

Dirigido exclusivamente a inversores profesionales.
Esta es una comunicación de marketing. Consulte el folleto del OICVM y el documento de datos fundamentales para el inversor (KIID) o el documento de datos fundamentales (KID) antes de tomar cualquier decisión de inversión.

ETFs activos de la serie CT QR

¿Qué significa ser realmente activo?

Quant Redefined (inversión cuantitativa redefinida)

**Carteras de ETF realmente activas
gestionadas con propósito y convicción**

La gestión activa de activos es la esencia de lo que hacemos en Columbia Threadneedle Investments. Al aplicar este legado y esta experiencia a los ETF activos, nuestra gama de ETF activos de la serie CT QR ofrece una forma accesible de incorporar exposiciones a renta variable activa en cualquier cartera.

Invertir con una fuerte convicción

Nuestro enfoque basado en modelos cuantitativos y bien fundamentado significa que nos centramos en acciones con el potencial de ofrecer las oportunidades de rendimiento más prometedoras.

Estrategia probada y repetible

El modelo cuantitativo se ha personalizado, probado y perfeccionado durante más de 20 años. Mejoramos los resultados con el análisis fundamental de nuestro equipo de análisis global para contribuir a minimizar el riesgo de corrección a la baja.

Rentabilidades ajustadas al riesgo, mejores que las del índice de referencia

La metodología de selección de valores aumenta su potencial de generación de alfa. Sigue el enfoque basado en reglas que hemos estado implementando y mejorando para nuestros exitosos ETF estadounidenses durante más de 6 años.

Transparentes y eficientes en costes

Las participaciones y la composición de los fondos se divulgan íntegramente todos los días. Gestionamos las participaciones con la intención de reducir los costes y mantener la flexibilidad para poder adaptarnos, cambiar de rumbo y evolucionar.

La gama en pocas palabras

4 ETFs activos de renta variable

Global, EE. UU., europeo y mercados emergentes

30–40%

Exposición activa

2–4%

Error de seguimiento

Artículo 8*

3 cotizaciones en bolsa

Xetra, LSE**, SIX**

20–30 pb

OCF

Cuartil superior

Ratio de información a más de 5 años***

* El fondo promueve las características ambientales o sociales en consonancia con el artículo 8 del Reglamento de la UE 2019/2088 sobre la información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR). Antes de invertir, los inversores también deben tener en cuenta todas las características y objetivos del fondo promocionado que se describen en su folleto. Toda la información sobre la sostenibilidad del fondo puede encontrarse en nuestro sitio web columbiathreadneedle.com.

** La fecha de cotización está pendiente de confirmación.

*** El ratio de información hace referencia a un historial en tiempo real de nuestro ETF domiciliado en EE. UU. que implementa una estrategia de inversión similar. Fuente: Morningstar, Columbia Threadneedle, 30 de abril de 2025

Un proceso personalizado diseñado para impulsar la generación de alfa

Nuestros ETFs de renta variable invierten en valores para los que albergamos una fuerte convicción en el contexto de un enfoque de cartera diversificada. Lo conseguimos excluyendo las acciones que prevemos que pueden tener una rentabilidad inferior.

La estrategia en su conjunto saca partido de las décadas de especialización cuantitativa y las capacidades de análisis global de Columbia Threadneedle para aumentar el potencial de rentabilidades ajustadas al riesgo, que sean superiores a las del índice de referencia.

Se trata de un enfoque dinámico, propio y rentable que ha demostrado generar una rentabilidad superior en el mercado de renta variable estadounidense y en toda la renta variable europea, de los mercados emergentes y de valores de renta variable mundiales, tal como demuestran nuestras simulaciones.



La colaboración de nuestros expertos en análisis cuantitativo y fundamental nos ayuda enormemente a obtener una ventaja activa para impulsar la generación de alfa.

Chris Lo, Director de Análisis
Renta variable mejorada

A large background image on the right side of the page. It shows a diver in silhouette swimming through a massive, dense school of fish in clear blue water. The fish are silvery and catch the light, creating a shimmering effect. The diver is positioned in the lower left of this section, looking towards the school of fish. The image is split diagonally by a white line that separates the main text area from the numbered steps.

1

Análisis

Analizar y calificar el universo

Mediante un modelo cuantitativo personalizado y probado, y con perspectivas fundamentales complementarias, analizamos y calificamos el universo de inversión para identificar las acciones con potencial para alcanzar una rentabilidad superior.

2

Clasificación

Incluir solamente las acciones con una mejor rentabilidad

Basándonos en estas calificaciones combinadas, clasificamos las acciones «desde compra fuerte hasta venta fuerte». Excluimos aquellas que se espera que tengan un rendimiento inferior para reducir el universo en hasta dos tercios, incluidos solamente los valores sobre los que tenemos una fuerte convicción y los que se ajustan a lo estipulado en el artículo 8.

3

Recalibración

Supervisar y reequilibrar

Reequilibramos la cartera cada seis meses con los sectores, regiones y países armonizados con los índices de referencia. Las participaciones se revisan a diario para minimizar cualquier riesgo bajista.

Modelos cuantitativos multicapa personalizados

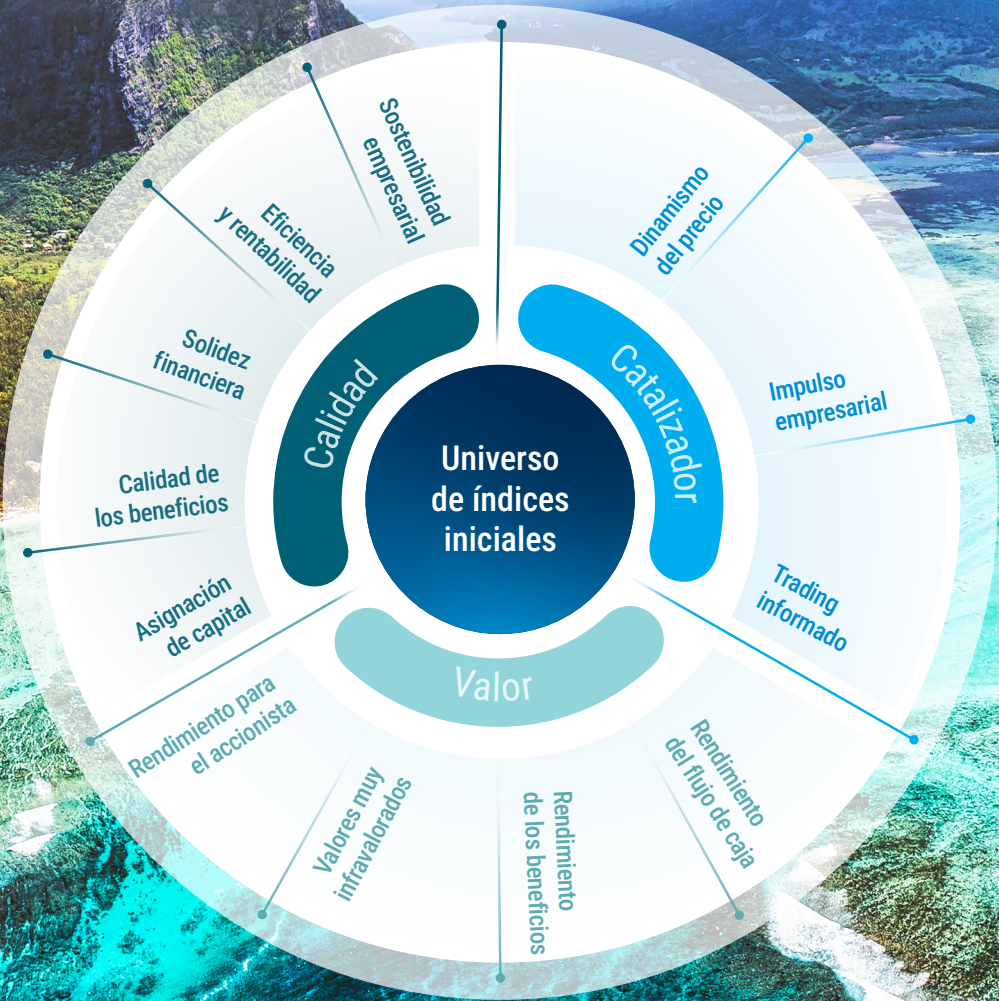
Nuestros modelos basados en los fundamentales optimizan la selección de valores al clasificar las acciones en función de los parámetros más relevantes para su sector o industria específicos.

Las comparaciones entre pares se focalizan en tres temas principales ponderados para reflejar los factores de rentabilidad en cada sector:

- **Calidad**
- **Catalizador**
- **Valor**

Los subtemas específicos del sector y los múltiples criterios granulares proporcionan conocimientos adicionales y especificidad a los criterios de clasificación.

Este enfoque personalizado de selección de valores nos aporta más confianza en los valores de renta variable que tienden a generar la mejor rentabilidad ajustada al riesgo.



ETFs centrados en las oportunidades más prometedoras

Nuestro proceso de selección basado en modelos cuantitativos nos permite restringir el universo de inversión a las acciones que pensamos que generarán la mejor rentabilidad ajustada al riesgo.

Al conservar un subconjunto de valores (a veces prescindiendo de hasta dos tercios de las acciones del índice subyacente), nos ceñimos a aquellos con el potencial de brindar las oportunidades de rentabilidad más alentadoras.

El análisis fundamental de nuestro equipo de análisis central refuerza aún más nuestra convicción y contribuye a controlar los riesgos de corrección a la baja.

Reequilibramos la cartera cada seis meses para optimizar la rentabilidad y minimizar los costes de transacción. También revisamos las carteras a diario para asegurar que los sectores, las regiones y los países sigan estando vinculados al índice.



Convicción en las acciones

Análisis

Combinar análisis cuantitativo y fundamental personalizado para analizar y calificar todas las acciones que hay en el universo.

Clasificación

Utiliza las calificaciones para clasificar el universo, eliminando todas las acciones que prevemos que tendrán una rentabilidad inferior, y manteniendo solamente aquellas para las que tenemos una fuerte convicción y que están en consonancia con el artículo 8.

ETF activo de la serie QR

Recalibración

Reequilibrio semestral con reconocimiento de los índices de referencia y supervisión continua para eliminar las acciones devaluadas.



Pericia, experiencia y escala

Modelo cuantitativo de eficacia probada

Hemos validado y perfeccionado el modelo subyacente durante más de 20 años. Continúa evolucionando de la mano de los equipos de investigación, los avances en la obtención de datos y las publicaciones académicas.

Capacidad de análisis global

Nuestros gestores de fondos colaboran con nuestro equipo de análisis fundamental para recabar información, corroborar las tesis de inversión y comprender los riesgos potenciales de corrección a la baja.

Sólida trayectoria

Los gestores de fondos gestionan más de 16 000 millones de dólares en estrategias domiciliadas en EE. UU. y tienen 44 años de experiencia combinada en el sector.

Fuente: Columbia Threadneedle Investments.
Información a 30 de septiembre de 2025.

29 000 millones de dólares

en estrategias de renta
variable existentes,
gestionadas con el
modelo cuantitativo

6

analistas cuantitativos

124

analistas
de investigación
fundamental

Más de 20

años de validación y
optimización del modelo

Conoce a los
gestores



Christopher Lo, CFA
Director de Análisis, Renta
Variable Mejorada

Gestiona la gama de fondos ETF de Columbia Threadneedle, entre los que cabe incluir el altamente eficiente ETF Columbia Research Enhanced Core.



Henry Hom
Gestor de Carteras Sénior, Renta
Variable Mejorada con investigación

Responsable de la gestión de la gama de fondos ETF de Columbia Threadneedle Investment. También realiza análisis sobre estrategias futuras de renta variable.

Motivos para invertir

- **Una forma avanzada y asequible** de incorporar en su cartera exposiciones a la renta variable.
- **Un modelo cuantitativo verdaderamente diferenciado** ayuda a generar alfa mediante un cuidadoso análisis ascendente ('bottom-up').
- **Un equipo experimentado** con una trayectoria contrastada en tiempo real para tener mayor seguridad.
- **Recalibración periódica** para minimizar los riesgos bajistas
- **Un enfoque transparente y determinado por convicciones** tanto respecto a la estrategia general como respecto a las participaciones individuales

Firme convicción,
capacidad de inversión
demostrada y un enfoque
realmente activo.

ETF activos de la serie QR
Quant Redefined

Riesgos a tener en cuenta:

Riesgo de inversión: el valor de las inversiones puede tanto bajar como aumentar, y los inversores podrían no recuperar el importe invertido originalmente.

Riesgo de fluctuación de cambio: cuando las inversiones se realizan en activos denominados en múltiples divisas, o en divisas distintas de la tuya, las variaciones de los tipos de cambio pueden afectar al valor de las inversiones.

Criterios de inversión de ASG: los fondos aplican una serie de medidas en el marco de su valoración de los factores de ASG, incluida la exclusión de inversiones relacionadas con ciertos sectores o actividades. Esto reduce el universo de inversión y puede repercutir positiva o negativamente en la rentabilidad de los fondos con respecto a un índice de referencia, o de otros fondos sin dichas restricciones.

Riesgo de alta volatilidad: los fondos pueden conllevar un riesgo de alta volatilidad debido a la composición de su cartera o a las técnicas de gestión de carteras empleadas. Esto implica que el valor de los fondos puede subir o bajar con mayor frecuencia, y que estas fluctuaciones podrían ser más acentuadas que en otros fondos.

Riesgo político y financiero: los fondos pueden invertir en mercados en los que el riesgo económico y regulatorio puede ser notable. Estos factores pueden afectar a la liquidez, las condiciones de liquidación y al valor de los activos. Cualquiera de estos acontecimientos puede tener un efecto negativo en el valor de tu inversión.

Riesgo de liquidez: los fondos mantienen activos que podrían resultar difíciles de vender. Los fondos podrían tener que reducir el precio de venta, vender otras inversiones o renunciar a oportunidades de inversión más atractivas.

China-Hong Kong Stock Connect: los fondos pueden invertir por medio de los programas del China-Hong Kong Stock Connect, que tienen restricciones operativas significativas, como los límites de cuotas, y están sujetos a cambios regulatorios y a un mayor riesgo de contraparte.

Descubre nuestro enfoque avanzado columbiathreadneedle.es



INFORMACIÓN IMPORTANTE. DIRIGIDO EXCLUSIVAMENTE A INVERSORES PROFESIONALES. Con fines de marketing. Su capital se encuentra sujeto a riesgos.

El Fondo es un subfondo de Columbia Threadneedle (Irl) ICAV, un vehículo de gestión de activos colectivo irlandés, abierto con capital variable (ICVC), registrado en Irlanda y autorizado por el Banco Central como esquema de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM).

Este material no debe interpretarse como una oferta, invitación, asesoramiento o recomendación de inversión. Esta comunicación es válida en la fecha de publicación y puede estar sujeta a cambios sin previo aviso. La información obtenida de fuentes externas se considera fiable, si bien no puede garantizarse su precisión o integridad.

El folleto actual, el KIID (Documento de información clave para el inversor)/KID (Documento de información clave) y el resumen de los derechos de los inversores están disponibles en inglés en la Sociedad gestora, Threadneedle Management Luxembourg S.A., State Street Fund Services (Ireland) Limited, en su asesor financiero, en nuestro sitio web www.columbiathreadneedle.com y por correo electrónico a la dirección clientsupport@columbiathreadneedle.com;

Se ruega leer el Folleto antes de adoptar cualesquiera decisiones de inversión. Threadneedle Management Luxembourg S. A. podrá decidir la rescisión de los acuerdos adoptados para la comercialización del ICAV.

En España, Columbia Threadneedle (Irl) plc está registrada en la CNMV con el n.º 2357. El Fondo es un organismo de inversión colectiva no español debidamente registrado ante la CNMV para su comercialización en España.

En el EEE: publicado por Threadneedle Management Luxembourg S.A., sociedad inscrita en el Registre de Commerce et des Sociétés (Registro Mercantil de Luxemburgo) con el n.º B 110242, 6E route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Gran Ducado de Luxemburgo.

Columbia Threadneedle Investments es la marca global del grupo de sociedades Columbia y Threadneedle.

© 2025 Columbia Threadneedle. Todos los derechos reservados.