

Dies ist eine Marketing-Anzeige. Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW und das KID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.

## Kontaktdaten

Tel: +352 46 40 10 7190\*

columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com

\* Bitte beachten Sie, dass Anrufe und elektronische

Kommunikation aufgezeichnet werden können.

IFDS, 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

## Wichtige Daten

Fondsmanager:



Roman Gaiser

Gareth Simmons

Seit Okt 18

Seit Aug 18

Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.

Umbrella-Fonds: Threadneedle (Lux)

SFDR-Kategorie: Artikel 8

Auflegungsdatum des

29.08.18

Fonds:

ICE BofA European Currency High  
Yield Excluding Subordinated  
Financials Constrained Index

Vergleichsgruppe:

Morningstar Category EUR High  
Yield Bond

Fondswährung:

EUR

Fondsdomizil:

Luxemburg

Fondsvolumen:

€348,6m

Anzahl der Wertpapiere:

323

Preis der Anteilsklasse:

10,1729

Alle Angaben in EUR

## Ratings/Auszeichnungen



© 2023 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind das geistige Eigentum von Morningstar und/oder seiner Inhaltsanbieter; (2) dürfen nicht vervielfältigt oder weiterverbreitet werden; und (3) beinhalten keine Garantie in Bezug auf Richtigkeit Vollständigkeit oder Aktualität. Morningstar und seine Inhaltsanbieter haften nicht für Schäden oder Verluste, die durch die Nutzung dieser Informationen entstehen. Die frühere Wertentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Ausführlichere Informationen über das Morningstar-Rating einschließlich der Methodik finden Sie hier: [http://corporate.morningstar.com/US/documents/MethodologyDocuments/MethodologyPapers/MorningstarFundRating\\_Methodology.pdf](http://corporate.morningstar.com/US/documents/MethodologyDocuments/MethodologyPapers/MorningstarFundRating_Methodology.pdf)



Quelle: Scope Analysis GmbH, [www.ScopeExplorer.com](http://www.ScopeExplorer.com)

## Anlageziel und -politik

Das Ziel des Fonds ist es, Erträge zu erzielen, die das Potenzial besitzen, den von Ihnen investierten Betrag mittel- bis langfristig zu erhöhen.

Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in auf Euro oder Pfund Sterling lautende Anleihen mit einem Rating unter Investment Grade (die einem Darlehen ähnlich sind und einen festen oder variablen Zinssatz zahlen), die von Unternehmen in Europa, einschließlich des Vereinigten Königreichs, oder von Unternehmen, die dort eine wesentliche Geschäftstätigkeit ausüben, begeben werden. Anleihen mit einem Rating unter Investment Grade sind Anleihen, die von internationalen Agenturen, die solche Ratings anbieten, schlechter bewertet wurden und als risikoreicher gelten als höher bewertete Anleihen, sie erzielen aber in der Regel höhere Erträge.

Der Fonds kann Derivate (komplexe Instrumente) zu Absicherungszwecken einsetzen und kann auch in andere als die oben genannten Anlageklassen und Instrumente investieren.

Der Fonds wird aktiv in Bezug auf den ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Fondsperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Der Fonds fördert ökologische und soziale Merkmale, indem er darauf abzielt, über rollierende 12-Monats-Zeiträume hinweg auf Grundlage der Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit (ESG = Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) besser abzuschneiden als der Index. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Fondsmanagers, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei der Fonds erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Der Fonds ist auch bestrebt, Unternehmen auszuschließen, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze (z. B. den Global Compact der Vereinten Nationen) verstoßen, es sei denn, der Fondsmanager ist der Ansicht, dass es konkrete mildernde Faktoren gibt, die für eine Beteiligung an dem Unternehmen sprechen.

Weitere Informationen zu den Anlagerichtlinien, einschließlich der Methode der Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit und der Engagement-Politik finden Sie unter [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com).

Der Fonds ist gemäß Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) als ein Fonds klassifiziert, der ökologische oder soziale Merkmale fördert.

## Wesentliche Risiken

- Der Wert von Anlagen kann fallen und steigen und Anleger könnten den ursprünglich investierten Betrag nicht zurückerhalten.
- Bei Anlagen in Vermögenswerten, die auf verschiedene Währungen oder auf andere Währungen als Ihre eigene lauten, kann der Anlagewert durch Wechselkursänderungen beeinflusst werden.
- Der Fonds investiert in Wertpapiere, deren Wert stark beeinträchtigt würde, falls der jeweilige Emittent die Auszahlung verweigert oder zahlungsunfähig wird oder als zahlungsunfähig angesehen wird.
- Der Fonds hält Vermögenswerte, die eventuell schwer zu verkaufen sein könnten. Der Fonds muss eventuell den Verkaufspreis senken, andere Anlagen verkaufen oder auf attraktivere Anlagemöglichkeit verzichten.
- Es ist wahrscheinlich, dass Zinssatzveränderungen den Wert des Fonds beeinflussen werden. Im Allgemeinen sinkt der Wert einer festverzinslichen Anleihe, wenn die Zinssätze steigen, und umgekehrt.
- Die objektive Bewertung der Vermögenswerte des Fonds ist möglicherweise manchmal schwierig und der tatsächliche Wert ist nicht erkennbar, bis die Vermögenswerte verkauft werden.
- Der Fonds kann in Derivate investieren (komplexe Instrumente, die an den Anstieg und Rückgang des Wertes anderer Vermögenswerte gekoppelt sind), mit dem Ziel, das Risiko zu reduzieren oder die Transaktionskosten zu minimieren. Solche Derivatgeschäfte können die Wertentwicklung des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Der Manager beabsichtigt nicht, dass sich ein solcher Einsatz von Derivaten auf das Gesamtrisiko des Fonds auswirkt.
- Der Fonds kann eine starke Kursvolatilität aufweisen.
- Die derzeit als für den Fonds maßgeblich identifizierten Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ dargelegt.

## Anlageansatz

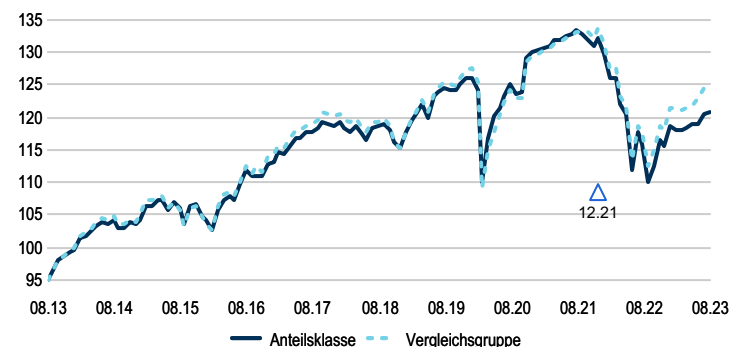
Der Anlageansatz des Fonds basiert auf einem soliden Kredit-Research unter der Führung von Analysten, einem robusten Portfolioaufbau und Risikomanagement.

Wir sind uns des Risikos eines dauerhaften Kapitalverlusts sowie der Asymmetrie der potenziellen Renditen bewusst, die für Investitionen in Unternehmensanleihen typisch ist. Die Auswahl der Emittenten und der spezifischen Anleihen sowie die Vermeidung erheblicher Kapitalverluste sehen wir als unsere wichtigsten Performancequellen.

## Wertentwicklung

Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Ergebnisse schließen. Die Rendite Ihrer Anlage kann sich aufgrund von Währungsschwankungen ändern, wenn Ihre Anlage in einer anderen Währung erfolgt als derjenigen, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde.

### 10 Jahre NIW (EUR)



### Wesentliche Ereignisse

△ Bezeichnet ein wesentliches Ereignis. Ausführliche Informationen zu Änderungen am Fonds finden Sie in der PDF-Datei "Einzelheiten zu wichtigen Ereignissen - T(Lux)" unter <https://www.columbiathreadneedle.com/en/changes>

### Erweiterte Wertentwicklung

Die Informationen zur früheren Wertentwicklung für den Zeitraum vor dem 29 August 2018 stammen vom Threadneedle European High Yield Bond (Klasse 1 Brutto-Thesaurierungsanteile (EUR) GB00B42R2118) (ein im Vereinigten Königreich zugelassener OGAW-Fonds, der am 8 März 2000 aufgelegt wurde), der am 6 Oktober 2018 mit diesem Fonds zusammengelegt wurde. Die vor dem 29 August 2018 berechnete frühere Wertentwicklung enthält britische Steuern, jedoch keine luxemburgischen Steuern.

### Wertentwicklung im Kalenderjahr (EUR)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Anteilsklasse (netto)	-12,1	1,7	2,9	9,1	-2,9	5,2	7,1	1,3	3,9	8,0
Vergleichsgruppe (netto)	-10,3	2,5	1,7	9,8	-3,6	5,5	7,8	1,4	4,5	8,0
Percentil	81%	80%	26%	65%	29%	59%	69%	54%	59%	48%
Quartil	4	4	2	3	2	3	3	3	3	2
Fonds (brutto)	-10,9	3,0	3,8	10,7	-1,8	6,7	8,5	2,5	5,3	9,4
Index (brutto)	-11,8	3,3	2,8	11,0	-3,3	6,2	10,1	0,8	4,6	8,9

### Annualisierte Wertentwicklung (EUR)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	10 J
Anteilsklasse (netto)	0,2	1,4	2,1	4,1	4,1	-4,7	-1,2	0,3	2,3
Vergleichsgruppe (netto)	0,2	1,9	2,5	4,9	5,4	-3,1	0,4	0,8	2,6
Percentil	48%	82%	64%	79%	85%	86%	91%	75%	66%
Quartil	2	4	3	4	4	4	4	3	3
Fonds (brutto)	0,3	1,9	2,8	5,1	5,6	-3,3	0,2	1,6	3,6
Index (brutto)	0,2	1,8	2,5	5,8	6,0	-3,6	0,4	1,2	3,2

### Rollierend 12M (EUR)

	09.22 - 08.23	09.21 - 08.22	09.20 - 08.21	09.19 - 08.20	09.18 - 08.19	09.17 - 08.18	09.16 - 08.17	09.15 - 08.16	09.14 - 08.15	09.13 - 08.14
Anteilsklasse (netto)	4,1	-12,6	6,2	0,4	4,8	0,8	4,9	5,3	1,7	9,2
Vergleichsgruppe (netto)	5,4	-11,4	7,3	-1,0	4,0	0,4	5,5	5,8	1,7	9,9
Percentil	85%	74%	74%	24%	33%	36%	71%	56%	51%	66%
Quartil	4	3	3	1	2	2	3	3	3	3
Fonds (brutto)	5,6	-11,5	7,6	1,3	6,2	1,9	6,5	6,6	3,1	10,5
Index (brutto)	6,0	-12,3	8,8	-0,2	5,1	1,3	6,6	7,2	1,5	10,2

Quelle Morningstar UK Limited © 2023, Stand 31.08.23. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.

Die Indexrenditen beinhalten Veräußerungsgewinne und gehen von der Wiederanlage etwaiger Erträge aus. Der Index enthält keine Gebühren oder Kosten und Sie können nicht direkt in den Index investieren.

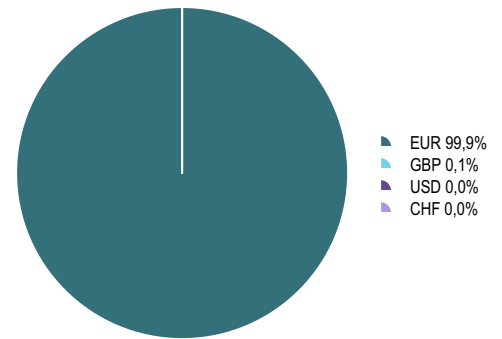
Die Morningstar-Kategorien für Fonds aus dem Anlageuniversum Europa/Asien/Afrika enthalten Fonds, die in Europa ansässig sind und/oder an europäischen Märkten gehandelt werden. Morningstar überprüft regelmäßig die Struktur der Kategorien und die Fonds innerhalb jeder Kategorie, um sicherzustellen, dass das System den Erfordernissen der Anleger entspricht und mit den Marktentwicklungen Schritt hält. Die angegebene Wertentwicklung bezieht sich nur auf offene und börsengehandelte Fonds und wird nach der primären Anteilsklasse in der Klassifizierung Morningstar Offshore Territories gefiltert.

Brutto-Fondswertentwicklung – Quelle Columbia Threadneedle, Stand 31.08.23. Portfoliorenditen vor Abzug von Gebühren sind zeitgewichtete Renditen ohne Berücksichtigung von Provisionen, Transaktionskosten und nicht rückforderbarer Steuern auf Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne unter Verwendung von Preisen für Anlagen, die entweder dem letzten Handelskurs oder einem Geldkurs entsprechen. Cashflows werden per Tagesende berücksichtigt und schließen Ein- und Ausstiegsgebühren aus.

## Top 10 Positionen (%)

Wertpapier	Fonds	Index	
Electricite De France Sa	3,3	2,6	Versorger
Telefonica Europe B V	2,5	1,7	Telekommunikation
Ford Motor Credit Company Llc	2,3	1,4	Automobilindustrie
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands Ii B.V	2,2	1,7	Gesundheitswesen
Telecom Italia S.P.A.	2,0	1,9	Telekommunikation
Forvia Se.	1,9	1,4	Automobilindustrie
Deutsche Lufthansa Ag	1,8	1,1	Transport
Cellnex Finance Company S.A.U.	1,8	1,4	Technologie & Elektronik
Vodafone Group Plc	1,7	1,1	Telekommunikation
Iliad Holding S.A.S.	1,5	0,5	Telekommunikation
<b>Summe</b>	<b>20,9</b>	<b>14,7</b>	

## Fonds-Währungsengagement einschließlich Absicherung

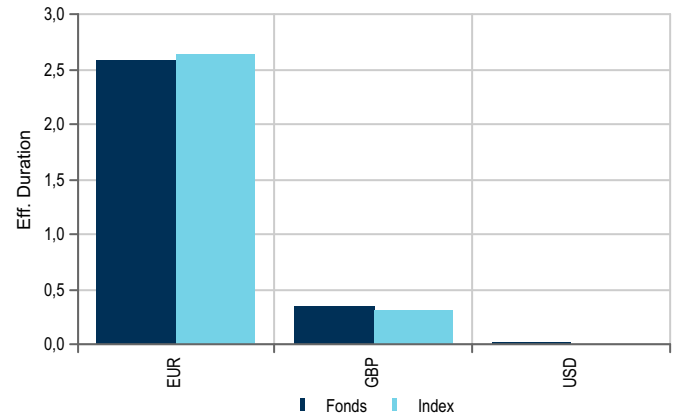


Alle Prozentangaben zum Monatsende auf Basis des globalen Bruttobewertungsschlusskurses und Bestimmung der Währungspositionen anhand der zugrundeliegenden Anlagen einschließlich Fremdwährungstermingeschäfte.

## Währungsengagement der zugrunde liegenden Wertpapiere

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
Euro	82,9	88,8	-5,8	2,6	2,6
Britisches Pfund	14,3	11,2	3,0	0,4	0,3
US-Dollar	0,8	--	0,8	0,0	--
Derivate	-0,4	--	-0,4	0,0	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	0,4	--	0,4	--	--
Barmittel ähnlich	1,7	--	1,7	--	--
Cash einschl. FFX	0,3	0,0	0,3	--	--
<b>Summe</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>--</b>	<b>2,9</b>	<b>3,0</b>

## Währung - Beitrag zur effektiven Duration



## Credit Rating

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
A	0,2	0,1	0,0	0,0	0,0
BBB	5,5	2,3	3,2	0,1	0,1
BB	59,1	63,6	-4,6	1,9	1,9
B	31,1	29,6	1,5	0,9	0,9
CCC	1,9	4,2	-2,3	0,1	0,1
CC	--	0,0	0,0	--	0,0
C	0,0	0,1	-0,1	0,0	0,0
D	--	0,1	-0,1	--	0,0
NR	0,3	--	0,3	--	--
Andere	--	--	--	--	--
Derivate	-0,4	--	-0,4	0,0	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	0,4	--	0,4	--	--
Barmittel ähnlich	1,7	--	1,7	--	--
Cash einschl. FFX	0,3	0,0	0,3	--	--
<b>Summe</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>--</b>	<b>2,9</b>	<b>3,0</b>

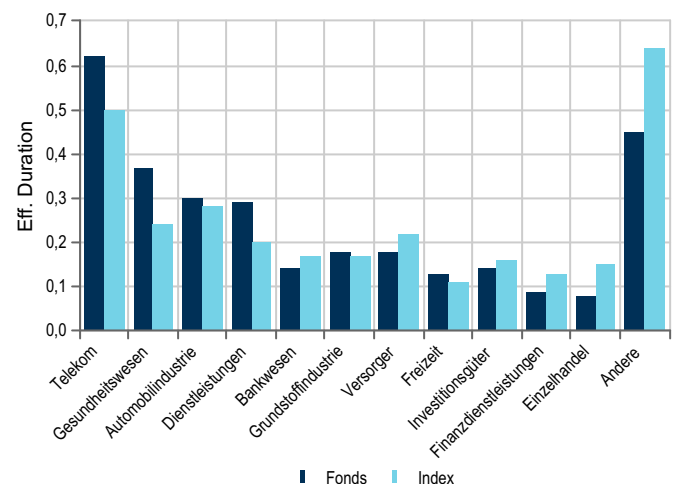
**Durchschn. Rating**      **BB**      **BB-**

Kredit-Ratings sind intern ermittelte Ratings nach der LINEAR-Methodik. Die angezeigten Kategorien sind nach Bonität sortiert Kreditrating.

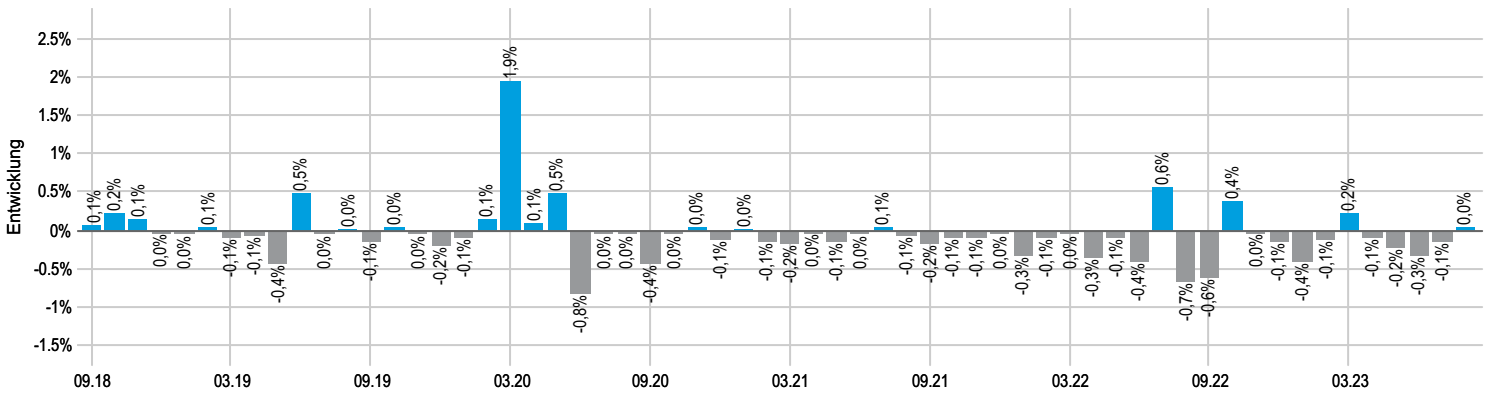
## Branchen

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
Telekommunikation	17,1	13,7	3,4	0,6	0,5
Gesundheitswesen	10,5	7,3	3,2	0,4	0,2
Automobilindustrie	9,8	9,5	0,3	0,3	0,3
Dienstleistungen	9,3	6,7	2,6	0,3	0,2
Bankwesen	6,9	7,2	-0,4	0,1	0,2
Grundstoffindustrie	6,3	6,6	-0,3	0,2	0,2
Versorger	6,0	7,0	-1,0	0,2	0,2
Freizeit	6,0	4,3	1,7	0,1	0,1
Investitionsgüter	3,8	5,4	-1,5	0,1	0,2
Finanzdienstleistungen	3,4	4,5	-1,0	0,1	0,1
Einzelhandel	3,3	6,3	-3,0	0,1	0,2
Andere	15,6	21,6	-6,0	0,5	0,6
Derivate	-0,4	--	-0,4	0,0	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	0,4	--	0,4	--	--
Barmittel ähnlich	1,7	--	1,7	--	--
Cash einschl. FFX	0,3	0,0	0,3	--	--
<b>Summe</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>--</b>	<b>2,9</b>	<b>3,0</b>

## Branchen - Beitrag zur effektiven Duration



## Relative monatliche Wertentwicklung gegenüber Median der Vergleichsgruppe



Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Ergebnisse schließen. Die Rendite Ihrer Anlage kann sich aufgrund von Währungsschwankungen ändern, wenn Ihre Anlage in einer anderen Währung erfolgt als derjenigen, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde. Quelle Morningstar UK Limited © 2023, Stand 31.08.23. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.

### Risikoanalyse

	3 J		5 J	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Absolute Volatilität	7,3	7,6	8,4	9,2
Relative Volatilität	1,0	--	0,9	--
Tracking Error	0,8	--	1,2	--
Sharpe-Ratio	0,0	--	0,2	--
Information Ratio	-0,2	--	0,3	--
Beta	1,0	--	0,9	--
Sortino Ratio	0,0	--	0,2	--
Jensen-Alpha	-0,2	--	0,5	--
Annualisiertes Alpha	-0,2	--	0,5	--
Alpha	0,0	--	0,0	--
Max. Drawdown	-15,4	-16,2	-15,4	-16,2
R <sup>2</sup>	98,9	--	98,9	--

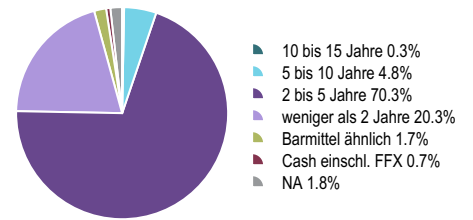
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

### Portfolio-Statistik

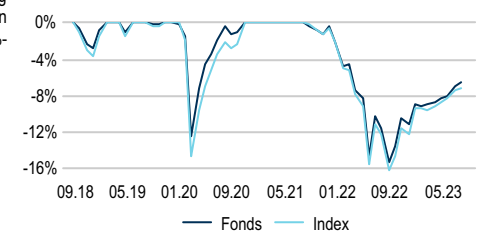
	Fonds	Index
Modifizierte Duration	4,5	4,3
Effektive Duration	2,9	3,0
Durchschnittlicher Kupon	4,3	4,1
Yield-to-Worst	6,8	7,6
Credit Rating Linear	BB	BB-
Optionsbereinigter Spread	391,9	465,5

Die Analysen basieren auf globalen Bewertungen zum Börsenschluss unter Verwendung von durch Columbia Threadneedle Investments ermittelten Marktattributen. Die Daten für zugrunde liegende Wertpapiere können vorläufig sein oder auf Schätzungen basieren. Die Gewichtungen der Marktkapitalisierung umfassen Barmittel in den %-Berechnungen.

### Effektive Duration



### Drawdown

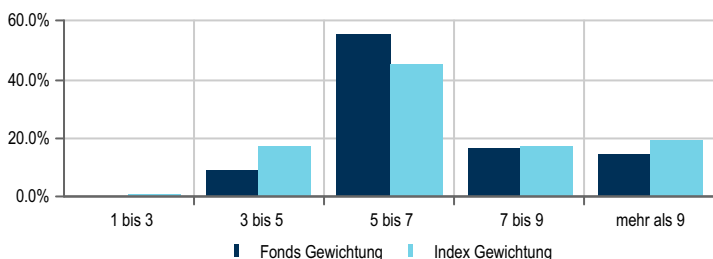


### Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

	Abweich. durchschnittl. Gewicht.	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Rel. Gesamt-ertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung		
						Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Telekommunikation	4,2	3,8	4,6	-0,7	-1,1	-0,1	-0,1	-0,2
Gesundheitswesen	2,2	6,3	6,5	-0,2	0,7	0,0	0,0	0,0
Automobilindustrie	1,0	8,1	7,7	0,4	1,8	0,0	0,0	0,0
Dienstleistungen	1,9	6,9	7,5	-0,6	1,7	0,0	0,0	0,0
Bankwesen	-1,8	6,3	6,9	-0,6	1,1	0,0	0,0	0,0
Grundstoffindustrie	-0,1	5,4	6,4	-0,9	0,6	0,0	-0,1	-0,1
Versorger	-1,5	6,6	7,2	-0,5	1,3	0,0	0,0	0,0
Freizeit	1,7	13,0	11,9	1,0	5,8	0,1	0,1	0,1
Investitionsgüter	-2,0	6,4	7,8	-1,3	1,9	0,0	0,0	-0,1
Finanzdienstleistungen	-0,9	7,0	6,1	0,9	0,3	0,0	0,0	0,0
Einzelhandel	-3,3	-5,3	7,0	-11,5	1,2	0,0	-0,4	-0,4
Immobilien	-1,8	-5,9	-3,5	-2,5	-8,7	0,2	0,0	0,1
<b>Summe</b>	--	<b>5,1</b>	<b>5,8</b>	<b>-0,6</b>	--			<b>-0,6</b>

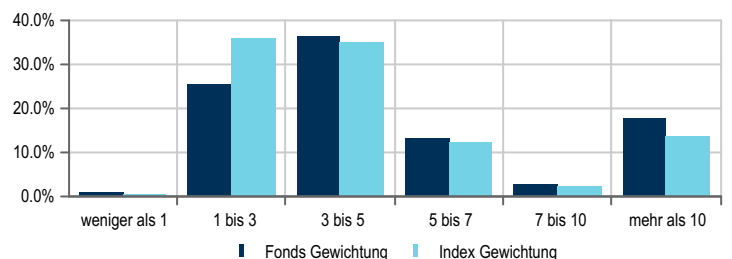
Die Erträge werden auf täglicher geometrischer Basis berechnet, sofern nicht anders angegeben. Fondserträge können aufgrund von Daten- und Berechnungsmethoden beim Vergleich mit geometrisch zugeordneten Gesamtrenditen zu Residualfaktoren führen. Die Änderung bei den Gewichtungen ist die durchschnittliche tägliche Unter-/Übergewichtungsposition des Fonds im Vergleich zum Index über den Berichtszeitraum. Die Zuordnungstabelle und das Diagramm zeigen maximal zwölf Gruppierungen auf Basis der höchsten Portfolio-Endgewichtung. Die Zuordnungszusammenfassung für den Gesamteffekt über einen rollierenden 3-Monatszeitraum basiert auf denselben Gruppierungen wie die Zuordnung seit Jahresbeginn.

### Rückzahlungsrendite



Gewichtungen in Barvermögen und Wertpapiere ohne Rendite sind nicht angezeigt. Rückzahlungsrendite stammt von Factset.

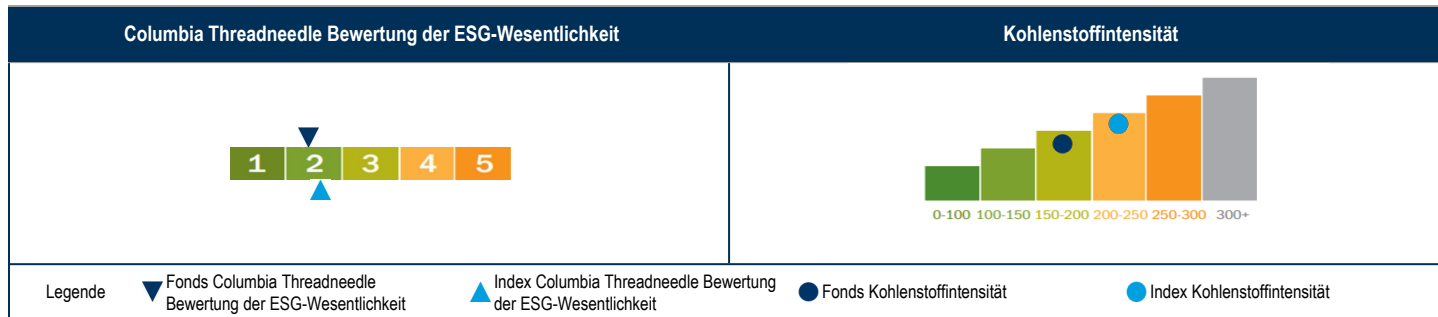
### Jahre bis zur Fälligkeit



Der Fonds ist nach Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung) als Fonds eingestuft, der ökologische oder soziale Merkmale fördert, und bei dem die investierten Unternehmen Praktiken einer guten Unternehmensführung zeigen.

## Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

	Fonds	Index	Ausrichtung
<b>Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit</b> Gewichteter Durchschnitt (1 = höchste Qualität, 5 = niedrigste Qualität)	2,44	2,63	+0,18
<b>Kohlenstoffintensität</b> Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	159,58	220,80	+61,22
<b>Engagement in kontroversen Unternehmen</b> Engagement in kontroversen Titeln <sup>1</sup>	--	2,09%	+2,09%
<b>ESG-Score von MSCI</b> Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	5,99	5,90	+0,10



Bestimmte Informationen ©2023 MSCI ESG Research LLC. Nachdruck mit Genehmigung; keine weitere Verbreitung.

<sup>1</sup>Quelle: UNGC – United Nations Global Compact; ILO – International Labor Organization Core Labor Standards (Kernarbeitsnormen der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO)); UNGPBR – United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte)

### Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit (ESGM)

Die Columbia Threadneedle ESG Materiality-Ratings bieten eine erste Einschätzung, wie gut ein Unternehmen seine finanziell wesentlichen ESG-Risiken beherrscht. Wir verwenden das Sustainability and Accounting Standards Board-Framework (SASB), um zu ermitteln, welche ESG-Risikofaktoren für ein Unternehmen finanziell am wesentlichsten sind. Diese Faktoren hängen von der Branche ab. Das Modell verarbeitet öffentlich zugängliche Daten für über 10.000 globale Emittenten. Die Ratings werden täglich bzw. bei Veröffentlichung neuer Daten aktualisiert. Das Ergebnis ist eine Bewertung von 1 bis 5, wobei Unternehmen, die mit 5 bewertet werden, wesentlichen ESG-Risiken am meisten ausgesetzt sind und Unternehmen, die mit 1 bewertet werden, solchen Risiken am wenigsten ausgesetzt sind (d. h. ein niedrigerer Wert steht für eine bessere Qualität). Wir verwenden die Ratings in unseren Anlageprozessen, um unser Research zu lenken und Gelegenheiten zur Mitwirkung bei Unternehmen zu identifizieren.

### Kohlenstoffintensität

Dabei werden die Kohlenstoffemissionen im Verhältnis zur Größe eines Unternehmens an den Umsätzen und nicht an der Marktkapitalisierung gemessen. Als Kennzahl wird Tonnen CO<sub>2</sub> pro Million Dollar Umsatz verwendet (TCO<sub>2</sub>e). Die Daten für den gesamten Fond geben wir auf Basis der Gewichtung der gehaltenen Wertpapiere und eines Vergleichs mit ähnlichen Daten für den Index an. Die Kohlenstoffintensität ist ein Indikator für die Kohlenstoffeffizienz. Diese Kennzahl ermöglicht den Vergleich mit anderen Fonds und Anlageklassen.

### Engagement in kontroversen Unternehmen

Das Risiko einer Beteiligung an Kontroversen beurteilen wir anhand von drei internationalen Rahmenwerken, in denen Standards für die operative Praxis festgelegt sind: dem UN Global Compact, den International Labour Organisation Core Labor Standards und den UN Guiding Principles on Business and Human Rights. Wir messen den Anteil des Fonds, der in Zusammenhang mit Verstößen gegen die drei Rahmenwerke steht, und vergleichen mit ähnlichen Daten für den Index.

### ESG-Score von MSCI

Der MSCI ESG-Score nutzt die MSCI-eigene Methodik, um die Effektivität der Unternehmen bei der Handhabung ihres ESG-Engagements zu bewerten. Die Unternehmen mit den höchsten Ratings sind diejenigen, die ihr Engagement gegenüber diesen wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen am besten handhaben. Liegt der Portfolio-Score über der Benchmark, ist das Portfolio in Emittenten übergewichtet, die ihr ESG-Engagement besser handhaben als andere.

### Ausrichtung

Der Wert „Ausrichtung“ gibt die Ausrichtung des Fonds im Vergleich zum Index an. Sie wird als arithmetische Differenz in der Gewichtung ausgedrückt. Eine positive Ausrichtung weist auf eine Tendenz zu einem „besseren“ RI-Profil als dem des Index hin.

Es werden Kennzahlen verwendet, um die ESG-Merkmale des Fonds mit dem Index zu vergleichen. Dieser Index ist auch ein nützlicher Referenzwert, mit dem die Wertentwicklung verglichen werden kann.

Dementsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, ökologische oder soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen.

Weitere Informationen über verantwortungsvolles Investieren (RI) oder die in diesem Dokument verwendeten Anlagebegriffe finden Sie im Glossar, das im Document Centre auf unserer Website zur Verfügung steht: <https://www.columbiathreadneedle.de/de/ret/uber-uns/verantwortungsvolles-anlegen/>. Bei der Entscheidung, in den beworbenen Fonds zu investieren, sollten auch alle Eigenschaften oder Ziele des beworbenen Fonds berücksichtigt werden, wie in seinem Verkaufsprospekt/ in den Informationen beschrieben, die den Anlegern gemäß Artikel 23 der Richtlinie 2011/61/EU offenzulegen sind.

Die Bewertung der ESG-Wesentlichkeit und der Kohlenstoffintensität wird auf Grundlage des gleitenden gewichteten Durchschnitts der letzten 12 Monate berechnet. Für Zeiträume unter 12 Monaten wird der gleitende Durchschnitt aus den verfügbaren Monaten berechnet. Der gewichtete Durchschnitt wird anhand der gleichen Gewichtung der Kennzahl für jeden Geschäftstag in der vorangegangenen 12-Monats-Periode berechnet. Der Nenner „Umsatz“ der Kohlenstoffintensität ist eine Umsatzkennzahl. Die Reichweite ist der prozentuale Anteil des Portfolios am Marktwert, der sich aus den Portfoliobeständen für jede anwendbare Kennzahl zusammensetzt. Barmittel und Derivate sind von der Reichweite ausgeschlossen. MSCI gibt den Emittenten eine Bewertung von „Pass“, „Watch List“ oder „Fail“, je nachdem, in welchem Maße sie mit den Prinzipien der folgenden drei Dokumente übereinstimmen: Dem UN Global Compact, den International Labor Organization Core Labor Standards (Kernarbeitsnormen der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO)) und den UNGPBR – United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte). Wird für eins der drei Dokumente ein „Fail“ vergeben, gelten die entsprechenden Positionen als „kontrovers“.

Am 17. April 2023 haben wir einige Änderungen an der Methode zur Bewertung der ESG-Wesentlichkeit vorgenommen. Das bedeutet, dass sich einige Fonds- und Benchmark-Ratings geändert haben, was jedoch keine wesentliche Änderung des Portfolios oder unseres Anlageansatzes darstellt.

Dieser Bericht enthält bestimmte Informationen (die „Informationen“), die von MSCI ESG Research LLC, seinen verbundenen Unternehmen oder Informationsanbietern stammen (die „ESG-Parteien“). Die Informationen sind ausschließlich für Ihre interne Nutzung bestimmt. Sie dürfen nicht vervielfältigt oder in irgendeiner Weise in Umlauf gebracht werden, und sie dürfen nicht als Grundlage für oder Bestandteil von Finanzinstrumenten bzw. -produkten oder Indizes verwendet werden. Obwohl sie Informationen aus Quellen beziehen, die sie für zuverlässig halten, übernehmen die ESG-Parteien keine Garantie für die Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der in diesem Bericht enthaltenen Daten und sichern ausdrücklich keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien zu, auch nicht im Hinblick auf Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck. Keine der MSCI-Informationen sollen eine Anlageberatung oder eine Empfehlung für (oder gegen) eine Anlageentscheidung darstellen und niemand sollte sich diesbezüglich auf sie verlassen. Ebenso sollten sie nicht als Anhaltspunkt oder Garantie für Analysen, Vorhersagen oder Prognosen hinsichtlich der zukünftigen Wertentwicklung dienen. Die ESG-Parteien übernehmen keine Haftung für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten und sind nicht für direkte, indirekte oder besondere Schäden, Schäden mit Strafcharakter, Folgeschäden oder sonstige Schäden (insbesondere entgangene Gewinne) haftbar, auch wenn sie vorab von der Möglichkeit solcher Schäden in Kenntnis gesetzt wurden.



## Verfügbare Anteilsklassen

Anteil Klasse	Abgesichert	Währung	Steuer	OCF	OCF Datum	Max. Ausgabeaufschlag	Max. Rücknahmeabschlag	Transaktionskosten	Mindestanlage	Auflegungsdatum	ISIN	SEDOL	BBID	WKN/Valor/CUSIP	
1E	Acc	Nein	EUR	Gross	1,38%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829334579	BF50YF2	THEH1EE LX	A2JN8N
1EP	Inc	Nein	EUR	Gross	1,38%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829332524	BF50XV1	THE1EPE LX	A2JN74
1G	Acc	Nein	GBP	Gross	1,38%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829334652	BF50YG3	THEHY1G LX	A2JN8P
1GP	Inc	Nein	GBP	Gross	1,38%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829332797	BF50XW2	THEH1GG LX	A2JN75
1UT	Inc	Ja	USD	Gross	1,38%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,32%	--	29.08.18	LU1829332870	BF50XX3	THE1UTU LX	A2JN76
2E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,82%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849561953	BD2Z4P6	THEH2EE LX	A2JP80
2EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,82%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562092	BD2Z4Q7	THE2EPE LX	A2JP81
2G	Acc	Nein	GBP	Gross	0,82%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562258	BD2Z4S9	THEH2GG LX	A2JP83
2GP	Inc	Nein	GBP	Gross	0,82%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562332	BD2Z4T0	THE2GPG LX	A2JP84
3E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,77%	31.03.23	3,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333415	BF50Y30	THEH3EE LX	A2JN8C
3EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,77%	31.03.23	3,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333506	BF50Y41	THE3EPE LX	A2JN8D
3G	Acc	Nein	GBP	Gross	0,77%	31.03.23	3,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829334736	BF50YH4	THE3GGA LX	A2JN8Q
3GP	Inc	Nein	GBP	Gross	0,77%	31.03.23	3,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333845	BF50Y74	THEH3GG LX	A2JN8G
8E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,86%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829332953	BF50XY4	THEH8EE LX	A2JN77
8EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,86%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333092	BF50XZ5	THE8EPE LX	A2JN78
8G	Acc	Nein	GBP	Gross	0,86%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333258	BF50Y18	THEHY8G LX	A2JN8A
8GP	Inc	Nein	GBP	Gross	0,86%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1829333332	BF50Y29	THEH8GG LX	A2JN8B
9E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,70%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562415	BD2Z4V2	THEH9EE LX	A2JP85
9EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,70%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562506	BD2Z4W3	THE9EPE LX	A2JP86
9G	Acc	Nein	GBP	Gross	0,70%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849563140	BD2ZN04	THEH9GG LX	A2JP9C
9GP	Inc	Nein	GBP	Gross	0,70%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	--	29.08.18	LU1849562845	BD2Z724	THE9GPG LX	A2JP89
AE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,45%	31.03.23	3,00%	0,00%	0,23%	2.500	05.05.20	LU2132999991	BLCHC76	THEHYAE LX	A2P1F6
IE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,65%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	100.000	29.08.18	LU1849563736	BD2ZNV6	THEHIEE LX	A2JP9H
IEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,65%	31.03.23	0,00%	0,00%	0,23%	100.000	29.08.18	LU1849563819	BD2ZNX7	THEIEPE LX	A2JP9J
ZE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,75%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	1.500.000	29.08.18	LU1849563579	BD2ZNT3	THEHZEE LX	A2JP9F
ZEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,75%	31.03.23	5,00%	0,00%	0,23%	1.500.000	29.08.18	LU1849563652	BD2ZNV5	THEZEPE LX	A2JP9G

Anteilsklassenbezeichnung: Beginnend mit einer Ziffer – nur verfügbare bestehende Anleger. Beginnend mit einem Buchstaben – verfügbare neue und bestehende Anleger. Die in der Tabelle aufgeführten Anteilsklassen stehen möglicherweise nicht allen Anlegern offen; weitere Informationen finden Sie im Prospekt. Allgemeine Auswirkungen der Kosten: Die Kosten und die erwarteten Erträge können aufgrund von Währungs- und Wechselkurschwankungen steigen oder sinken, wenn die Kosten in einer anderen Währung als Ihrer lokalen Währung zu zahlen sind. Die laufenden Kosten (OCF), die Rücknahmeabschläge (der in der obigen Tabelle angegebene Höchstbetrag, der abgezogen werden kann) und die Transaktionskosten zeigen den Prozentsatz, der von Ihren erwarteten Erträgen abgezogen werden kann. Die laufenden Kosten basieren in der Regel auf den Aufwendungen des letzten Jahres und umfassen Kosten wie die jährliche Verwaltungsgebühr und Betriebskosten des Fonds. Die angegebenen Transaktionskosten basieren auf einem Dreijahresdurchschnitt und werden auf der Grundlage der Zahlen aus dem Jahresbericht und -abschluss berechnet. Bei Fonds, die weniger als 3 Jahre alt sind, basieren die Transaktionskosten auf Ersatzwerten und tatsächlichen Kosten. Alle Transaktionskosten entsprechen dem Stand vom 31.03.23. Zusätzliche Vertriebs- oder Vermittlungsgebühren dürfen nicht einbezogen werden. In einigen Fällen können die laufenden Kosten auf einer Schätzung der künftigen Kosten beruhen. Eine detailliertere Aufstellung finden Sie unter [www.columbiathreadneedle.com/fees](http://www.columbiathreadneedle.com/fees).

## Wichtige Informationen

Nur zur Nutzung durch professionelle Kunden und/oder gleichwertige Anlegertypen in Ihren Rechtsordnungen (nicht für Privatkunden zu verwenden oder an diese weiterzugeben). Threadneedle (Lux) ist eine in Luxemburg gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital ("SICAV"), von Threadneedle Management Luxembourg S.A. verwaltet. Dieses Material ist nicht als Angebot, Aufforderung, Anlageberatung oder Empfehlung zu verstehen. Diese Mitteilung ist zum Zeitpunkt ihrer Veröffentlichung gültig und kann ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Informationen aus externen Quellen werden als zuverlässig erachtet, es wird jedoch keine Garantie für ihre Richtigkeit oder Vollständigkeit übernommen. Der aktuelle Verkaufsprospekt der SICAV, die aktuellen Basisinformationsblätter und die Zusammenfassung der Anlegerrechte sind in englischer Sprache und/oder in Deutsch (sofern verfügbar) bei der Verwaltungsgesellschaft Threadneedle Management Luxembourg S.A., International Financial Data Services (Luxembourg) S.A., bei Ihrem Finanzberater und/oder auf unserer Website [www.columbiathreadneedle.de](http://www.columbiathreadneedle.de) erhältlich. Threadneedle Management Luxembourg S.A. kann beschließen, die für die Vermarktung des Fonds getroffenen Vorkehrungen aufzuheben. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI (Bundesverband Investment und Asset Management) Methode. Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A., eingetragen beim Registre de Commerce et des Sociétés (Luxemburg), Registernummer B 110242, 44 rue de la Vallée, L-2661 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia- und Threadneedle-Unternehmensgruppe.

„Quelle: ICE BofA, mit Genehmigung verwendet. ICE BofA LIZENZIERT DIE ICE BofA-INDIZES OHNE MÄNGELGEWÄHR, GIBT KEINE GEWÄHRLEISTUNGEN HINSICHTLICH DIESER, GARANTIERT NICHT FÜR DIE EIGNUNG, QUALITÄT, RICHTIGKEIT, AKTUALITÄT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DER ICE BofA-INDIZES ODER IRGENDWELCHER IN DIESEN ENTHALTENEN, MIT DIESEN IN VERBINDUNG STEHENDEN ODER AUS DIESEN ABGELEITETEN DATEN, ÜBERNIMMT KEINE HAFTUNG IN VERBINDUNG MIT IHRER VERWENDUNG UND SPONSERT, UNTERSTÜTZT ODER EMPFIEHLT Threadneedle Asset Management Limited ODER DESSEN PRODUKTE ODER DIENSTLEISTUNGEN NICHT.“