

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:



Richard Colwell  
Seit Okt 16

Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.

Auflegungsdatum des Fonds: 05.10.16

Index:

FTSE All-Share

Vergleichsgruppe: Morningstar Category UK Equity Income

Fondswährung: GBP

Fondsdomizil: Luxemburg

Fondsvolumen: £227,4m

Anzahl der Wertpapiere: 42

Preis der Anteilsklasse: 12,6398

Alle Angaben in GBP

## 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](http://corporate.morningstar.com/US/documents/MethodologyDocuments/MethodologyPapers/MorningstarFundRating_Methodology.pdf)

## Anlageziel und -politik

Der Fonds zielt darauf ab, Erträge zu erzielen, die das Potenzial haben, den von Ihnen investierten Betrag langfristig zu erhöhen.

Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in Anteile von Unternehmen im Vereinigten Königreich oder von Unternehmen, die dort eine wesentliche Geschäftstätigkeit ausüben.

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 FTSE All-Share 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 Fondspersformance 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 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 Fonds stellt unser britisches Kernangebot für Aktien erträge dar. Er hält für gewöhnlich 45 bis 60 Positionen in britischen Unternehmen und hat das Ziel, eine Dividendenrendite zu erwirtschaften, die auf dreijähriger rollierender Basis den Index übertrifft. Der Portfoliomanager kann bedeutende Titel- und Sektorpositionen eingehen.

Der Fonds wird mit Ausrichtung auf die Gesamtrendite verwaltet, nicht nur auf die Erträge. Die Rendite wird auf Portfolioebene und nicht auf Aktienebene generiert. Dadurch kann der Fonds höherrentierliche Anlagen mit Dividenden- und/oder Kapitalzuwachsgelegenheiten kombinieren. Der Fonds setzt in der Regel keine ertragssteigernden Derivate ein und investiert nicht in Anleihen oder ausländische Aktien.

## 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.

### NIW seit Auflegung (GBP)



### Wertentwicklung im Kalenderjahr (GBP)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Anteilsklasse (netto)	18,1	-8,1	18,7	-7,6	6,2	--	--	--	--	--
Vergleichsgruppe (netto)	16,0	-12,4	21,8	-13,8	7,2	--	--	--	--	--
Percentil	24%	11%	71%	11%	63%	--	--	--	--	--
Quartil	1	1	3	1	3	--	--	--	--	--
Fonds (brutto)	20,0	-6,6	20,4	-6,3	7,7	--	--	--	--	--
Index (brutto)	18,3	-9,8	19,2	-9,5	13,1	--	--	--	--	--

### Annualisierte Wertentwicklung (GBP)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	Seit Aufl.
Anteilsklasse (netto)	4,0	3,7	5,6	18,1	18,1	4,2	8,9	4,8	4,7
Vergleichsgruppe (netto)	4,7	4,0	5,5	16,0	16,0	1,1	7,8	4,2	3,9
Percentil	93%	54%	47%	24%	24%	11%	11%	26%	26%
Quartil	4	3	2	1	1	1	1	2	2
Fonds (brutto)	4,1	4,1	6,5	20,0	20,0	5,9	10,5	6,4	6,2
Index (brutto)	4,7	4,2	6,5	18,3	18,3	3,3	8,3	5,4	5,6

Wertentwicklung seit Auflegung von: 06.10.16

### Rollierend 12M (GBP)

	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)	18,1	-8,1	18,7	-7,6	6,2	--	--	--	--	--
Vergleichsgruppe (netto)	16,0	-12,4	21,8	-13,8	7,2	--	--	--	--	--
Percentil	24%	11%	71%	11%	63%	--	--	--	--	--
Quartil	1	1	3	1	3	--	--	--	--	--
Fonds (brutto)	20,0	-6,6	20,4	-6,3	7,7	--	--	--	--	--
Index (brutto)	18,3	-9,8	19,2	-9,5	13,1	--	--	--	--	--

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.

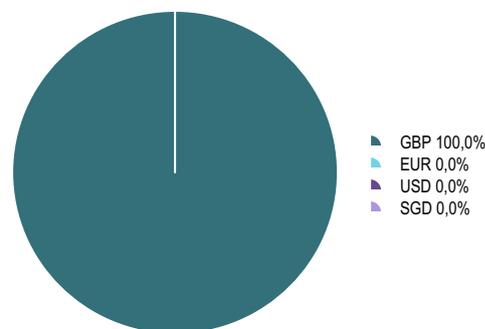
Die Morningstar-Kategorien für Fonds aus dem Anlageuniversum Europa/Asien/Afrika enthalten Fonds, die in Europa ansässig sind und/oder an europäischen Märkten gehandelt werden. Morningstar überprüft regelmäßig die Struktur der Kategorien und die Fonds innerhalb jeder Kategorie, um sicherzustellen, dass 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	
AstraZeneca PLC	8,4	5,4	Gesundheit
Electrocomponents plc	8,2	0,2	Industrie
GlaxoSmithKline plc	5,8	3,2	Gesundheit
Rentokil Initial plc	5,4	0,4	Industrie
Imperial Brands PLC	4,5	0,6	Nichtzykl. Konsumgüter
3i Group plc	4,0	0,6	Finanzen
Ferguson Plc	3,8	1,2	Industrie
Phoenix Group Holdings plc	3,7	0,2	Finanzen
RELX PLC	3,2	1,8	Zyklische Konsumgüter
Unilever PLC	2,9	4,0	Nichtzykl. Konsumgüter
<b>Summe</b>	<b>49,8</b>	<b>17,5</b>	

## 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.
Industrie	35,1	13,4	21,6
Zyklische Konsumgüter	15,4	11,9	3,5
Finanzen	14,5	22,5	-8,0
Gesundheit	14,2	9,8	4,4
Nichtzykl. Konsumgüter	12,2	14,9	-2,7
Versorger	3,0	3,3	-0,2
Telekommunikation	2,5	2,0	0,6
Grundstoffe	2,0	9,3	-7,3
Energie	--	7,9	-7,9
Immobilien	--	3,3	-3,3
Technologie	--	1,6	-1,6
Barmittel ähnlich	0,3	--	0,3
Barmittel	0,7	--	0,7

## Top 10 Übergewichtung/Untergewichtung (%)

Übergewichtung	Fonds	Index	Diff.	Untergewichtung	Fonds	Index	Diff.
Electrocomponents plc	8,2	0,2	7,9	Royal Dutch Shell	--	5,0	-5,0
Rentokil Initial plc	5,4	0,4	5,0	Diageo plc	--	3,7	-3,7
Imperial Brands PLC	4,5	0,6	3,9	HSBC Holdings Plc	--	3,7	-3,7
Phoenix Group Holdings plc	3,7	0,2	3,5	BP p.l.c.	--	2,6	-2,6
3i Group plc	4,0	0,6	3,4	British American Tobacco p.l.c.	--	2,5	-2,5
AstraZeneca PLC	8,4	5,4	3,0	Rio Tinto plc	--	2,1	-2,1
Ferguson Plc	3,8	1,2	2,6	Glencore plc	--	2,0	-2,0
GlaxoSmithKline plc	5,8	3,2	2,6	BHP Group Ltd	--	1,8	-1,8
Marks and Spencer Group plc	2,7	0,2	2,6	Reckitt Benckiser Group plc	--	1,6	-1,6
Pearson PLC	2,5	0,2	2,3	National Grid plc	--	1,5	-1,5

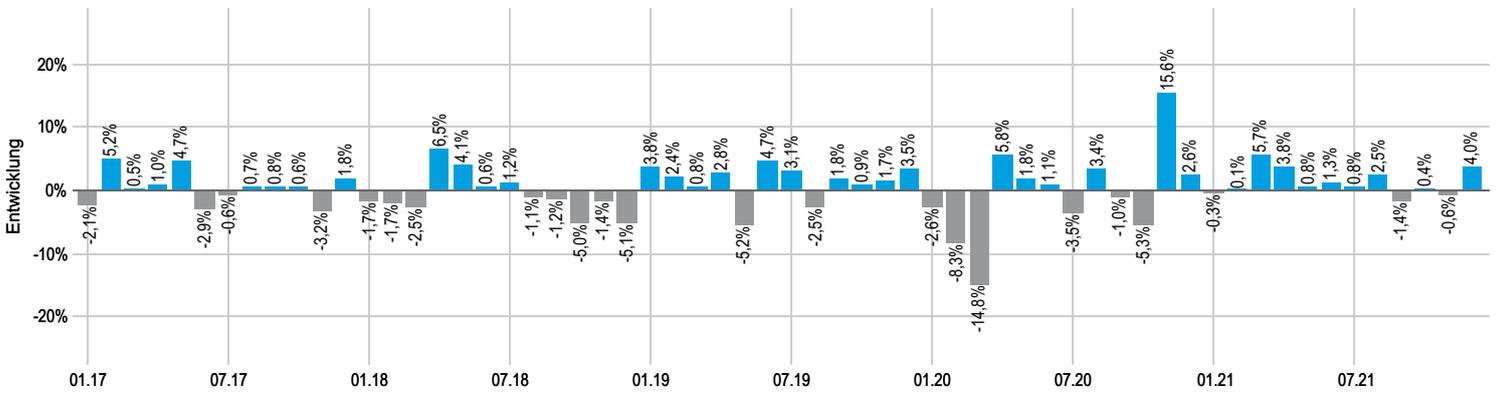
## Größte Änderungen bei den Positionen über 3 Monate

Wertpapier	3M Veränd.
Wm Morrison Supermarkets plc	-5,4
Tesco PLC	1,0
Electrocomponents plc	0,8
Ferguson Plc	0,8
Marks and Spencer Group plc	0,7
GlaxoSmithKline plc	0,7
3i Group plc	0,4
AstraZeneca PLC	-0,4
Smiths Group Plc	0,4
BT Group plc	0,4

## 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								
Electrocomponents plc	8,0	12,6	0,9	0,2	12,5	0,6	Johnson Matthey Plc	1,6	-23,0	-0,4	0,2	-23,0	-0,4	Electrocomponents plc	8,0	12,6	0,9	0,2	12,5	0,6	Johnson Matthey Plc	1,6	-23,0	-0,4	0,2	-23,0	-0,4
Ferguson Plc	3,4	28,1	0,9	1,1	28,2	0,5	Pearson PLC	2,4	-14,1	-0,4	0,2	-13,9	-0,4	Ferguson Plc	3,4	28,1	0,9	1,1	28,2	0,5	Pearson PLC	2,4	-14,1	-0,4	0,2	-13,9	-0,4
Marks and Spencer Group plc	2,5	24,2	0,5	0,2	26,1	0,4	Hays plc	2,3	-10,5	-0,3	0,1	-9,6	-0,3	Marks and Spencer Group plc	2,5	24,2	0,5	0,2	26,1	0,4	Hays plc	2,3	-10,5	-0,3	0,1	-9,6	-0,3
3i Group plc	3,8	14,8	0,5	0,5	14,6	0,3	HSBC Holdings Plc	--	--	--	3,6	15,0	-0,3	3i Group plc	3,8	14,8	0,5	0,5	14,6	0,3	HSBC Holdings Plc	--	--	--	3,6	15,0	-0,3
GlaxoSmithKline plc	5,6	15,9	0,9	3,1	15,9	0,3	Diageo plc	--	--	--	3,5	11,9	-0,3	GlaxoSmithKline plc	5,6	15,9	0,9	3,1	15,9	0,3	Diageo plc	--	--	--	3,5	11,9	-0,3
Prudential plc	--	--	--	1,6	-12,4	0,3	Rentokil Initial plc	5,7	0,0	0,0	0,5	0,1	-0,2	Prudential plc	--	--	--	1,6	-12,4	0,3	Rentokil Initial plc	5,7	0,0	0,0	0,5	0,1	-0,2
Royal Dutch Shell	--	--	--	5,3	-0,9	0,3	National Grid plc	--	--	--	1,4	21,9	-0,2	Royal Dutch Shell	--	--	--	5,3	-0,9	0,3	National Grid plc	--	--	--	1,4	21,9	-0,2
Flutter Entertainment Plc	--	--	--	0,8	-19,9	0,2	Wm Morrison Supermarkets plc	1,3	-2,6	-0,2	0,1	-2,8	-0,2	Flutter Entertainment Plc	--	--	--	0,8	-19,9	0,2	Wm Morrison Supermarkets plc	1,3	-2,6	-0,2	0,1	-2,8	-0,2
Oxford Instruments plc	2,1	15,4	0,3	0,1	15,6	0,2	AstraZeneca PLC	8,6	-3,1	-0,2	5,5	-3,1	-0,2	Oxford Instruments plc	2,1	15,4	0,3	0,1	15,6	0,2	AstraZeneca PLC	8,6	-3,1	-0,2	5,5	-3,1	-0,2
Centrica plc	1,2	26,1	0,3	0,2	26,1	0,2	BHP Group Ltd	--	--	--	1,7	16,5	-0,2	Centrica plc	1,2	26,1	0,3	0,2	26,1	0,2	BHP Group Ltd	--	--	--	1,7	16,5	-0,2

## Monatliche Nettowertentwicklung



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 Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.

## Risikoanalyse

	3 J		5 J	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Absolute Volatilität	16,1	15,6	14,1	13,6
Relative Volatilität	1,0	-	1,0	-
Tracking Error	3,9	-	4,1	-
Sharpe-Ratio	0,6	-	0,4	-
Information Ratio	0,6	-	0,2	-
Beta	1,0	-	1,0	-
Sortino Ratio	0,9	-	0,6	-
Jensen-Alpha	2,1	-	1,0	-
Annualisiertes Alpha	2,0	-	1,0	-
Alpha	0,2	-	0,1	-
Max. Drawdown	-23,7	-25,1	-23,7	-25,1
R <sup>2</sup>	94,1	-	91,6	-

Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

## Portfolio-Statistik

	Fonds	Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis	13,6	13,9
Geschäftsjahr 1		
Kurs-Buchwert-Verhältnis	2,5	1,8
Gesamtkapitalrendite	1,5	0,4
Eigenkapitalrendite	14,6	11,3
Active Share	76,8	-

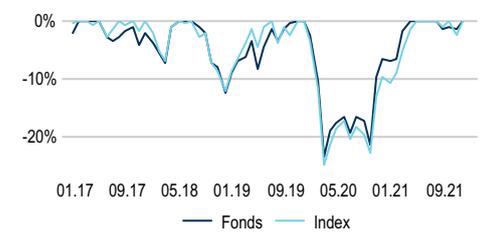
Die Analysen basieren auf globalen Bewertungen zum Börsenschluss unter Verwendung von durch Columbia Threadneedle Investments ermittelten Marktattributen. Die Daten für zugrunde liegende Wertpapiere können vorläufig sein oder auf Schätzungen basieren. Die Gewichtungen der Marktkapitalisierung umfassen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

## Marktkapitalisierungsübersicht



Währung: GBP

## Drawdown



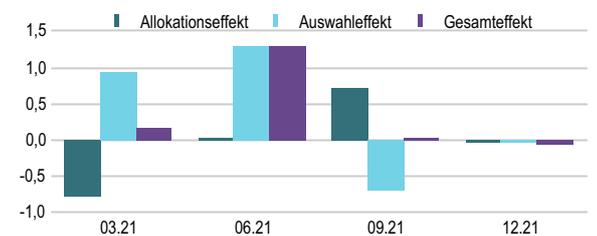
## Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

	Abweich. durchschnittl. Gewicht.	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Rel. Gesamt-ertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung		
						Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Grundstoffe	-7,0	-7,3	22,6	-24,3	3,6	-0,3	-0,6	-0,9
Zyklische Konsumgüter	2,6	15,3	13,8	1,3	-3,8	-0,1	0,2	0,1
Verbraucherservice	3,0	65,9	184,6	-41,7	140,5	1,4	0,1	1,5
Nichtzykl. Konsumgüter	-3,7	7,1	9,8	-2,4	-7,2	0,4	-0,3	0,1
Energie	-7,1	8,5	31,1	-17,3	10,8	-2,4	1,6	-0,8
Finanzen	-8,9	11,6	14,2	-2,3	-3,5	0,3	-0,4	-0,1
Gesundheit	4,0	23,3	21,0	1,9	2,3	0,2	0,3	0,4
Industrie	19,4	26,9	26,3	0,4	6,8	1,2	0,1	1,3
Immobilien	-3,1	-	28,8	-22,3	8,8	-0,3	-	-0,3
Technologie	-1,8	-	10,0	-9,1	-7,0	0,1	-	0,1
Telekommunikation	0,0	29,5	8,0	19,9	-8,7	0,0	0,4	0,4
Versorger	-0,2	36,5	28,2	6,5	8,4	0,0	0,2	0,2
<b>Summe</b>	-	<b>20,0</b>	<b>18,3</b>	<b>1,4</b>	-	<b>0,0</b>	<b>1,5</b>	<b>1,4</b>

## 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	5,4	5,2	-0,8	0,9	0,2
Mrz-21 - Juni-21	7,0	5,6	0,0	1,3	1,3
Juni-21 - Sept-21	2,3	2,2	0,7	-0,7	0,0
Sept-21 - Dez-21	4,1	4,2	0,0	0,0	-0,1

## Gesamteffekte über 3 Monate

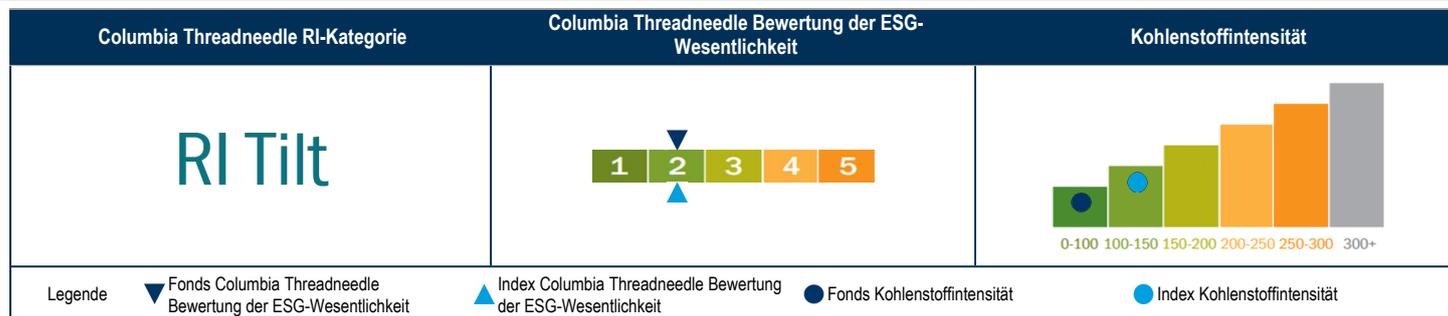


Die Erträge werden auf täglicher geometrischer Basis berechnet, sofern nicht anders angegeben. Fondserträge können aufgrund von Daten- und Berechnungsmethoden beim Vergleich mit geometrisch zugeordneten Gesamtrenditen zu Residualfaktoren führen. Die Änderung bei den Gewichtungen ist die durchschnittliche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

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
<b>Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit</b> Gewichteter Durchschnitt (1 = höchste Qualität, 5 = niedrigste Qualität)	2,49	2,54	+0,05
<b>Kohlenstoffintensität</b> Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	55,50	130,32	+74,82
<b>Engagement in kontroversen Unternehmen</b> Engagement in kontroversen Titeln <sup>1</sup>	--	7,50%	+7,50%
<b>ESG-Score von MSCI</b> Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	7,98	7,65	+0,33



Bestimmte Informationen ©2021 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 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 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
1EH	Acc	Ja	EUR	Gross	1,64%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,15%	--	16.10.18	LU1868840601	BFNQZ15	TUE1EHE LX A2N4VT
3EH	Acc	Ja	EUR	Gross	0,88%	31.03.21	3,00%	0,00%	0,15%	--	16.10.18	LU1868878163	BFNQZ60	TUE3EHE LX A2N4VY
AE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,06%	2.500	05.10.16	LU1475748437	BZ4CRK5	THUEIAE LX A2AQE2
AEC	Inc	Ja	EUR	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,15%	2.500	05.10.16	LU1487255439	BD8DRH7	TUKEAEC LX A2ARGN
AEH	Acc	Ja	EUR	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,15%	2.500	05.10.16	LU1475748510	BZ4CRL6	TUEIAEH LX A2AQE3
AG	Acc	Nein	GBP	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,06%	2.000	05.10.16	LU1495961192	BD843C7	THUEIAG LX A2ASBA
IE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,85%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,06%	100.000	05.10.16	LU1475748866	BZ4CRS3	THUEIIE LX A2AQE6
IEH	Acc	Ja	EUR	Gross	0,85%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,15%	100.000	05.10.16	LU1475748940	BZ4CRT4	TUEIEH LX A2AQE6
IGP	Inc	Nein	GBP	Gross	0,85%	31.03.21	0,00%	0,00%	0,06%	100.000	05.10.16	LU1475749161	BZ4CRW7	TUEIIGP LX A2AQE9
ZE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,06%	1.500.000	05.10.16	LU1475749674	BZ4CS02	THUEIZE LX A2AQFD
ZEH	Acc	Ja	EUR	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,15%	1.500.000	05.10.16	LU1487256080	BD8DRM2	TUKEZEH LX A2ARGS
ZG	Acc	Nein	GBP	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,06%	1.000.000	05.10.16	LU1487256163	BD8DRL1	TUKEIZG LX A2ARGR
ZGP	Inc	Nein	GBP	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	0,00%	0,06%	1.000.000	05.10.16	LU1475749591	BZ4CRZ0	TUEIZGP LX A2AQFC

Anteilsklassenbezeichnung: Beginnend mit einer Ziffer – nur verfügbar für bestehende Anleger. Beginnend mit einem Buchstaben – verfügbar für 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](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 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](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: London Stock Exchange Group plc und ihre Konzernunternehmen (zusammen die „LSE Group“). © LSE Group 2021. FTSE Russell ist ein Handelsname bestimmter Unternehmen der LSE Group. FTSE®, Russell®, FTSE Russell®, MTS®, FTSE4Good®, ICB®, Mergent® und The Yield Book® sind Handelsmarken der maßgeblichen Unternehmen der LSE Group und werden von anderen Unternehmen der LSE Group unter Lizenz verwendet. Alle Rechte an den FTSE Russell-Indizes oder -Daten liegen bei dem jeweiligen Unternehmen der LSE Group, das Eigentümer des Index bzw. der Daten ist. Weder die LSE Group noch deren Lizenzgeber haften für Fehler oder Auslassungen in den Indizes oder Daten und keine Partei kann sich auf die in dieser Mitteilung enthaltenen Indizes oder Daten berufen. Eine weitere Verbreitung von Daten der LSE Group ist nur mit ausdrücklicher schriftlicher Zustimmung des jeweiligen Unternehmens der LSE Group gestattet. Der Inhalt dieser Mitteilung wird von der LSE Group nicht gefördert, beworben oder unterstützt.