

Ad uso esclusivo degli investitori professionali.
Questa è una comunicazione di marketing. Prima di prendere qualsiasi decisione finale di investimento, si prega di consultare il prospetto dell'OICVM e il KIID/KID.

CT QR Series Active ETFs

Cosa significa essere veramente attivi

Una nuova definizione di Quant

Portafogli ETF realmente attivi gestiti con una strategia consapevole e determinata

La gestione attiva è il fulcro della nostra attività in Columbia Threadneedle Investments. Applicando questa esperienza e competenza agli ETF attivi, la nostra gamma di ETF attivi CT QR Series rappresenta un modo efficace per aggiungere esposizioni azionarie attive core a qualsiasi portafoglio.

Investire con determinazione

Il nostro approccio basato sull'analisi quantitativa e fondamentale consente di concentrarci sui titoli con il potenziale di rendimento migliore.

Strategia collaudata e replicabile

Il modello quantitativo è stato personalizzato, collaudato e sviluppato nell'arco di 20 anni. Miglioriamo i risultati con l'analisi fondamentale del nostro team di ricerca globale, contribuendo a ridurre il rischio di ribasso.

Generare rendimenti corretti per il rischio superiori al benchmark

La metodologia di selezione dei titoli aumenta il potenziale di generare alpha e segue l'approccio basato su regole che stiamo implementando e perfezionando con successo da oltre 6 anni nei nostri ETF statunitensi.

Trasparente e vantaggioso

Le partecipazioni e la composizione dei fondi vengono divulgate quotidianamente. Gestiamo le posizioni in modo mirato per contenere i costi e preservare la flessibilità operativa necessaria per adattare ed evolvere le nostre attività.

La gamma in sintesi

4 ETF azionari attivi

Globale, Stati Uniti, Europa e Mercati Emergenti

30-40%

Quota attiva

2-4%

Tracking error

Articolo 8*

3 Borse di quotazione

Xetra, LSE**, SIX**

20-30 bps

OCF

Quartile superiore

Information ratio su 5 anni***

* Il fondo promuove le caratteristiche ambientali o sociali ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento (UE) 2019/2088 sull'informativa relativa alla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR). La decisione di investire nel fondo promosso dovrebbe altresì tenere conto di tutte le caratteristiche o degli obiettivi del fondo stesso, come descritti nel prospetto. Le informazioni relative alla sostenibilità del fondo sono disponibili sul nostro sito web columbiathreadneedle.com.

** Data di quotazione da confermare.

*** L'information ratio fa riferimento a un track record del nostro ETF domiciliato negli Stati Uniti, che adotta una strategia di investimento simile. Fonte: Morningstar, Columbia Threadneedle, 30.04.25

Un processo personalizzato progettato per generare alpha.

I nostri ETF azionari attivi investono in titoli in cui crediamo fortemente, mantenendo nel contempo un approccio di portafoglio diversificato. Questo obiettivo è raggiunto escludendo i titoli che ci aspettiamo siano destinati a sottoperformare.

L'intera strategia si avvale dell'esperienza decennale nell'analisi quantitativa e della capacità di ricerca e analisi globale di Columbia Threadneedle per aumentare il potenziale di ottenere rendimenti superiori al benchmark corretti per il rischio.

Si tratta di un approccio dinamico, proprietario ed economicamente efficiente, che ha dimostrato, attraverso i nostri test di simulazione, di generare una sovraperformance nei mercati azionari statunitensi, europei, emergenti e globali.



La collaborazione tra la nostra competenza quantitativa e la ricerca fondamentale ci consente di ottenere un vantaggio attivo per generare alpha.

Chris Lo, Responsabile della ricerca azionaria evoluta



1

Ricerca

Analizzare e valutare l'universo investibile

Con un modello quantitativo collaudato e personalizzato e approfondimenti fondamentali complementari, analizziamo e valutiamo l'universo investibile per identificare i titoli con il più alto potenziale di sovraperformance.

2

Classifica

Include solo i titoli con le migliori performance

Sfruttando queste valutazioni combinate, classifichiamo i titoli da "forte acquisto" a "forte vendita". Escludiamo i titoli che riteniamo destinati a sottoperformare riducendo l'universo investibile fino a due terzi e includendo solo i titoli in cui crediamo fortemente e che risultano conformi all'Articolo 8.

3

Ricalibrazione

Monitoraggio e ribilanciamento

Ribilanciamo il portafoglio ogni sei mesi assicurando che settori, regioni e paesi siano allineati al benchmark. Riesaminiamo quotidianamente le partecipazioni per minimizzare potenziali rischi di ribasso.

Modelli quantitativi multi-livello e personalizzati

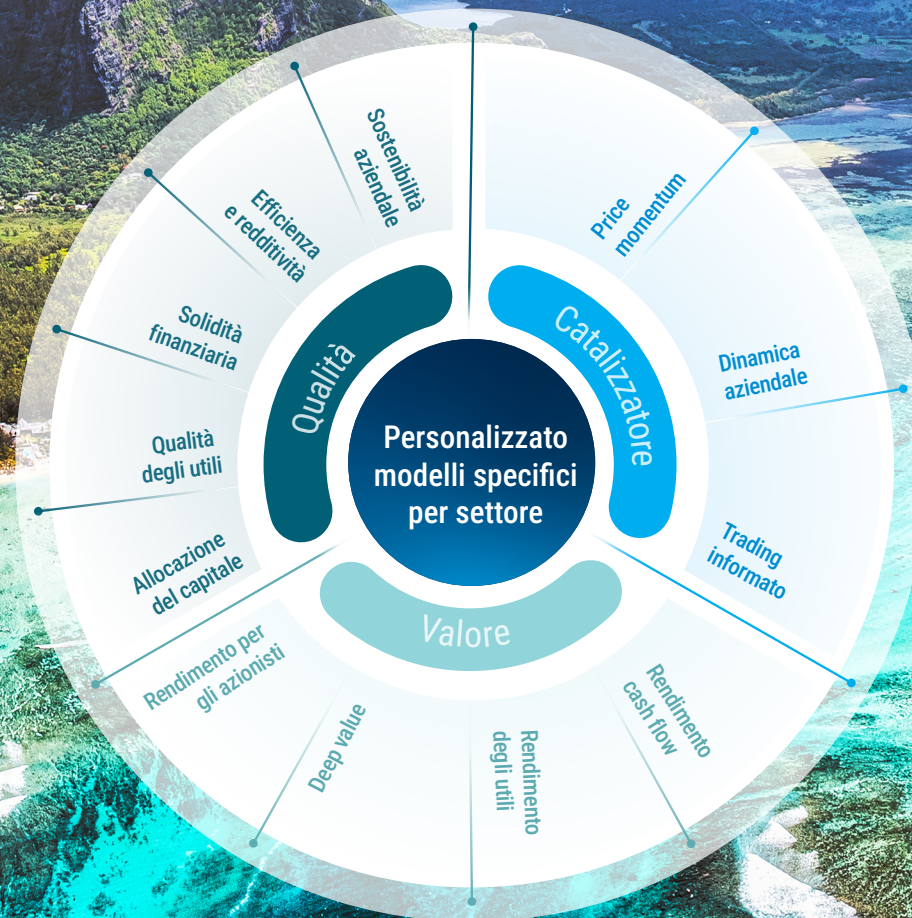
I nostri modelli basati sui fondamentali migliorano la selezione dei titoli classificandoli in base alle metriche più rilevanti per il loro specifico settore o industria.

I confronti tra pari si concentrano su tre temi principali, ponderati in modo da riflettere i driver di rendimento in ciascun settore:

- Qualità
- Catalizzatore
- Valore

Sottotemi settoriali e molteplici criteri granulari arricchiscono e affinano i criteri di classificazione.

L'approccio personalizzato alla selezione dei titoli rafforza la nostra convinzione nella capacità di individuare le azioni con il maggiore potenziale di generare performance superiori corrette per il rischio.



ETF concentrati sulle opportunità più promettenti

Il nostro processo di selezione su base quantitativa ci consente di limitare l'universo investibile ai titoli che riteniamo possano generare la migliore performance corretta per il rischio.

Detenendo un sottoinsieme di titoli, a volte eliminando fino a 2/3 dei titoli nell'indice sottostante, ci concentriamo su quelli con il potenziale di rendimento più promettente.

L'analisi fondamentale condotta dal nostro team di ricerca centrale rafforza ulteriormente le nostre convinzioni e contribuisce a controllare i rischi di ribasso.

Ribilanciamo il portafoglio ogni sei mesi per ottimizzare la performance e minimizzare i costi di transazione. Esaminiamo inoltre i portafogli quotidianamente per garantire che settori, regioni e paesi rimangano allineati all'indice.

Convinzione sul titolo

Gamma QR ETF attivo

Universe
iniziale
dell'indice

1.000
azioni

Ricerca

Combiniamo ricerca quantitativa e fondamentale personalizzata per analizzare e valutare tutti i titoli dell'universo investibile.

Classifica

Utilizza i rating per classificare l'universo, escludendo tutti i titoli che riteniamo destinati a sottoperformare e includendo solo quelli verso cui nutriamo forte convinzione e che risultano conformi all'Articolo 8.

Ricalibrazione

Ribilanciamento semestrale con allineamento al benchmark e monitoraggio continuo per escludere i titoli declassati.

350
titoli

Una combinazione di competenza, esperienza e scalabilità

Modello quantitativo collaudato

Il modello sottostante, convalidato e perfezionato nel corso di oltre 20 anni, continua a evolversi grazie alla collaborazione con i team di ricerca, ai progressi nell'estrazione dei dati e al contributo della letteratura accademica.

Capacità di ricerca globale

I nostri gestori collaborano con il nostro team di ricerca fondamentale per ottenere informazioni, verificare le tesi di investimento e comprendere i potenziali rischi di ribasso.

Solido track record

I gestori del fondo amministrano oltre 16 miliardi di dollari in strategie domiciliate negli Stati Uniti e vantano complessivamente 44 anni di esperienza nel settore.

Fonte: Columbia Threadneedle Investments. Informazioni al 30 settembre 2025.

29 miliardi di dollari

delle strategie azionarie esistenti gestite con il modello quantitativo

6

analisti quantitativi

124

analisti di ricerca fondamentale

20+

anni di validazione e perfezionamento del modello

Conosci i gestori del fondo



Christopher Lo, CFA
Responsabile della ricerca azionaria evoluta

Gestisce la gamma di ETF di Columbia Threadneedle, incluso il Columbia Research Enhanced Core ETF, uno dei prodotti di maggior successo.



Henry Hom
Gestore Senior di portafoglio – Strategie azionarie evolute

Responsabile della gestione della gamma di ETF di Columbia Threadneedle Investment. Responsabile della conduzione delle ricerche sulle strategie azionarie future.

Motivi per investire

- **Un modo avanzato ed economico** per aggiungere le esposizioni azionarie core al portafoglio
- **Un modello quantitativo veramente differenziato** contribuisce alla generazione di alpha attraverso un'attenta analisi bottom-up
- **Un team esperto** con una comprovata esperienza operativa degna di fiducia
- **Ricalibrazione periodica** per minimizzare i rischi di ribasso
- **Un approccio trasparente e determinato, sia** per la strategia complessiva che per le singole partecipazioni

Forte convinzione, comprovata capacità di investimento e un approccio genuinamente attivo.

Gamma di ETF attivi QR
Una nuova definizione di Quant



Rischi da considerare:

Rischio di investimento - Il valore degli investimenti può aumentare o diminuire e gli investitori potrebbero non recuperare la somma inizialmente investita.

Rischio di cambio - Quando gli investimenti sono in attivi denominati in più valute o in valute diverse dalla propria, le variazioni dei tassi di cambio possono influire sul valore degli investimenti.

Criteri di investimento ESG - I fondi applicano una serie di misure nel contesto della loro considerazione dei fattori ESG, tra cui l'esclusione degli investimenti coinvolti in alcuni settori e/o attività. Ciò riduce l'universo investibile e può avere un impatto positivo o negativo sulla performance dei fondi rispetto a un benchmark o ad altri fondi senza tali restrizioni.

Rischio di elevata volatilità - I fondi possono comportare un rischio di elevata volatilità a causa della composizione del portafoglio o delle tecniche di gestione del portafoglio utilizzate. Ciò significa che il valore dei fondi può aumentare e diminuire più frequentemente e in modo più pronunciato rispetto ad altri fondi.

Rischio politico e finanziario - I fondi possono investire in mercati in cui il rischio economico e normativo può essere significativo. Questi fattori possono influire sulla liquidità, sul regolamento e sui valori degli attivi. Ognuno di questi eventi può avere un effetto negativo sul valore del vostro investimento.

Rischio di liquidità - I fondi detengono attivi che potrebbero rivelarsi difficili da vendere. I fondi potrebbero essere costretti a ridurre il prezzo di vendita, vendere altri investimenti o rinunciare a opportunità di investimento più interessanti.

China-Hong Kong Stock Connect - I fondi possono investire attraverso i programmi China-Hong Kong Stock Connect, che hanno significativi vincoli operativi, tra cui limiti di quote, e sono soggetti a modifiche normative e a un maggiore rischio di controparte.

Scopri il nostro approccio avanzato columbiathreadneedle.it



INFORMAZIONI IMPORTANTI. SOLO PER INVESTITORI PROFESSIONALI. Per scopi di marketing. Il vostro capitale è a rischio.

Il fondo è un comparto di Columbia Threadneedle (Irl) ICAV, un veicolo di gestione collettiva irlandese aperto a capitale variabile (ICVC), registrato in Irlanda e autorizzato dalla Banca Centrale come fondo OICVM.

Questo materiale non deve essere considerato come un'offerta, una sollecitazione, una consulenza o una raccomandazione di investimento. La presente comunicazione è valida alla data di pubblicazione e può essere soggetta a modifiche senza preavviso. Le informazioni provenienti da fonti esterne sono considerate affidabili, ma non vi è alcuna garanzia circa la loro accuratezza o completezza.

Questo Prospetto, il Documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KIID) / il Documento informativo chiave (KID) e la sintesi dei diritti degli investitori sono disponibili in inglese presso The Management Company, Threadneedle Management Luxembourg S.A., State Street Fund Services (Ireland) Limited, dal proprio consulente finanziario, sul nostro sito web www.columbiathreadneedle.com e via e-mail all'indirizzo clientsupport@columbiathreadneedle.com.

Si prega di leggere il Prospetto prima di prendere qualsiasi decisione d'investimento. Threadneedle Management Luxembourg S.A può decidere di porre fine agli accordi presi per la commercializzazione dell'ICAV.

Pubblicato da Threadneedle Management Luxembourg S.A. registrata presso il Registre de Commerce et des Sociétés (Lussemburgo), numero di iscrizione B 110242, 6E route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Granducato del Lussemburgo.

© 2025 Columbia Threadneedle. Tutti i diritti riservati.

CTEA-8522383.1 | WF2897014 (11/25)