

OEIC 香港

聯絡資料

電話: +852 3798 1212\*  
電郵: HK\_Enquiry@columbiathreadneedle.com  
\*請注意, 通話可能會被錄音。

基金經理: James Thorne  
自從: 10年3月  
管理公司: Threadneedle Inv. Services Ltd.  
基金成立之日: 1995年2月28日  
目標基準: Numis Smaller Companies ex Investment Companies  
基金貨幣: 英鎊  
基金註冊地: 英國  
除息日: Semi-annual  
付息日: Semi-annual  
投資組合規模: £159.2m  
證券數量: 65  
投資風格: 本基金目前展現一個相對其基準的增長型風格偏好。這意味著, 本基金投資的大部分公司具有高於平均水平的增長率, 或具有相對其基準的良好增長潛力(按照盈利及銷售額增長等的指標)。基金的投資風格可隨時間過去而改變。

2022年7月4日, 本基金的英文名稱由Threadneedle UK Smaller Companies Fund變更至CT UK Smaller Companies Fund, 中文名稱由天利英國小型公司基金變更至天利小型公司基金。

CT UK SMALLER COMPANIES FUND 零售收入英鎊股份

國際證券識別編號 (ISIN): GB0001530343  
股份類別價格: 3.4058  
歷史收益率: 0.0%  
總費用率 (TER): 1.59% (於 07/03/23)  
業績表現費: 無

歷史收益率反映了過去12個月的派息。派息率反映了未來12個月預期將可能分派的金額。相關收益率反映了除去基金費用的年化收入。所示的息率不包括任何預設的收費及投資者可能須繳交派息的稅項。

基金變動

有關基金的詳情, 請參閱載於 [www.columbiathreadneedle.hk/](http://www.columbiathreadneedle.hk/) 的基金說明書

評級/獎項



有關晨星評級方法的更多資料, 請瀏覽[www.morningstar.com](http://www.morningstar.com)

所有資訊以英鎊表述

資料來源: FactSet 僅供天利使用: T2UKSM

重要事項:

- 天利投資基金－英國小型公司基金(「本基金」)主要投資註冊地於英國或於英國擁有重要業務的較小型公司的股票。
- 本基金可投資於下列可能涉及嵌入式槓桿的一種或多種投資工具: 定息證券、其他證券及貨幣市場證券。投資上述任何一種投資工具可能涉及重大信貸/交易對手、市場、波動性及流動性風險。如發行人違約, 或有關投資工具或其相關資產不能變現或表現欠佳, 投資者可能損失全部投資。
- 本基金著重投資於單一地區, 因此其面臨的集中性風險高於遵循更加多元化投資政策的基金。
- 因為較小型公司的股價波動性更高, 本基金的價值波動可能高於其他基金。
- 投資決策取決於閣下, 惟除非出售本基金的中介人告知本基金適合閣下並說明原因(包括於本基金的投資是否與閣下的投資目標一致), 否則閣下不應進行投資。
- 投資者不應僅依據本文件而作出投資決定, 並須在投資前參考各基金的基金說明書。

投資目標和政策

本基金旨在長期增加您的投資價值。目標是在扣除費用後3年滾動期內, 跑贏紐米斯小型公司(不包括投資公司)指數 (Numis Smaller Companies excluding Investment Companies (ex ICs) Index)。

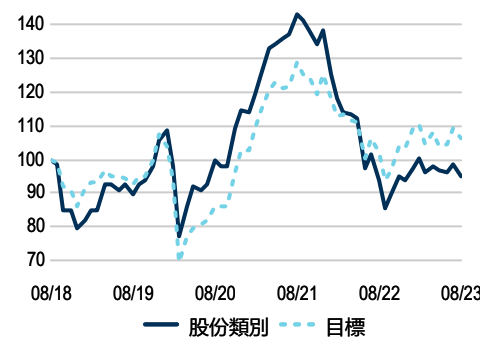
本基金為主動管理, 將至少90%的資產投資於倫敦證券交易所上市公司的股票; 主要是在選擇性投資市場(AIM)交易或納入紐米斯小型公司(不包括投資公司)指數且在英國註冊, 或在英國擁有重大業務的小型公司。

本基金從所有行業或經濟分類中挑選出普遍認為具有良好股價增長前景的公司, 其中小型公司在利基增長領域具有潛力, 而大公司往往無法進入這些領域。

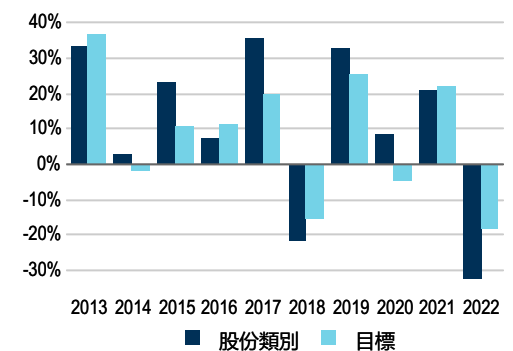
本基金通常投資不到70家公司的股票。本基金也可投資於現金和存款等其他資產, 並且在認為合適的情況下持有其他基金(包括Columbia Threadneedle公司管理的基金)。本基金不可為對沖目的投資衍生工具, 但可為降低風險和更有效地管理本基金而運用衍生工具。衍生工具是與其他資產的價值上升和下降掛鉤的複雜投資工具。

納入紐米斯小型公司(不包括投資公司)指數是廣泛用於監測英國小型公司表現的基準指數。組成公司是在英國主要上市市場市值(不包括投資公司)最小不低於10%的公司。該指數給出了合適的目標基準, 這基準將用作衡量和評估本基金日後的表現。

5年期資產淨值(英鎊)



歷年(英鎊)



表現(%) - 超過一年期的為年率化表現(英鎊)

	一個月	三個月	六個月	年初至今	1年	2年	3年	5年	10年	自成立以來
股份類別(淨值)	-3.3	-2.0	-5.2	1.6	1.3	-18.5	-1.6	-1.0	6.9	--
目標基準(總收入)	-2.6	2.0	-4.0	3.0	4.2	-9.1	7.2	1.2	5.3	--

自成立以來之回報由: 1995年3月1日

表現(%) - 歷年(英鎊)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
股份類別(淨值)	-32.3	20.7	8.2	32.9	-21.3	35.7	7.1	23.3	2.8	33.2
目標基準(總收入)	-17.9	21.9	-4.3	25.2	-15.3	19.5	11.1	10.6	-1.9	36.9

倘若基金以港元/美元以外的貨幣計值, 則投資於港元/美元的投資者將承受匯率波動的風險

過去的表现并不代表將來的表现。表现數據並不計及發行及贖回基金單位所產生的佣金及費用。投資價值及任何收益並無保證, 可能下跌亦可能上升, 且可能受到匯率波動的影響。這意味著投資者可能無法收回所投資的款額。參考指數回報假設股息及資本收益會再投資, 且與基金回報不同, 不會反映費用或開支。參考指數並不受管理, 且無法直接投資。所有回報假設收益會為本地納稅人再投資, 為買入價對買入價表現(這意味著表現並不包括任何首次認購費的影響)。版權所有(C) 2023 Morningstar UK Limited

## 十大主要投資 (%)

證券名稱	比重
IQGeo Group PLC	5.0
ISpatial Plc	4.2
Equals Group Plc	4.0
Kitwave Group PLC	3.9
Microlise Group plc	3.2
FD Technologies PLC	2.9
Oxford Instruments plc	2.5
Senior plc	2.2
Victoria PLC	2.2
Workspace Group PLC	2.1
<b>總計</b>	<b>32.2</b>

## 比重 (%)

行業	基金	指數	差別
資訊科技	24.1	5.2	18.9
金融	17.9	20.4	-2.4
工業	17.6	18.6	-1.0
非必需消費品	13.5	23.4	-9.8
通訊服務	6.0	6.2	-0.2
物料	5.8	8.6	-2.7
必需消費品	5.5	3.8	1.7
健康護理	4.7	1.5	3.2
房地產	4.0	9.0	-5.0
能源	0.5	3.4	-2.9
其他	--	0.0	0.0
現金等價物	0.0	--	0.0
現金	0.3	--	0.3

## 可提供的股份類別

股份類別	類別	貨幣	稅收	持續費用	持續費用日期	首次認購費	最低投資額	成立日期	ISIN	SEDOL	BBID	對沖
零售	收入	英鎊	--	1.59%	07/03/23	5.00%	2,000	28/02/95	GB0001530343	0153034	TDNUKSI LN	無

除避險類股之外，股類貨幣是以基金官方估值點匯率表示的轉換後價格。這是以您選擇的貨幣獲得股類的一種方法，且不會降低您在外幣方面的總體風險。除非第2頁的加權%表中有貨幣跌幅的詳細說明，否則該基金貨幣將表示該基金的最高貨幣風險。

## 風險分析 - 5年

已知數據分析	基金	指數
絕對波動	20.5	20.1
相對波動	1.0	--
跟蹤誤差	7.7	--
夏普指數	0.0	--
信息指數	-0.1	--
貝他	0.9	--
索提諾比率	0.0	--
詹森阿尔法值	-0.7	--
年率化阿爾法	-0.5	--
阿爾法	0.0	--
基金最大跌幅	-39.5	-35.6
R <sup>2</sup>	86.3	--

事後風險的計算是以每月環球收市價的總回報。

每月回報總額自:1999年1月

## 重要資訊

天利(英國)投資基金(「CTIF」)是一家按照傘子型公司構建的開放式投資公司，在英格蘭及威爾斯註冊成立，並於英國作為可轉讓證券集體投資計劃獲英國金融市場行為監管局授權且受其監管。

本文件僅供參考，並不構成購買或出售任何證券或其他金融工具的指令之要約或招攬，也並非提供投資建議或服務。倘若本基金有大量投資流入及流出，成交價可能包括攤薄調整。

詳情刊載在基金說明書。

投資本基金前，投資者應閱讀最新的基金說明書、產品資料概要及最新的年度或中期報告，該等文件可在要求時按適用條款及條件免費提供。投資者應注意基金說明書「風險因素」一節所載適用於投資本基金的風險。欲索取以上文件，可聯絡天利基金的分銷商或瀏覽網站www.columbiathreadneedle.hk

組合持倉乃按全球收市(並非官方資產淨值時開)的資產估值總額計算。歷史收益率反映了過去12個月的派息。派息率反映了未來12個月預期將可能分派的金額。相關收益率反映了除去基金費用的年化收入。所示的息率不包括任何預設的收費及投資者可能須繳交派息的稅項。

Columbia Threadneedle Investments 是 Columbia 和 Threadneedle 企業集團的全球商標名稱。

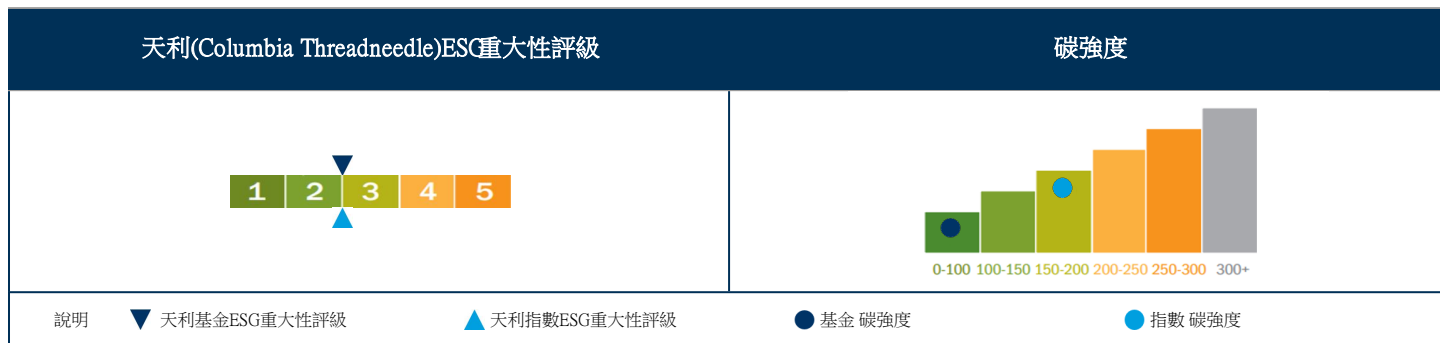
由天利投資管理香港有限公司於香港發行，地址為香港中環康樂廣場8號交易廣場二座3004室，獲證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)發牌從事第1類受規管活動(CE:AQA779)。根據《公司條例》(第622章)在香港註冊，註冊編號為1173058。本文件提及的任何基金均獲證監會認可。證監會認可並非對一項計劃的推薦或認許，亦不保證一項計劃的商業價值或其表現，更不表示該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何特定投資者或任何類別的投資者。本文件的內容未經香港任何監管機構審閱。

資料來源：紐米斯小型公司指數

本基金的目標和政策並無推廣可持續發展的投資策略。在投資決策過程中須考慮可持續發展相關風險，方法是將發行人的負責任投資實務及風險納入研究範圍，供基金的投資組合管理團隊使用。

## 負責任投資指標

	基金	指數	傾向
<b>天利(Columbia Threadneedle)ESG重大性評級</b> 加權平均（1為最高質素，5為最低質素）	3.04	2.96	-0.08
<b>碳強度</b> 加權平均（公噸二氧化碳當量/100萬美元銷售額）	67.63	160.64	+93.01
<b>爭議性投資</b> 投資於具爭議性的公司 <sup>1</sup>	--	--	--
<b>MSCI ESG分數</b> 加權平均（10為最高質素，0為最低質素）	7.15	7.28	-0.13



若干資料©2023 MSCI ESG Research LLC。經許可後轉載；不得進一步分發。

<sup>1</sup>資料來源：UNGC - 聯合國全球契約；ILO - 國際勞工組織核心勞工標準；UNGPBR - 聯合國工商業與人權指導原則

### 天利(Columbia Threadneedle)ESG重大性評級 (ESGM)

Columbia Threadneedle ESG實質性評級就公司對具有財務實質性的ESG風險的管理水平提供初步評估。我們使用可持續發展會計準則委員會(SASB)的框架來確定對於公司而言最具財務實質性的ESG風險因素。這些因素根據具體行業確定。該模型處理超過10,000家全球發行人的公共數據，評級每天更新，或在新數據發布時更新。結果從1至5分為五個等級，其中評級為5的公司面臨的實質性ESG風險最大，而評級為1的公司面臨的風險最小（即得分越低表示質量越好）。我們在投資過程中使用該評級來幫助指導我們的研究以及識別與公司接洽的機會。

### 碳強度

這用作衡量相對於公司規模的碳排放量，以收入而非市值計算。所用指標是每100萬美元收入的二氧化碳排放噸數(tCO<sub>2</sub>e)。我們根據所持有證券的權重提供整體基金的數據，並與指數的類似數據進行比較。碳強度是碳效率的指標。利用這個指標，我們可以與其他基金和資產類別進行比較。

### 爭議性投資

我們使用涵蓋操作實踐標準的三大國際框架，分別是聯合國全球契約、國際勞工組織核心勞工標準以及聯合國工商業與人權指導原則，從而評估存在爭議的風險程度。我們會衡量基金違反三大框架的比例，並與指數的類似數據進行比較。

### MSCI ESG分數

MSCI ESG評分使用MSCI自己的方法評估公司在管理其ESG風險方面的有效性。獲得最高評級的公司是被評估為在管理面臨的實質性ESG風險和機遇方面具有最高水平的公司。如果投資組合的評分高於基準，說明該投資組合超配持仓與其他發行人相比能更好地管理其ESG風險的發行人。

### 傾向

「傾向」數字顯示基金相對於指數的偏差。以權重的算數差值列示。正傾向表示偏向優於指數的負責任投資水平。

我們採用措施將基金的ESG特徵與指數進行比較。該指數亦是比較財務表現的有用基準。因此，該指數並非專為考慮環境或社會特徵而設計。

有關負責任投資或本文件所用投資術語的更多資料，請參閱本公司網站文件中心刊載的詞彙表。 <https://www.columbiathreadneedle.hk/zh/retl/guanyu-women/fuzeren-touzi/>。如決定投資所推廣的基金，亦應顧及所推廣基金的全部特徵或目標（如基金說明書／根據2011/61/EU指令第23條向投資者披露的資料所述者）。

ESG重大性和碳強度評分是根據過去12個月的加權平均值而計算。如不足12個月，則根據實際月份使用滾動平均值計算。加權平均值使用此前12個月期間每個營業日的指標進行相等權重計算。碳強度分母「銷售額」數字是收入的衡量指標。覆蓋率是投資組合的市值百分比，由各個適用指標的持股組成。現金及衍生工具不計入覆蓋率。MSCI根據發行人與《聯合國全球契約》、《國際勞工組織核心勞工標準》和《聯合國工商業與人權指導原則》這三份文件的原則比較的程度，給予發行人「合格」、「觀察名單」或「不合格」的分數。若三項中有任何一項被評為「不合格」，持股則會被視為有爭議性。

我們在2023年4月17日對ESG實質性評級方法做出了若干更改。這表示某些基金和基準評級發生了變化，但并不反映投資組合或我們的投資方式發生實質性變化。

本報告載有來自MSCI ESG Research LLC或其聯屬公司或資料供應商（「ESG各方」）的若干資料（「該等資料」）。該等資料僅可供閣下內部使用，不得以任何形式轉載或傳播，且不得用作任何金融工具或產品或指數的依據或組成部分。雖然ESG各方從其認為可靠的來源獲取資料，但概不保證或擔保本報告內任何資料的原創性、準確性及／或完整性，並明確表示概不對所有明示或暗示的保證（包括有關適銷性以及適合作為特定目的之保證）負責。MSCI資料概不擬構成投資建議或推薦作出（或不作出）任何種類的投資決定，且不得如此加以倚賴，亦不應被視作任何未來表現、分析、預測或推測的指標或擔保。ESG各方概不對與本報告任何資料有關的錯誤或遺漏負責，即使已獲告知可能出現直接、間接、專項、懲罰性、相應而生或任何其他損害賠償（包括利潤損失）負責，亦不對任何該等損害賠償負責。