

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 des Produkts: DoubleLine Funds (Luxembourg) – DoubleLine Shiller Enhanced CAPE Klasse I Dis

PRIP-Hersteller: FundRock Management Company S.A.

ISIN: LU2168289333

Website: www.fundrock.com

Weitere Informationen erhalten Sie telefonisch unter +352 27 111 1.

Die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ist für die Aufsicht von FundRock Management Company S.A. in Bezug auf dieses Basisinformationsblatt zuständig.

FundRock Management Company S.A. ist in Luxemburg zugelassen und wird von der Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert.

Dieses Basisinformationsblatt ist zutreffend und entspricht dem Stand vom 31. Januar 2024.

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art

DoubleLine Funds (Luxembourg) ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („Société d'Investissement à Capital Variable“, SICAV), eine Aktiengesellschaft, bestehend aus mehreren gemäß Teil 1 des Gesetzes von 2010 zugelassenen Teilfonds, die die Voraussetzungen eines OGAW erfüllt und nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtet wurde.

Laufzeit

Der Teilfonds hat kein Fälligkeitsdatum.

Der PRIIP-Hersteller kann den Teilfonds nicht einseitig auflösen.

Der Teilfonds kann nicht automatisch aufgelöst werden.

Ziele

Erzielung einer Kombination von laufenden Erträgen und Anlagewachstum (Gesamtrendite). Der Teilfonds strebt insbesondere eine bessere Wertentwicklung als der S&P 500 Index an, indem er ein Engagement im Shiller Barclays CAPE® US Sector II ER USD Index (der „Index“), einem Index, der Sektoren des US-Aktienmarktes auswählt, die unterbewertet zu sein scheinen, sowie in Schuldtiteln eingeht. Unter normalen Umständen wird das Aktienengagement des Teilfonds entweder durch den Einsatz von Derivaten (z. B. Swaps), die auf dem Index basieren, oder durch direkte Anlagen in die Indexbestandteile erreicht. Der maximale Anteil des verwalteten Vermögens des Teilfonds, der Gegenstand von Total Return Swaps sein kann, beträgt 100 %. Neben dem Engagement in Aktien kann der Teilfonds in eine breite Palette von Staats- und Unternehmensanleihen aus der ganzen Welt, einschließlich der Schwellenländer, investieren. Er kann auch bis zu 100 % seines Vermögens in forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS) und hypotheckenbesicherte Wertpapiere (MBS) investieren. Der Teilfonds setzt eine Hebelwirkung ein, um sowohl die Indexrendite als auch die Rendite eines Portfolios von Schuldtiteln zu erzielen. Der Teilfonds strebt eine effektive Duration (ein Maßstab für die Zinssensitivität) von 1 bis 3 Jahren an (ohne diesbezüglich eine Garantie zu bieten).

Zusätzlich zu der vorstehenden Nutzung kann der Teilfonds Derivate auch zu Hedging-Zwecken (Risikominderung) und zur Erzielung von Anlagegewinnen einsetzen.

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet. Der S&P 500 Index und der Shiller Barclays CAPE® US Sector II TR USD Index werden zu Vergleichszwecken verwendet. Ein Engagement in den Komponenten des S&P 500 Index wird durch ein Engagement in

den Bestandteilen des Index erreicht, der zu Anlagezwecken verwendet wird, wie im Prospekt angegeben.

Bei diesen Anteilen handelt es sich um ausschüttende Anteile (d. h. alle erwirtschafteten Erträge werden an die Anleger ausgeschüttet).

Sie können Fondsanteile in der Regel an jedem Bankgeschäftstag in Luxemburg und an der New York Stock Exchange (NYSE) kaufen oder verkaufen.

Kleinanleger-Zielgruppe

Der Teilfonds eignet sich für gut informierte Anleger, die eine Gesamtrendite durch US-Aktien und Schuldtitel anstreben und einen mittel- bis langfristigen Anlagehorizont von mindestens 3 Jahren haben. Der Teilfonds weist spezifische und allgemeine Risiken mit einer Risikobewertung gemäß der SRI-Nummer auf, die alle im Verkaufsprospekt aufgeführt sind.

Verwahrstelle Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

Weitere Informationen Dieses Basisinformationsblatt wurde für eine Anteilsklasse erstellt. Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eines jeden Teilfonds der DoubleLine Funds (Luxembourg), SICAV sind voneinander getrennt, sodass Ihre Anlage in diesem Teilfonds nur von den Gewinnen und Verlusten dieses Teilfonds beeinflusst wird. Für diesen Teilfonds gibt es weitere Anteilsklassen. Sie können Ihre Anlage in Anteilen dieses Teilfonds gegen eine Anlage in Anteilen eines anderen Teilfonds der DoubleLine Funds (Luxembourg), SICAV umtauschen. Der Prospekt, die Berichte und Abschlüsse, die aktuellen Anteilspreise sowie weitere Informationen über den Teilfonds sind kostenlos bei Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. erhältlich: 80 Route d'Esch, L-1470 Luxembourg Tel.: +352 47 4066 7102 Fax: +352 47 40 66 401 – E-Mail: doubleline.ta@bbh.com. Der Prospekt und die Berichte für Anteilinhaber sind in englischer Sprache erhältlich.

Weitere Informationen über die Anlagepolitik der Gesellschaft Die Arten von Vermögenswerten, in die die Gesellschaft investieren kann, die Märkte, an denen sie investiert, die Kreditaufnahmesbeschränkungen sowie Einzelheiten zu den Management-, Verwaltungs- und Verwahrstellenvereinbarungen sind im Jahresbericht der Gesellschaft auf der Website der Gesellschaft zu finden: www.doublelineucits.com. Druckexemplare dieser Dokumente sind auf Anfrage kostenlos über die oben genannten Kontaktdaten erhältlich.

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

Risikoindikator





Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 3 Jahre halten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig einlösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück.

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 wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 5 eingestuft, was einer mittelhohen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelhoch eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es wahrscheinlich, dass die Fähigkeit des PRIIP-Herstellers beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen.

Wenn die Produktwährung von Ihrer Anlagewährung abweicht, gilt Folgendes: Bitte beachten Sie das Währungsrisiko. Sie erhalten Zahlungen in einer anderen Währung, sodass Ihre endgültige Rendite vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen wird. Dieses Risiko ist bei dem oben angegebenen Indikator nicht berücksichtigt.

Zu den weiteren Risiken, die nicht vom Risikoindikator erfasst werden, gehören Kontrahentenrisiko, Kreditrisiko, Ausfallrisiko, Derivaterisiko, Schwellenmarktrisiko, das Risiko festverzinslicher Wertpapiere, Zinsrisiko, Liquiditätsrisiko, Verwaltungsrisiko, operationales Risiko, ABS-/MBS-Risiko sowie das Risiko in Verbindung mit einer Anlage in Wertpapieren „unter Investment Grade“. Weitere Informationen zu Risiken finden Sie im Fondsprospekt, der unter www.doublelineucits.com oder auf Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich ist.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

Wenn DoubleLine Funds (Luxembourg) Ihnen den geschuldeten Betrag nicht zahlen kann, könnten Sie Ihre gesamte Anlage verlieren.

Performance-Szenarien

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, sowie die Kosten Ihres Beraters oder Ihrer Vertriebsstelle. Unberücksichtigt ist Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann.

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 und einer geeigneten Benchmark in den letzten 10 Jahren. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln.

Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten.

Das pessimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen April 2021 und Dezember 2022.

Das mittlere Szenario ergab sich bei einer Anlage in die Benchmark zwischen November 2014 und November 2017.

Das optimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage in die Benchmark zwischen September 2015 und September 2018.

Empfohlene Haltedauer: 3 Jahre.

Anlagebeispiel: USD 10.000.

Szenarien		Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 3 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	810 USD	1.610 USD
	Jährliche Durchschnittsrendite	-91,91 %	-45,57 %
Pessimistisches Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	6.670 USD	7.220 USD
	Jährliche Durchschnittsrendite	-33,33 %	-10,27 %
Mittleres Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	10.880 USD	13.920 USD
	Jährliche Durchschnittsrendite	8,85 %	11,65 %
Optimistisches Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	16.330 USD	17.030 USD
	Jährliche Durchschnittsrendite	63,29 %	19,41 %

Was geschieht, wenn FundRock Management Company S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Die Verwaltungsgesellschaft ist für die Verwaltung und das Management des Teilfonds verantwortlich und hält in der Regel keine Vermögenswerte des Teilfonds (Vermögenswerte, die von einer Verwahrstelle gehalten werden können, werden im Einklang mit den geltenden Vorschriften bei einer Verwahrstelle in deren Verwahrungsnetz gehalten). Die Verwaltungsgesellschaft ist als Hersteller dieses Produkts nicht zur Auszahlung verpflichtet, da die Struktur des Produkts keine solche Auszahlung vorsieht. Die Anleger können jedoch Verluste erleiden, wenn der Teilfonds oder die Verwahrstelle nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen. Es gibt keine Entschädigungs- oder Garantieregelung, die diesen Verlust ganz oder teilweise ausgleichen könnte.

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.

— 10.000 USD werden angelegt.

	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen 97 USD	Wenn Sie nach 3 Jahren aussteigen 409 USD
Kosten insgesamt		
Jährliche Auswirkungen der Kosten (*)	1,0%	1,1% pro Jahr

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 12,7 % vor Kosten und 11,7 % nach Kosten betragen.

Wir können einen Teil der Kosten zwischen uns und der Person aufteilen, die Ihnen das Produkt verkauft, um die für Sie erbrachten Dienstleistungen zu decken.

Zusammensetzung der Kosten

Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg		Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen
Einstiegskosten	Wir berechnen keine Einstiegsgebühr	0 USD
Ausstiegskosten	Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt.	0 USD
Laufende Kosten pro Jahr		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	Die laufenden Kosten basieren auf den geschätzten Aufwendungen, die dem Teilfonds im Verlauf seiner Geschäftstätigkeit in Rechnung gestellt werden. Sie können von Jahr zu Jahr schwanken.	55 USD
Transaktionskosten	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.	42 USD
Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen		
Erfolgsgebühren	Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet	0 USD

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

Empfohlene Haltedauer: 3 Jahre

Aufgrund der Anlagepolitik und des Risikoprofils des Teilfonds beträgt die empfohlene Haltedauer 3 Jahre. Dieses Produkt ist für mittelfristige Anlagen gedacht. Sie sollten bereit sein, mindestens 3 Jahre lang investiert zu bleiben. Sie können Ihre Anlage während dieses Zeitraums jedoch jederzeit ohne Vertragsstrafe zurückgeben oder die Anlage länger halten. Rücknahmen sind an jedem Tag möglich, der ein Bankgeschäftstag in Luxemburg und an der New York Stock Exchange (NYSE) ist. Es wird 2 Geschäftstage dauern, bis Sie Ihr Geld erhalten. Der Tagespreis, der den tatsächlichen Wert des Fonds widerspiegelt, wird auf unserer Website www.doublelineucits.com veröffentlicht.

Wie kann ich mich beschweren?

Beschwerden über das Verhalten der Person, die Sie zu dem Produkt beraten oder es Ihnen verkauft hat, sollten direkt an diese Person gerichtet werden. Beschwerden über das Produkt oder das Verhalten des Herstellers dieses Produkts sind an die folgende Adresse zu richten:

Postanschrift: FundRock Management Company S.A., 33 Rue de Gasperich, 5826 Hesperange, Luxemburg.

E-Mail: FRMC_qualitycare@fundrock.com

Website: <https://www.fundrock.com/policies-and-compliance/frd-complaints-handling-policy/>

In jedem Fall muss der Beschwerdeführer seine Kontaktdaten (Name, Anschrift, Telefonnummer oder E-Mail-Adresse) deutlich angeben und eine kurze Erläuterung der Beschwerde liefern.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Informationen über die frühere Wertentwicklung in den letzten drei Jahren und zu früheren Performance-Szenarien der Anteilsklasse sind verfügbar unter: <https://www.doublelineucits.com/documents/prospectuses/>

Die in diesem Basisinformationsblatt enthaltenen Kosten-, Performance- und Risikoberechnungen befolgen die durch EU-Bestimmungen vorgeschriebene Methodik. Bitte beachten Sie, dass die oben berechneten Performance-Szenarien ausschließlich von der vergangenen Wertentwicklung des Produkts oder einer geeigneten Benchmark abgeleitet sind und dass die frühere Wertentwicklung keinen Hinweis auf zukünftige Renditen bietet. Daher kann Ihre Anlage einem Risiko ausgesetzt sein und Sie erhalten möglicherweise nicht die dargestellten Renditen zurück. Anleger sollten ihre Anlageentscheidungen nicht allein auf die dargestellten Szenarien stützen.