

Dieses Dokument dient Marketingzwecken. Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW und die wesentlichen Anlegerinformationen, 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, 47, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

Wichtige Daten

Fondsmanager:



Guy Pope
 Seit Okt 11

Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Ma. Lux. S.A.

Auflegungsdatum des Fonds: 12.10.11

Fonds:

Index: S&P500

Vergleichsgruppe: Morningstar Category US Large-Cap Blend Equity

Fondswährung: USD

Fondsdomizil: Luxemburg

Fondsvolumen: \$450,3m

Anzahl der Wertpapiere: 79

Preis der Anteilsklasse: 59,6737

Alle Angaben in USD

Ratings/Auszeichnungen



© 2021 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



Quelle: Scope Analysis GmbH, www.ScopeExplorer.com

Anlageziel und -politik

Der Fonds zielt darauf ab, den Wert Ihrer Anlage langfristig zu steigern.

Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in Anteile großer Unternehmen, die in den USA ansässig sind oder dort eine wesentliche Geschäftstätigkeit ausüben. Diese Unternehmen werden zum Zeitpunkt des Erwerbs in der Regel einen Marktwert von mehr als 2 Milliarden US-Dollar haben.

Bei der Auswahl der Anlagen des Fonds wird ein „antizyklischer“ Ansatz verfolgt. Der Fondsmanager wird im Allgemeinen Aktien anvisieren, die eine Underperformance aufweisen, aber seiner Meinung nach das Potenzial zur Erholung haben.

Der Fonds investiert direkt in diese Vermögenswerte oder kann versuchen, durch den Einsatz von Derivaten indirekt ein Engagement in diesen Vermögenswerten zu erzielen. Derivate sind anspruchsvolle Anlageinstrumente, die an den Anstieg und Rückgang des Werts anderer Vermögenswerte gekoppelt sind. Der Fonds kann Derivate auch zu Absicherungszwecken oder zur effizienteren Verwaltung des Fonds verwenden. Derivate können eine Hebelwirkung erzeugen (d. h., das Marktengagement liegt über dem Nettoinventarwert des Fonds).

Der Fonds kann auch in andere als die oben angegebenen Anlageklassen und Instrumente investieren.

Der Fonds wird aktiv in Bezug auf den S&P500 Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die der Fonds investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Fondsp performance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. 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.

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 kann erheblich in Derivate anlegen. Eine relative geringe Änderung im Wert der Basisanlage kann eine viel größere positive oder negative Auswirkung auf den Wert des Derivats haben.
- Die derzeit als für den Fonds maßgeblich identifizierten Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ dargelegt.

Anlageansatz

Der antizyklische Ansatz verwendet den Aktienkurs als Ausgangspunkt, um Werte zu identifizieren, für die der Markt einen stark pessimistischen Ausblick aufweist. Das Team sucht nach nicht in der Gunst der Anleger stehenden Wachstums- und Substanz-Unternehmen und hält sie in der Regel so lange, bis der Markt ihren vollen Wert erkennt. Der Fonds strebt an, im Laufe der Zeit eine starke, risikobereinigte Performance durch eine Titelauswahl gekoppelt mit umsichtiger Risikobudgetierung und -überwachung zu erzielen.

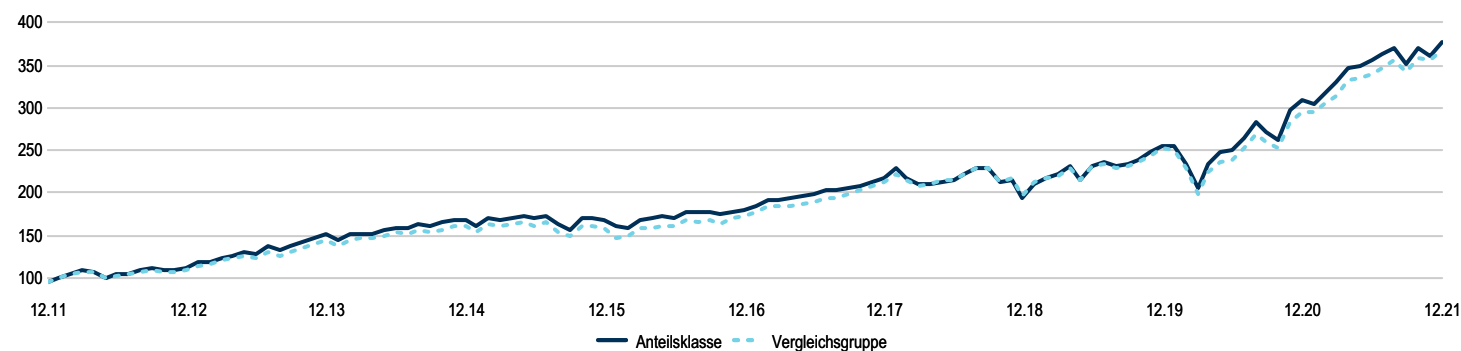
Die identifizierten Werte werden auf Basis ihrer Fundamentaldaten geprüft, um festzustellen, ob die Probleme das Ergebnis vorübergehender Faktoren oder negativer langfristiger Hürden sind. Von vorübergehenden Faktoren beeinträchtigte Werte werden einer Bottom-up-Analyse unterzogen. Der Verwalter nutzt verschiedene Alphaquellen, darunter das Portfolioteam, das Fundamentaldaten-Research-Team von Columbia Threadneedle und das quantitative Research-Team.

Für jede Position wird ein Kursziel festgelegt und der Verwalter überwacht diese Ziele kontinuierlich, um festzustellen, ob die ursprüngliche Anlagenthese bestehen bleibt. Titel, die potenziell eine unterdurchschnittliche Performance aufweisen, werden verkauft und das dadurch gewonnene Kapital wird zugunsten attraktiverer Risiko-Rendite-Gelegenheiten eingesetzt.

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 (USD)



Wertentwicklung im Kalenderjahr (USD)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Anteilsklasse (netto)	22,0	20,5	30,9	-10,3	19,6	7,0	0,4	10,6	34,2	16,6
Vergleichsgruppe (netto)	26,3	18,0	29,8	-6,5	20,6	9,7	-0,7	11,4	31,5	13,5
Percentil	82%	25%	34%	86%	64%	81%	32%	59%	10%	5%
Quartil	4	1	2	4	3	4	2	3	1	1
Fonds (brutto)	24,3	22,7	33,3	-8,7	21,9	8,8	2,3	12,6	36,7	18,9
Index (brutto)	28,7	18,4	31,5	-4,4	21,8	12,0	1,4	13,7	32,4	16,0

Annualisierte Wertentwicklung (USD)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	10 J
Anteilsklasse (netto)	4,7	7,7	6,1	22,0	22,0	21,2	24,4	15,6	14,4
Vergleichsgruppe (netto)	4,2	9,9	10,1	26,3	26,3	22,1	24,2	16,4	14,1
Percentil	30%	81%	86%	82%	82%	58%	49%	58%	45%
Quartil	2	4	4	4	4	3	2	3	2
Fonds (brutto)	4,8	8,2	7,1	24,3	24,3	23,5	26,7	17,7	16,5
Index (brutto)	4,5	11,0	11,7	28,7	28,7	23,4	26,1	18,5	16,6

Rollierend 12M (USD)

	01.21 - 12.21	01.20 - 12.20	01.19 - 12.19	01.18 - 12.18	01.17 - 12.17	01.16 - 12.16	01.15 - 12.15	01.14 - 12.14	01.13 - 12.13	01.12 - 12.12
Anteilsklasse (netto)	22,0	20,5	30,9	-10,3	19,6	7,0	0,4	10,6	34,2	16,6
Vergleichsgruppe (netto)	26,3	18,0	29,8	-6,5	20,6	9,7	-0,7	11,4	31,5	13,5
Percentil	82%	25%	34%	86%	64%	81%	32%	59%	10%	5%
Quartil	4	1	2	4	3	4	2	3	1	1
Fonds (brutto)	24,3	22,7	33,3	-8,7	21,9	8,8	2,3	12,6	36,7	18,9
Index (brutto)	28,7	18,4	31,5	-4,4	21,8	12,0	1,4	13,7	32,4	16,0

Quelle Morningstar UK Limited © 2021, Stand 31.12.21. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.

Der Index enthält keine Gebühren oder Kosten und Sie können nicht in ihn 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.

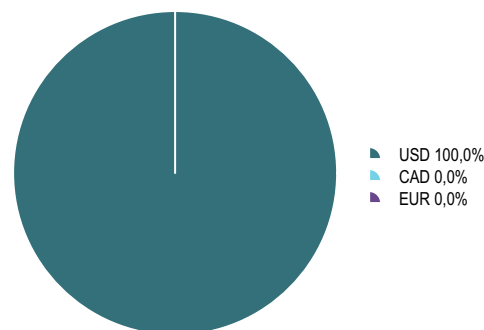
Morningstar überprüft regelmäßig die Struktur der Kategorien und die Fonds innerhalb jeder Kategorie, um sicherzustellen, dass das System den Erfordernissen der Anleger entspricht und mit den Marktentwicklungen Schritt hält. Die angegebene Wertentwicklung bezieht sich nur auf offene und börsengehandelte Fonds und wird nach der primären Anteilsklasse in der Klassifizierung Morningstar Offshore Territories gefiltert.

Brutto-Fondswertentwicklung – Quelle Columbia Threadneedle, Stand 31.12.21. Auf der Grundlage globaler Bewertungen zum Börsenschluss, wobei die Cashflows zum Tagesbeginn gewichtet werden, ohne Ausgabeauf-/Rücknahmeabschläge und laufende Kosten sowie nach Abzug der Transaktionskosten.

Top 10 Positionen (%)

Wertpapier	Fonds	Index	
Microsoft Corporation	7,1	6,3	Informationstechnologie
Apple Inc.	6,4	6,9	Informationstechnologie
Alphabet Inc.	5,5	4,2	Kommunikationsdienste
Amazon.com, Inc.	4,5	3,6	Zyklische Konsumgüter
Berkshire Hathaway Inc. Class B	2,7	1,4	Finanzen
Raytheon Technologies Corporation	2,7	0,3	Industrie
Johnson & Johnson	2,5	1,1	Gesundheit
Meta Platforms Inc. Class A	2,3	2,0	Kommunikationsdienste
TE Connectivity Ltd.	2,2	0,1	Informationstechnologie
Mastercard Incorporated Class A	2,1	0,8	Informationstechnologie
Summe	38,1	26,5	

Fonds-Währungsengagement einschließlich Absicherung



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

Gewichtungen (%)

Branchen	Fonds	Index	Diff.
Informationstechnologie	32,4	29,2	3,2
Gesundheit	13,5	13,3	0,2
Kommunikationsdienste	11,8	10,2	1,7
Finanzen	10,0	10,7	-0,6
Zyklische Konsumgüter	9,3	12,5	-3,3
Industrie	8,3	7,8	0,6
Nichtzykl. Konsumgüter	4,5	5,9	-1,4
Rohstoffe	3,1	2,6	0,5
Energie	3,0	2,7	0,3
Versorger	1,8	2,5	-0,7
Immobilien	1,2	2,8	-1,5
Barmittel	1,1	--	1,1

Top 10 Übergewichtung/Untergewichtung (%)

Übergewichtung				Untergewichtung			
Wertpapier	Fonds	Index	Diff.	Wertpapier	Fonds	Index	Diff.
Raytheon Technologies Corporation	2,7	0,3	2,3	Tesla Inc	--	2,1	-2,1
TE Connectivity Ltd.	2,2	0,1	2,1	UnitedHealth Group Incorporated	--	1,2	-1,2
Sysco Corporation	2,0	0,1	1,9	Home Depot, Inc.	--	1,1	-1,1
Palo Alto Networks, Inc.	1,5	--	1,5	Procter & Gamble Company	--	1,0	-1,0
Johnson & Johnson	2,5	1,1	1,4	Pfizer Inc.	--	0,8	-0,8
Berkshire Hathaway Inc. Class B	2,7	1,4	1,4	Broadcom Inc.	--	0,7	-0,7
Mastercard Incorporated Class A	2,1	0,8	1,3	Netflix, Inc.	--	0,7	-0,7
Alphabet Inc.	5,5	4,2	1,3	Thermo Fisher Scientific Inc.	--	0,7	-0,7
Uber Technologies, Inc.	1,3	--	1,3	Accenture Plc Class A	--	0,6	-0,6
State Street Corporation	1,3	0,1	1,2	Exxon Mobil Corporation	--	0,6	-0,6

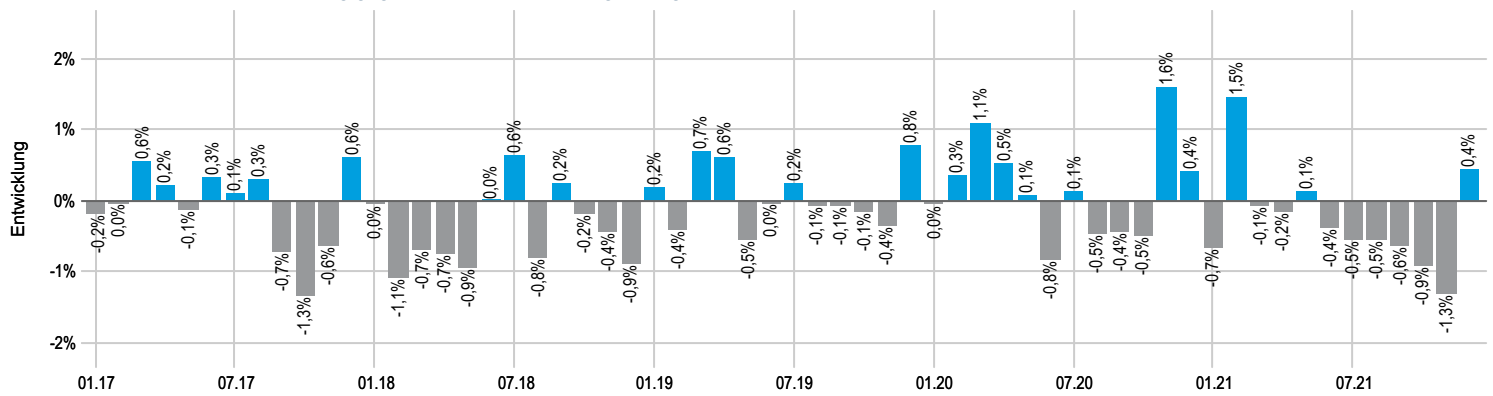
Größte Änderungen bei den Positionen über 3 Monate

Wertpapier	3M Veränd.
Fiserv, Inc.	-1,0
Aon Plc Class A	-0,9
Apple Inc.	0,9
Visa Inc. Class A	0,9
International Business Machines Corporation	0,8
American Express Company	-0,8
Micron Technology, Inc.	0,7
Splunk Inc.	-0,7
Microsoft Corporation	0,7
Comcast Corporation Class A	-0,6

Zuordnung Top positive/negative Wertpapiere (3 Monate)

Wertpapiername - 10 höchste	Fonds			Index			Attri			Wertpapiername - 10 niedrigste	Fonds			Index			Attri		
	durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Beitrag zum Ertrag	durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Geo. Gesamteffekt	durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Beitrag zum Ertrag		durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Geo. Gesamteffekt	durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Beitrag zum Ertrag	durchschn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Geo. Gesamteffekt
Marvell Technology, Inc.	0,7	48,4	0,3	--	--	0,2	Tesla Inc	--	--	--	2,1	36,3	-0,4						
Moderna, Inc.	--	--	--	0,3	-34,0	0,2	Medtronic Plc	1,4	-17,4	-0,2	0,4	-17,0	-0,3						
Visa Inc. Class A	0,4	-0,9	0,0	0,9	-2,5	0,1	Southwest Airlines Co.	1,0	-17,3	-0,2	0,1	-16,7	-0,3						
TE Connectivity Ltd.	2,2	17,3	0,4	0,1	17,9	0,1	Raytheon Technologies Corporation	2,8	0,4	0,0	0,3	0,7	-0,2						
salesforce.com, inc.	--	--	--	0,7	-6,3	0,1	Uber Technologies, Inc.	1,4	-7,0	-0,1	--	--	-0,2						
Lam Research Corporation	1,0	25,8	0,2	0,2	26,6	0,1	Sysco Corporation	2,0	0,1	0,0	0,1	0,1	-0,2						
Endeavor Group Holdings, Inc. Class A	0,2	36,4	0,1	--	--	0,1	T-Mobile US, Inc.	1,1	-9,0	-0,1	0,2	-9,2	-0,2						
CVS Health Corporation	1,2	21,9	0,2	0,3	22,3	0,1	Comcast Corporation Class A	1,4	-10,5	-0,1	0,6	-9,6	-0,2						
Union Pacific Corporation	1,0	29,0	0,3	0,4	29,2	0,1	UnitedHealth Group Incorporated	--	--	--	1,1	28,9	-0,2						
Vertex Pharmaceuticals Incorporated	0,8	20,5	0,2	0,1	21,1	0,1	Pfizer Inc.	--	--	--	0,7	38,5	-0,2						

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 diejenige, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde. Quelle Morningstar UK Limited © 2021, Stand 31.12.21. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabebau- und Rücknahmeabschläge.

Risikoanalyse

	3 J		5 J	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Absolute Volatilität	17,7	17,2	15,8	15,3
Relative Volatilität	1,0	--	1,0	--
Tracking Error	2,4	--	2,2	--
Sharpe-Ratio	1,4	--	1,0	--
Information Ratio	0,3	--	-0,3	--
Beta	1,0	--	1,0	--
Sortino Ratio	2,5	--	1,6	--
Jensen-Alpha	0,0	--	-1,2	--
Annualisiertes Alpha	0,0	--	-1,1	--
Alpha	0,0	--	-0,1	--
Max. Drawdown	-18,5	-19,6	-18,5	-19,6
R ²	98,3	--	98,1	--

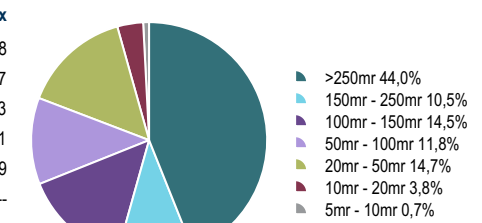
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

Portfolio-Statistik

	Fonds	Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis	24,6	24,8
Kurs-Buchwert-Verhältnis	4,0	4,7
Dividendenrendite	1,2	1,3
Gesamtkapitalrendite	3,4	8,1
Eigenkapitalrendite	16,3	18,9
Active Share	55,5	--

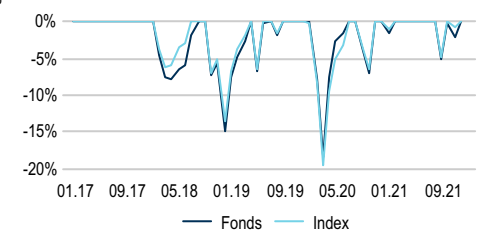
Die Analysen basieren auf globalen Bewertungen zum Börsenschluss unter Verwendung von durch Columbia Threadneedle Investments ermittelten Marktattributen. Die Daten für zugrunde liegende Wertpapiere können vorläufig sein oder auf Schätzungen basieren. Die Gewichtungen der Marktkapitalisierung umfassen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

Marktkapitalisierungsübersicht



Währung: USD

Drawdown



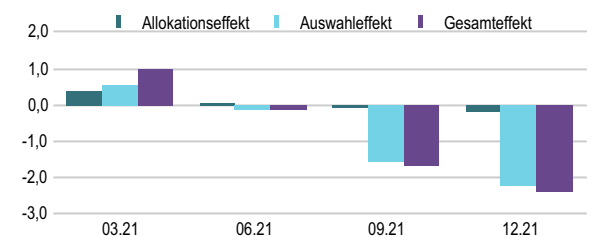
Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

	Abweich. durchschnittl. Gewicht.	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Rel. Gesamt-ertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung		
						Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Kommunikationsdienste	1,7	19,0	21,6	-2,1	-5,5	0,0	-0,3	-0,3
Zyklische Konsumgüter	-1,9	16,2	24,4	-6,6	-3,3	0,0	-0,6	-0,6
Nichtzykl. Konsumgüter	-1,9	10,4	18,6	-6,9	-7,8	0,2	-0,4	-0,2
Energie	0,1	59,4	54,6	3,1	20,1	0,0	0,1	0,2
Finanzen	0,7	33,0	35,0	-1,5	4,9	0,2	-0,2	0,1
Gesundheit	-1,7	18,8	26,1	-5,8	-2,0	0,0	-0,7	-0,7
Industrie	0,5	9,6	21,0	-9,4	-6,0	0,0	-0,9	-0,9
Informationstechnologie	1,7	33,1	34,6	-1,0	4,5	0,1	-0,3	-0,2
Rohstoffe	1,5	25,6	27,3	-1,3	-1,1	-0,1	0,0	-0,2
Immobilien	-1,4	24,6	46,2	-14,8	13,6	-0,1	-0,1	-0,2
Versorger	-1,1	12,5	17,7	-4,4	-8,6	0,1	0,0	0,1
Summe	--	24,6	28,7	-3,2	--	0,1	-3,3	-3,2

Performance-Attribution - Gesamteffekte über einen 3-Monats-Zeitraum

	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Geo. Zuordnung		
			Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Dez-20 - Mrz-21	7,2	6,2	0,4	0,6	1,0
Mrz-21 - Juni-21	8,4	8,5	0,0	-0,1	-0,1
Juni-21 - Sept-21	-1,1	0,6	-0,1	-1,5	-1,6
Sept-21 - Dez-21	8,4	11,0	-0,2	-2,2	-2,4

Gesamteffekte über 3 Monate

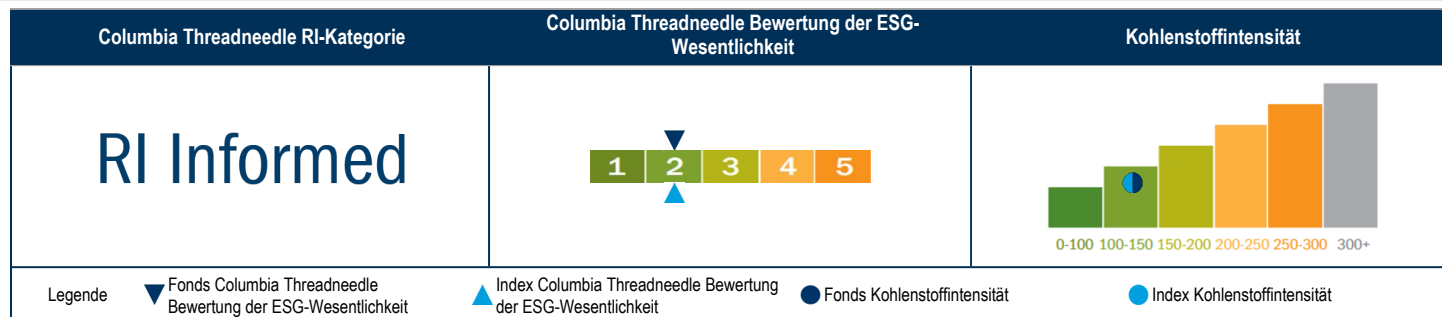


Die Erträge werden auf täglicher geometrischer Basis berechnet, sofern nicht anders angegeben. Fondserträge können aufgrund von Daten- und Berechnungsmethoden beim Vergleich mit geometrisch zugeordneten Gesamterträgen zu Residualfaktoren führen. Die Änderung bei den Gewichtungen ist die durchschnittliche 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.

Der Fonds ist gemäß der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) als ein Fonds nach Artikel 6 eingestuft und fördert in seinem Anlageziel und seiner Anlagepolitik KEINE ökologischen oder sozialen Merkmale.

Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

	Fonds	Index	Ausrichtung
Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit Gewichteter Durchschnitt (1 = höchste Qualität, 5 = niedrigste Qualität)	2,51	2,47	-0,04
Kohlenstoffintensität Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	142,76	135,81	-6,95
Engagement in kontroversen Unternehmen Engagement in kontroversen Titeln ¹	--	0,15%	+0,15%
ESG-Score von MSCI Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	6,06	6,20	-0,14



Bestimmte Informationen ©2021 MSCI ESG Research LLC. Nachdruck mit Genehmigung; keine weitere Verbreitung.

¹Quelle: 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 RI-Kategorie

Wir haben unsere Fonds nach dem Grad der RI-Integration in 4 Kategorien eingeteilt:

RI Informed – Strategien, die die ESG-Faktoren berücksichtigen, die in unserer Fundamentaldatenrecherche verankert sind

RI Tilt – Strategien mit einem positiven Schwerpunkt auf ESG-Merkmale im Laufe der Zeit im Vergleich zum Index

RI Promotion – Strategien, die auf positive oder sich verbessernde ESG-Merkmale abzielen

RI Sustainable Outcomes – Strategien, die auf positive, messbare nachhaltige Ergebnisse oder Auswirkungen abzielen

Bitte beachten Sie, dass unsere RI Promotion- und RI Sustainable Outcomes-Strategien auch eine positive RI Tilt im Vergleich zum Index beinhalten.

Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit (ESGM)

Die ESGM-Ratings von Columbia Threadneedle gibt es für über 8.000 Unternehmen weltweit. Sie bieten eine erste evidenzbasierte Bewertung eines Unternehmens, die zeigt, wie nachhaltig es geführt wird und wie effektiv es ESG-Risiken steuert. Unser Modell der ESG-Wesentlichkeit basiert auf dem Rahmenwerk des Sustainability and Accounting Standards Board (SASB®), das wiederum wesentliche ESG-Risikofaktoren für 77 Branchen identifiziert hat. Dieses Modell verarbeitet veröffentlichte Daten zu den betreffenden Unternehmen und beurteilt den Managementansatz in Bezug auf ESG-Risiken und die damit verbundenen Standards in der operativen Praxis. Wir bewerten die Emittenten von 1 bis 5. Emittenten mit einem Rating von 1 sind Emittenten mit der besten Qualität, während Emittenten mit einem Rating von 5 am schwächsten sind. Wir aktualisieren unsere Ratings täglich, und Änderungen des Ratings eines Emittenten können ein Momentum-Signal für Portfoliomanager liefern.

Kohlenstoffintensität

Dabei werden die Kohlenstoffemissionen im Verhältnis zur Größe eines Unternehmens an den Umsätzen und nicht an der Marktkapitalisierung gemessen. Als Kennzahl wird Tonnen CO2 pro Million Dollar Umsatz verwendet (TCO2e). 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 Labour 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-Score beurteilt, wie effektiv das ESG-Risiko gemanagt wird. Wenn der Score des Fonds über dem des Index liegt, ist der Fonds in Unternehmen übergewichtet, die ihre ESG-Risiken besser verwalten 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/der/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“.

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	
AEC	Inc	Ja	EUR	Gross	1,85%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,50%	2.500	29.09.15	LU1280957728	BYK0Y7	TUSCAEC LX	A14YWU
AEH	Acc	Ja	EUR	Gross	1,85%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,50%	2.500	12.10.11	LU0640476809	B6XBWP0	TUSCAEH LX	A1JMUB
AU	Acc	Nein	USD	Gross	1,85%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,41%	2.500	12.10.11	LU0640476718	B7LTNZ0	TUSCAU LX	A1JMUA
AU	Acc	Nein	EUR	Gross	1,85%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,41%	2.500	17.08.12	LU0757433270	B8F2G42	TUSCAUE LX	A1JVMK
AUP	Inc	Nein	USD	Gross	1,85%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,41%	2.500	29.09.15	LU1280957306	BYK0X6	TUSCAUP LX	A14YWT
IU	Acc	Nein	USD	Gross	1,05%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,41%	100.000	12.10.11	LU0640477955	B78H0R8	TUSCEIU LX	A1JMUF
IU	Acc	Nein	EUR	Gross	1,05%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,41%	100.000	17.08.12	LU0757433437	B86YVJ7	TUSCIUE LX	A1JVMM
ZEH	Acc	Ja	EUR	Gross	1,10%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,50%	1.500.000	22.09.14	LU0957798670	BQ3BFQ2	TUSCZEH LX	A12AB5
ZU	Acc	Nein	USD	Gross	1,10%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,41%	2.000.000	22.09.14	LU0957798241	BQ3BFV7	TUSCUZU LX	A12AB9
ZU	Acc	Nein	EUR	Gross	1,10%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,41%	1.500.000	22.09.14	LU0957798324	BQ3BFT5	TUSCZUU LX	--

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 Wechselkursschwankungen 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 31.03.21. 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.

Wichtige Informationen

Nur zur Nutzung durch professionelle Kunden und/oder gleichwertige Anleger 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 wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) 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 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.

Der S&P Dow Jones Index („Index“) ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC („S&P DJI“) und/oder ihre verbundenen Unternehmen und wurde für die Verwendung durch Threadneedle Asset Management Limited und alle verbundenen Unternehmen lizenziert. Copyright © 2021 durch S&P Dow Jones Indices LLC, eine Tochtergesellschaft von McGraw Hill Financial, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die Weitergabe oder Vervielfältigung, sowohl ganz als auch teilweise, ist ohne schriftliche Zustimmung von S&P Dow Jones Indices LLC untersagt. S&P Dow Jones Indices LLC, ihre verbundenen Unternehmen und ihre externen Lizenzgeber übernehmen keine Haftung für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen eines Index oder der darin enthaltenen Daten. Alle in diesem Bericht enthaltenen gemischten Vergleichsindizes, die einen oder mehrere S&P DJI Indizes [und andere externe Indizes] enthalten, wurden von Threadneedle Asset Management Limited oder ihren verbundenen Unternehmen berechnet.

Der Global Industry Classification Standard („GICS“) wurde von MSCI Inc. („MSCI“) und Standard & Poor's, einem Geschäftsbereich von McGraw-Hill Companies Inc. („S&P“), entwickelt und ist deren alleiniges Eigentum sowie deren Dienstleistungsmarke und wurde zur Nutzung durch Threadneedle Asset Management Limited lizenziert. Weder MSCI noch S&P oder an der Erstellung oder Zusammenstellung des GICS oder dessen Klassifizierungen beteiligte Dritte gibt ausdrückliche oder stillschweigende Garantien oder Zusicherungen im Hinblick auf diesen Standard oder diese Klassifizierungen (oder die Ergebnisse, die durch deren Nutzung erzielt werden können) ab und alle Parteien weisen hiermit ausdrücklich jegliche Garantien der Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck im Hinblick auf jeden derartigen Standards bzw. jede derartige Klassifizierung von sich. Ohne Einschränkung des Vorstehenden sind MSCI, S&P, mit ihnen verbundene Personen oder an der Erstellung oder Zusammenstellung des GICS oder dessen Klassifizierungen beteiligte Dritte in irgendeinem Fall und in irgendeiner Weise für jedwede 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. Einige dieser Kennungen wurden von Threadneedle Asset Management Limited bestimmt und können von der offiziellen Klassifizierung im GICS (Global Industry Classification System) abweichen. Sie werden von den GICS-Anbietern MSCI oder Standard & Poor's weder unterstützt noch gesponsert.