Sie im Prospekt im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik“.

Weitere Informationen zu den in diesem Dokument verwendeten Anlagebegriffen finden Sie im Glossar, das im Dokumentenzentrum auf unserer Website veröffentlicht ist: [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com).

### Risiko- und Ertragsprofil

Die Risiko-Ertrags-Indikatortabelle zeigt, wo der Fonds in Bezug auf seine potenziellen Risiken und Erträge angesiedelt ist. Je höher der Rang, umso höher der potenzielle Ertrag, was jedoch mit einem höheren Risiko eines Kapitalverlusts verbunden ist. Basiert auf historischen Daten, kann sich im Laufe der Zeit ändern und ist nicht unbedingt ein zuverlässiger Indikator des zukünftigen Risikoprofils des Fonds. Der schattierte Bereich in der folgenden Tabelle zeigt den Rang auf dem Risiko-Ertrags-Indikator.

Niedriges Risiko, Typischerweise gilt: niedrigere Erträge

Hohes Risiko, Typischerweise gilt: höhere Erträge



- Der Fonds ist bei 5 angesiedelt, was auf dem Risikolimit des Fonds basiert und bedeutet, dass er ein mittleres bis hohes Volatilitätsniveau ausweist (wie stark der Fondswert steigt und fällt).
- Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer risikofreien Anlage gleichgesetzt werden.
- Der Wert von Anlagen kann sowohl fallen als auch steigen, und es kann sein, dass Anleger den ursprünglich investierten Betrag nicht zurückerhalten.
- Bei einer Anlage in Vermögenswerten, die in mehreren Währungen oder einer anderen Währung als Ihrer eigenen Währung denominated sind, können Änderungen der Wechselkurse den Wert der Anlagen beeinflussen.
- Es werden keine positiven Erträge garantiert und es gibt keinerlei Kapitalschutz.
- Der Fonds kann mit ausgewählten Gegenparteien Finanzkontrakte abschließen. Finanzielle Schwierigkeiten, die bei diesen Gegenparteien auftreten, können die Verfügbarkeit und den Wert des Fondsvermögens wesentlich beeinflussen.
- Die objektive Bewertung der Vermögenswerte des Fonds ist möglicherweise manchmal schwierig und der tatsächliche Wert ist nicht erkennbar, bis die Vermögenswerte verkauft werden.
- Eine Hebelfinanzierung („Leverage“) entsteht, wenn ein wirtschaftliches Engagement durch Derivate größer ist als der investierte Betrag. Ein solches Engagement und der Einsatz von Leerverkaufstechniken können im Fonds zu Verlusten führen, die über den angelegten Betrag hinausgehen.
- Der Fonds kann erheblich in Derivate anlegen. Eine relativ geringe Veränderung des Wertes einer zugrundeliegenden Anlage kann eine viel stärkere positive oder negative Auswirkung auf den Wert des Derivats haben.
- Alle aktuell für den Fonds zutreffenden Risiken finden Sie im Abschnitt „Risikofaktoren“ des Prospekts.

## Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten werden auf die Verwaltung des Fonds, einschließlich seiner Vermarktung und Vertriebskosten, verwendet. Diese Kosten beschränken das potenzielle Anlagewachstum Ihrer Anlage.

### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

Ausgabeaufschlag:	1,00%
Rücknahmeabschlag:	0,00%

Das sind die maximalen Gebühren, die wir Ihren Geldern entnehmen, bevor sie investiert werden. In manchen Fällen können Sie weniger bezahlen und Sie sollten sich diesbezüglich mit Ihrem Finanzberater in Verbindung setzen.

### Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden

Laufende Kosten:	2,30%
------------------	-------

### Kosten, die der Fonds unter bestimmten Bedingungen zu tragen hat

An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren:	20%*
--	------

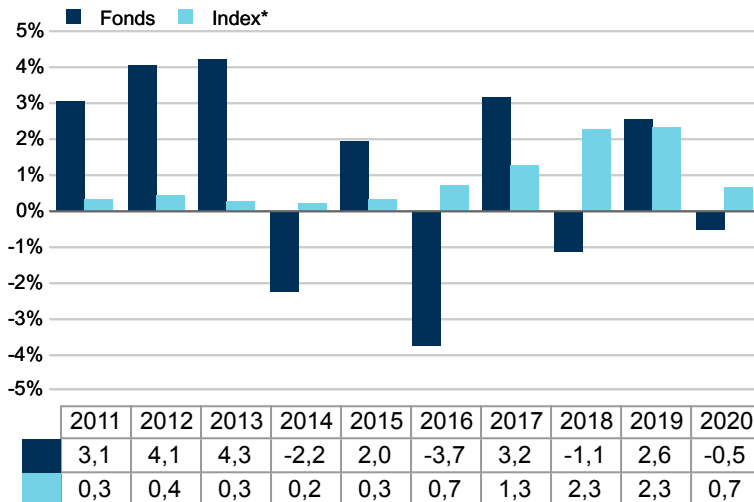
Umtauschgebühr (beim Wechsel von einem Fonds in einen anderen Fonds) 0,75%

Die laufenden Gebühren basieren auf den Aufwendungen für das am 31.03.20 beendete Jahr. Sie schließen die Gebühren für den An- und Verkauf von Vermögenswerten für den Fonds aus (außer wenn diese Werte Anteile an einem anderen Fonds sind).

Es fällt täglich eine an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühr von 20% an, die jährlich zahlbar ist. Der Anteilspreis wird entsprechend der Fondsrendite angepasst, je nachdem, ob diese über oder unter dem jeweils höheren Wert des 90-Tage-Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) plus 1,75 % oder 1,50 % liegt. Nähere Angaben finden Sie im Abschnitt „Kosten und Ausgaben“ des Prospekts.

\* Im letzten Geschäftsjahr des Fonds (bis 31.03.20) wurde keine an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühr belastet.

## Frühere Wertentwicklung



Quelle: Morningstar

Sie sollten sich bewusst sein, dass die frühere Wertentwicklung keine Orientierung für künftige Ergebnisse ist.

Auflegungsdatum des Fonds: 15.06.2010

Auflegungsdatum der Aktien-/Anteilsklasse: 29.11.2010

Die Wertentwicklung wird in USD berechnet.

Alle Kosten und Ausgaben, mit Ausnahme der Umtauschgebühr, des Ausgabe- und Rücknahmeabschlags, wurden bei der Performance berücksichtigt.

\*90-day Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

Mit Wirkung ab dem 01.09.2021 verwendet der Fonds den 90-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) zur Messung und Bewertung der Wertentwicklung des Fonds im Zeitverlauf. Zuvor nutzte der Fonds den 3 Month USD London Interbank Offered Rate (LIBOR).

## Praktische Informationen

■ Depotbank: Citibank Europe plc, Luxembourg branch.

■ In der Schweiz können Sie den Fondsprospekt, das Dokument mit wesentlichen Informationen für den Anleger (sog. KIID), die Gründungsurkunde/Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos bei der Schweizer Vertretung und Zahlstelle, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Niederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich oder unter [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com) erhalten. Weitere praktische Informationen, einschließlich der aktuellen Anteilspreise, können ebenfalls von diesen Quellen bezogen werden.

■ Angaben zur Vergütungspolitik, einschließlich einer Beschreibung wie die Vergütung und Sachbezüge berechnet werden, ebenso wie die für die Vergabe verantwortlichen Personen (einschließlich der Zusammensetzung des Vergütungsausschusses) finden sich unter [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com). Ein Papierexemplar ist auf Anfrage kostenlos erhältlich.

■ Die Steuergesetzgebung in Luxemburg könnte sich auf Ihre persönliche Steuerposition auswirken.

■ Threadneedle Management Luxembourg S.A. kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des OGAW-Prospekts vereinbar ist.

■ Dieses Dokument beschreibt einen einzelnen Fonds der SICAV. Der Prospekt sowie die Berichte werden für die gesamte SICAV erstellt.

■ Die Vermögenswerte der Fonds sind rechtlich voneinander getrennt und können nicht zur Begleichung von Schulden anderer Fonds der SICAV verwendet werden.

■ Sie können – wenn verfügbar – Ihre Anteile in Anteile anderer Fonds der SICAV umtauschen. Einzelheiten dazu finden sich im Abschnitt des Prospekts mit der Überschrift „Umtauschrecht“. Einzelheiten zu den anderen Anteilsklassen des Fonds sind im Prospekt oder auf [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com) ersichtlich.

Dieser Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) reguliert. Die Threadneedle Management Luxembourg S.A. ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die CSSF reguliert.