

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:



Roman Gaiser Seit Okt 18
 Gareth Simmons Seit Aug 18

Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.
 Auflegungsdatum des Fonds: 29.08.18

Index: ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained

Vergleichsgruppe: Morningstar Category EUR High Yield Bond

Fondswährung: EUR
 Fondsdomizil: Luxemburg
 Fondsvolumen: €514,3m
 Anzahl der Wertpapiere: 346
 Preis der Anteilsklasse: 11,1132

Alle Angaben in EUR

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, Erträge zu erzielen, die das Potenzial haben, den von Ihnen investierten Betrag mittel- bis langfristig zu erhöhen.

Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in auf Euro oder britische Pfund 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 zu Absicherungszwecken Derivate (anspruchsvolle Anlageinstrumente, die an den Anstieg und Rückgang des Werts anderer Vermögenswerte gekoppelt sind) einsetzen.

Der Fonds kann auch in andere als die oben angegebenen 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.

Der Fonds ist nach Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung, SFDR) als Fonds eingestuft, 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, um Risiken zu verringern oder die Transaktionskosten zu minimieren. Diese Derivatgeschäfte können die Performance des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Der Fondsmanagers beabsichtigt nicht, dass sich dieser Einsatz von Derivaten auf das allgemeine Risikoprofil des Fonds auswirkt.
- Die derzeit als für den Fonds maßgeblich identifizierten Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ dargelegt.

Anlageansatz

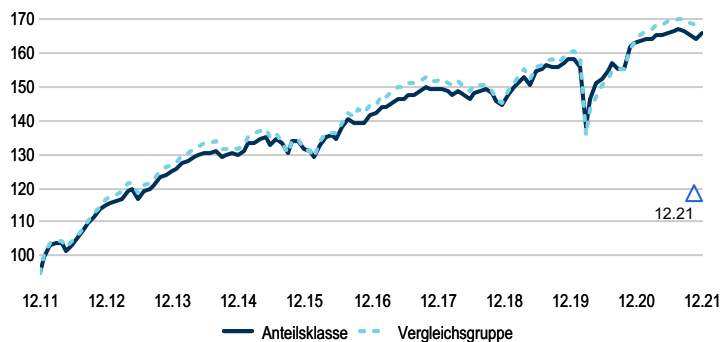
Der Anlageansatz des Fonds basiert auf einem soliden Kredit-Research unter der Führung von Analysten, einem robusten Portfolioaufbau und Risikomanagement.

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 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)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Anteilsklasse (netto)	1,7	2,9	9,1	-2,9	5,2	7,1	1,3	3,9	8,0	20,3
Vergleichsgruppe (netto)	2,5	1,6	9,8	-3,6	5,2	7,8	1,4	3,9	7,8	22,0
Percentil	79%	25%	65%	27%	51%	67%	53%	51%	42%	66%
Quartil	4	1	3	2	3	3	3	3	2	3
Fonds (brutto)	3,0	3,8	10,7	-1,9	6,7	8,5	2,5	5,3	9,4	21,7
Index (brutto)	3,3	2,8	11,0	-3,3	6,2	10,1	0,8	4,6	8,9	24,5

Annualisierte Wertentwicklung (EUR)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	10 J
Anteilsklasse (netto)	0,9	-0,4	-0,2	1,7	1,7	2,3	4,5	3,1	5,5
Vergleichsgruppe (netto)	0,9	-0,2	0,3	2,5	2,5	2,1	4,6	3,0	5,7
Percentil	59%	72%	76%	79%	79%	42%	54%	47%	55%
Quartil	3	3	4	4	4	2	3	2	3
Fonds (brutto)	1,0	0,0	0,5	3,0	3,0	3,4	5,8	4,4	6,8
Index (brutto)	0,8	-0,4	0,3	3,3	3,3	3,0	5,6	3,9	6,7

Rollierend 12M (EUR)

	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)	1,7	2,9	9,1	-2,9	5,2	7,1	1,3	3,9	8,0	20,3
Vergleichsgruppe (netto)	2,5	1,6	9,8	-3,6	5,2	7,8	1,4	3,9	7,8	22,0
Percentil	79%	25%	65%	27%	51%	67%	53%	51%	42%	66%
Quartil	4	1	3	2	3	3	3	3	2	3
Fonds (brutto)	3,0	3,8	10,7	-1,9	6,7	8,5	2,5	5,3	9,4	21,7
Index (brutto)	3,3	2,8	11,0	-3,3	6,2	10,1	0,8	4,6	8,9	24,5

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.

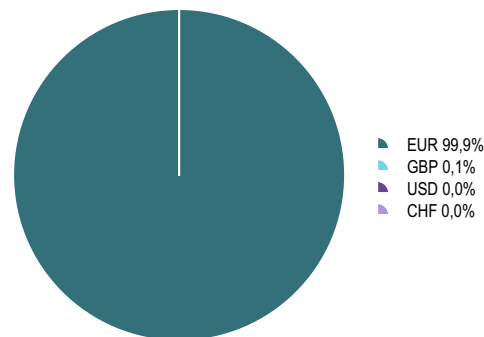
Morningstar überprüft regelmäßig die Struktur der Kategorien und die Fonds innerhalb jeder Kategorie, um sicherzustellen, dass das System den Erfordernissen der Anleger entspricht und mit den Marktentwicklungen Schritt hält. Die angegebene Wertentwicklung bezieht sich nur auf offene und börsengehandelte 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	
Electricite De France Sa	2,7	2,1	Versorger
Ford Motor Credit Company Llc	2,4	1,5	Automobilindustrie
Telefonica Europe B V	2,2	1,6	Telekommunikation
Deutsche Lufthansa Ag	1,9	1,1	Transport
Faurecia S.E.	1,8	1,0	Automobilindustrie
Telecom Italia S.P.A.	1,7	2,3	Telekommunikation
Vodafone Group Plc	1,6	1,1	Telekommunikation
Schaeffler Ag	1,5	0,6	Automobilindustrie
Iqvia Inc	1,3	0,7	Gesundheitswesen
Atlantia Spa	1,3	0,6	Transport
Summe	18,3	12,6	

Fonds-Währungsengagement einschließlich Absicherung

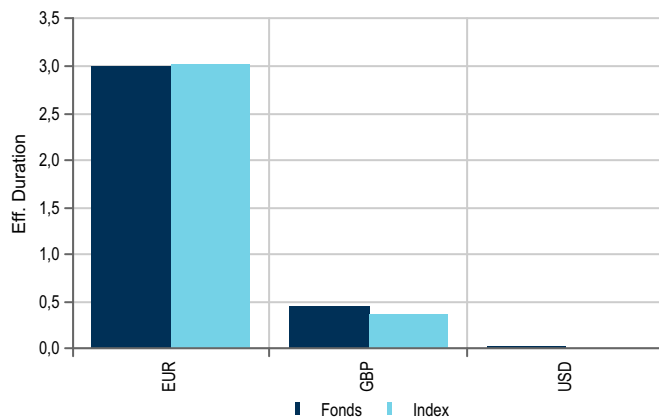


Alle Prozentangaben zum Monatsende auf Basis des globalen Bruttobewertungsschlusskurses und Bestimmung der Währungspositionen anhand der zugrundeliegenden Anlagen einschließlich Fremdwährungstermingeschäfte.

Währungsengagement der zugrunde liegenden Wertpapiere

	Gewichtung		Diff.	Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index		Fonds	Index
Euro	82,4	88,9	-6,5	3,0	3,0
Britisches Pfund	12,1	11,1	1,1	0,5	0,4
US-Dollar	0,9	--	0,9	0,0	--
Barmittel ähnlich	4,1	--	4,1	--	--
Cash einschl. FFX	0,5	0,0	0,5	--	--
Summe	100,0	100,0	--	3,5	3,4

Währung - Beitrag zur effektiven Duration



Credit Rating

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
A	--	0,1	-0,1	--	0,0
BBB	3,2	1,9	1,2	0,2	0,1
BB	56,0	64,7	-8,7	2,2	2,4
B	30,0	28,1	1,9	0,9	0,8
CCC	6,0	5,1	1,0	0,2	0,1
NR	0,2	0,1	0,1	--	--
N/A	0,0	--	0,0	--	--
Barmittel ähnlich	4,1	--	4,1	--	--
Cash einschl. FFX	0,5	0,0	0,5	--	--
Summe	100,0	100,0	--	3,5	3,4

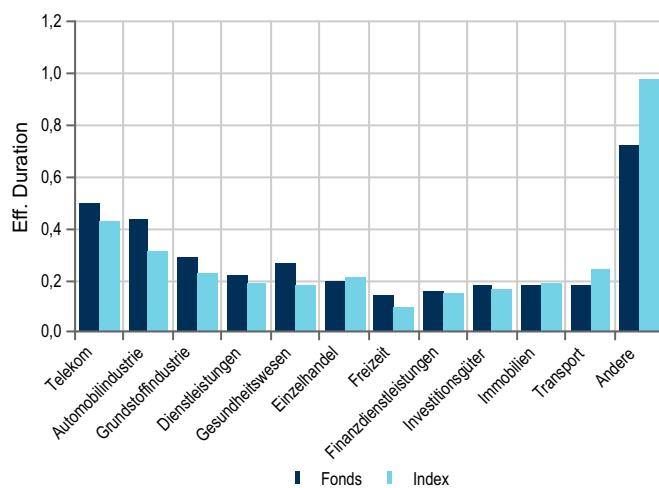
Durchschn. Rating **BB** **BB-**

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

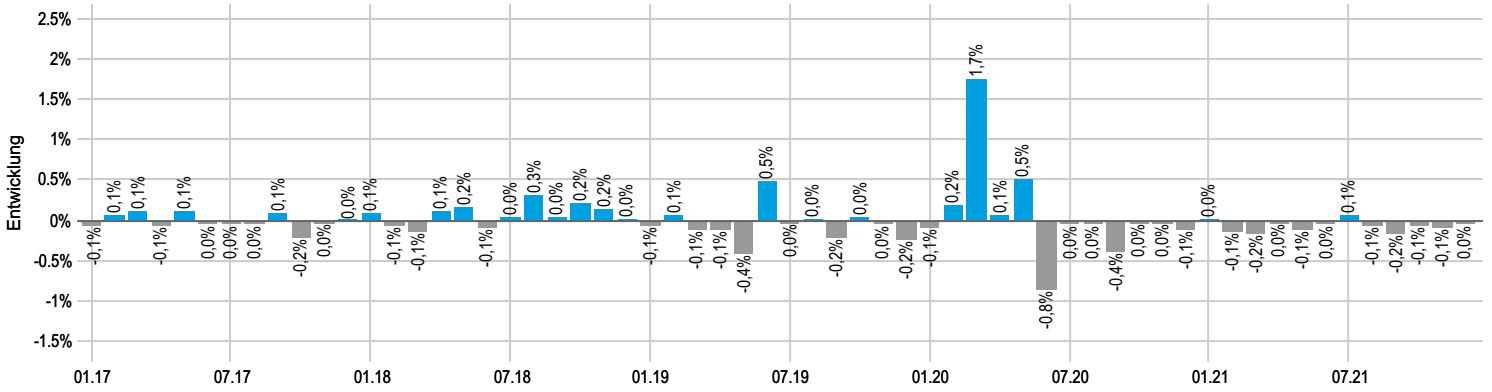
Branchen

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
Telekommunikation	13,8	11,8	2,1	0,5	0,4
Automobilindustrie	11,6	9,9	1,7	0,4	0,3
Grundstoffindustrie	8,0	8,2	-0,1	0,3	0,2
Dienstleistungen	7,3	6,0	1,3	0,2	0,2
Gesundheitswesen	7,1	5,8	1,3	0,3	0,2
Einzelhandel	6,3	7,1	-0,9	0,2	0,2
Freizeit	5,8	3,9	1,8	0,1	0,1
Finanzdienstleistungen	5,3	5,1	0,2	0,2	0,2
Investitionsgüter	5,2	5,9	-0,7	0,2	0,2
Immobilien	4,5	4,9	-0,4	0,2	0,2
Transport	4,4	5,9	-1,6	0,2	0,2
Andere	16,1	25,4	-9,3	0,7	1,0
Barmittel ähnlich	4,1	--	4,1	--	--
Cash einschl. FFX	0,5	0,0	0,5	--	--
Summe	100,0	100,0	--	3,5	3,4

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 © 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	8,2	9,3	6,6	7,5
Relative Volatilität	0,9	--	0,9	--
Tracking Error	1,3	--	1,1	--
Sharpe-Ratio	0,8	--	0,7	--
Information Ratio	0,1	--	0,5	--
Beta	0,9	--	0,9	--
Sortino Ratio	1,0	--	0,9	--
Jensen-Alpha	0,9	--	1,0	--
Annualisiertes Alpha	0,8	--	0,9	--
Alpha	0,1	--	0,1	--
Max. Drawdown	-12,4	-14,6	-12,4	-14,6
R ²	99,4	--	99,2	--

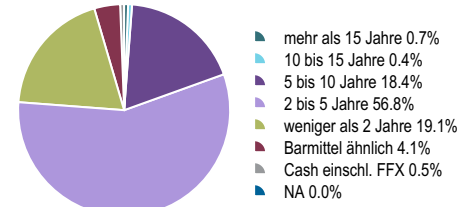
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

Portfolio-Statistik

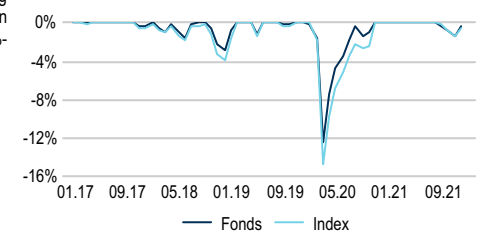
	Fonds	Index
Modifizierte Duration	4,1	4,0
Effektive Duration	3,5	3,4
Durchschnittlicher Kupon	3,8	3,6
Yield-to-Worst	2,9	3,1
Credit Rating Linear	BB	BB-
Optionsbereinigter Spread	321,2	342,2

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

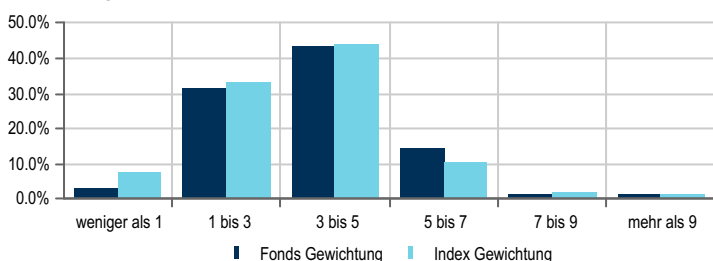


Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

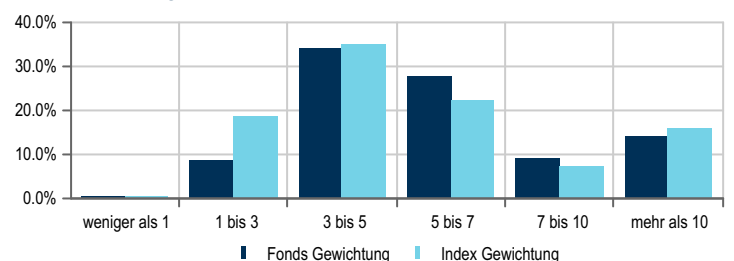
	Abweich. durchschnittl. Gewicht.	Fonds Gesamtertrag	Index Gesamtertrag	Rel. Gesamtertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung		
						Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamteffekt
Telekommunikation	2,0	3,5	2,3	1,1	-0,9	0,0	0,2	0,1
Automobilindustrie	0,5	4,9	4,2	0,7	1,0	0,0	0,1	0,1
Grundstoffindustrie	-1,1	4,4	5,0	-0,5	1,7	0,0	0,0	-0,1
Dienstleistungen	1,3	5,4	5,6	-0,2	2,3	0,0	0,0	0,0
Gesundheitswesen	1,7	3,4	3,3	0,1	0,1	0,0	0,0	0,0
Einzelhandel	-0,2	8,6	7,0	1,5	3,6	0,0	0,1	0,1
Finanzdienstleistungen	0,0	4,6	5,8	-1,2	2,5	0,0	-0,1	-0,1
Investitionsgüter	-0,5	2,6	3,5	-0,8	0,3	0,0	-0,1	-0,1
Immobilien	0,3	-2,0	0,3	-2,3	-2,8	0,0	-0,1	-0,1
Transport	-0,4	4,6	5,4	-0,7	2,1	0,0	0,0	0,0
Versorger	-1,9	1,4	3,2	-1,8	0,0	0,0	-0,1	-0,1
Bankwesen	-1,3	3,8	2,0	1,8	-1,2	0,0	0,0	0,0
Summe	--	3,0	3,2	-0,2	--			-0,2

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-/Übergewichtung 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



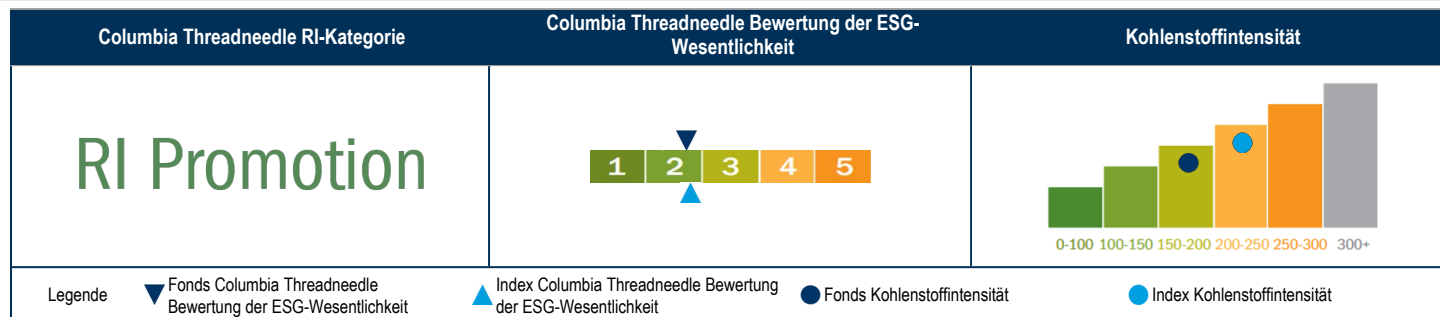
Jahre bis zur Fälligkeit



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

Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

	Fonds	Index	Ausrichtung
Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit Gewichteter Durchschnitt (1 = höchste Qualität, 5 = niedrigste Qualität)	2,68	2,77	+0,09
Kohlenstoffintensität Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	183,05	248,92	+65,86
Engagement in kontroversen Unternehmen Engagement in kontroversen Titeln ¹	--	4,26%	+4,26%
ESG-Score von MSCI Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	5,26	5,32	-0,06



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/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 Marktängigkeit 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%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829334579	BF50YF2	THEH1EE LX A2JN8N
1EP	Inc	Nein	EUR	Gross	1,38%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829332524	BF50XV1	THE1EPE LX A2JN74
2E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,82%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1849561953	BD2Z4P6	THEH2EE LX A2JP80
2EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,82%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1849562092	BD2Z4Q7	THE2EPE LX A2JP81
3E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,77%	31.03.21	3,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829333415	BF50Y30	THEH3EE LX A2JN8C
3EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,77%	31.03.21	3,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829333506	BF50Y41	THE3EPE LX A2JN8D
8E	Acc	Nein	EUR	Gross	0,86%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829332953	BF50XY4	THEH8EE LX A2JN77
8EP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,86%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	--	29.08.18	LU1829333092	BF50XZ5	THE8EPE LX A2JN78
AE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,55%	31.03.21	3,00%	0,00%	0,21%	2.500	05.05.20	LU2132999991	BLCHC76	THEHYAE LX A2P1F6
IE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,85%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	100.000	29.08.18	LU1849563736	BD2ZNV6	THEHIEE LX A2JP9H
IEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,85%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,21%	100.000	29.08.18	LU1849563819	BD2ZNX7	THEIEPE LX A2JP9J
ZE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,90%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,21%	1.500.000	29.08.18	LU1849563579	BD2ZNT3	THEHZEE LX A2JP9F
ZEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,90%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,21%	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 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.

„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.“