CT (LUX) GLOBAL SMALLER COMPANIES (FONDS) KLASSE AE EUR (ISIN:LU0570870567)

FACTSHEET - PROFESSIONELLE ANLEGER - ALLE DATEN ZUM 31 MÄRZ 2024

COLUMBIA THREADNEEDLE INVESTMENTS

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

Kontaktdaten

Tel: +352 46 40 10 7190*
columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com
* Bitte beachten Sie, dass Anrufe und elektronische Kommunikation aufgezeichnet werden können.
IFDS, 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

Wichtige Daten

Fondsmanager:

Scott Woods
Seit Apr 19

Verwaltungsgesellschaft:	Threadneedle Man. Lux. S.A.
Umbrella-Fonds:	Columbia Threadneedle (Lux) I
SFDR-Kategorie:	Artikel 8
Auflegungsdatum des Fonds:	03.03.11
Index:	MSCI World Small Cap
Vergleichsgruppe:	Morningstar Category Global Small/ Mid-Cap Equity
Fondswährung:	USD
Fondsdomizil:	Luxemburg
Fondsvolumen:	€2.081,8m
Anzahl der Wertpapiere:	80
Preis der Anteilsklasse:	47,2793
Anlagestil:	Der Fonds ist derzeit gegenüber seinem Vergleichsindex auf eine wachstumsorientierte Anlagestrategie ausgerichtet. Das bedeutet, dass der Fonds überwiegend in Unternehmen investiert, die im Vergleich zum Vergleichsindex überdurchschnittliche Wachstumsraten oder ein gutes Wachstumspotenzial (basierend auf Indikatoren wie Gewinn- und Umsatzwachstum) aufweisen. Die Anlagestrategie eines Fonds kann sich im Laufe der Zeit ändern.

Am 20. November 2023 wurde der Fondsname von Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies zu CT (Lux) Global Smaller Companies geändert.

Ratings/Auszeichnungen

MORNINGSTAR ★★★★

© 2023 Morningstar. All Rights Reserved. The information contained herein: (1) is proprietary to Morningstar and/or its content providers; (2) may not be copied or distributed; and (3) is not warranted to be accurate, complete or timely. Neither Morningstar nor its content providers are responsible for any damages or losses arising from any use of this information. Past performance is no guarantee of future results. For more detailed information about Morningstar Rating, including its methodology, please go to: http://corporate.morningstar.com/US/documents/MethodologyDocuments/MethodologyPapers/MorningstarFundRating_Methodology.pdf

SCOPE (B) Fonds Rating

Quelle: Scope Analysis GmbH, www.ScopeExplorer.com

Nur zur Verwendung durch CTI: SXESAA
Alle Angaben in EUR

Anlageziel und -politik

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

Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in kleinere Unternehmen weltweit. Diese Unternehmen sind in der Regel nicht größer als das größte Unternehmen im MSCI World Small Cap Index.

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

Der Fonds wird aktiv in Bezug auf den MSCI World Small Cap Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die der Fonds investiert, und bietet eine geeignete Zielbenchmark, anhand derer die Fondsperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. 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 bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem er eine Reihe von Maßnahmen für verantwortungsbewusstes Investieren in den Anlageprozess einbezieht und sicherstellt, dass die Unternehmen, in die er investiert, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Der Fonds ist bestrebt, über rollierende 12-Monatszeiträume im Vergleich zum Index positiv abzuschneiden, wenn er anhand des Columbia Threadneedle ESG (Environmental, Social and Governance) Materiality Rating Modells bewertet wird, das angibt, wie stark ein Unternehmen wesentlichen ESG-Risiken und Chancen ausgesetzt ist. Mindestens 50 % des Fonds sind in Unternehmen mit einem hohen Rating investiert. Der Fonds verpflichtet sich außerdem, mindestens 5 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Der Fonds schließt Unternehmen aus, die bestimmte Einnahmen aus Branchen wie unter anderem der Kohle- und Tabakbranche erzielen. Er schließt außerdem Unternehmen aus, die direkte Verbindungen zu nuklearen oder umstrittenen Waffen aufweisen, und Unternehmen, bei denen Verstöße gegen internationale Standards und Grundsätze festgestellt wurden. Der Fondsmanager arbeitet mit Unternehmen zusammen, um eine Verbesserung ihrer ESG-Praktiken zu fördern.

Weitere Informationen zu den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen sind im SFDR RTS-Anhang des Prospekts unter www.columbiathreadneedle.com zu finden. Der Fonds fällt in den Anwendungsbereich von Artikel 8 der SFDR.

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 hält Vermögenswerte, die eventuell schwer zu verkaufen sein könnten. Der Fonds muss eventuell den Verkaufspreis senken, andere Anlagen verkaufen oder auf attraktivere Anlagemöglichkeit verzichten.
- Der Fonds kann in Derivate investieren (komplexe Instrumente, die an den Anstieg und Rückgang des Wertes anderer Vermögenswerte gekoppelt sind), mit dem Ziel, das Risiko zu reduzieren oder die Transaktionskosten zu minimieren. Solche Derivatgeschäfte können die Wertentwicklung des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Der Manager beabsichtigt nicht, dass sich ein solcher Einsatz von Derivaten auf das Gesamtrisikoprofil des Fonds auswirkt.
- Eine Ausrichtung auf den Anlagestil kann sich positiv oder negativ auf die Performance eines Fonds im Vergleich zu seiner Benchmark auswirken. Kein Anlagestil schneidet unter allen Marktbedingungen gut ab. Wenn ein Stil beliebt ist, kann ein anderer Stil in Ungnade fallen. Solche Zustände können für kurze oder lange Zeiträume bestehen bleiben. Ein Fonds weist im Vergleich zu seiner Benchmark eine Ausrichtung auf den Wachstumsstil auf, wenn die Mehrheit des Fonds in Unternehmen mit überdurchschnittlichen Wachstumsraten oder gutem Wachstumspotenzial (basierend auf Indikatoren wie Gewinn- und Umsatzwachstum) im Vergleich zu seiner Benchmark investiert. Es gibt jedoch keine Garantie dafür, dass solche Unternehmen auch in Zukunft weiterhin solche Merkmale aufweisen. Auch der Anlagestil eines Fonds kann sich im Laufe der Zeit ändern.
- Der Fonds wendet im Rahmen seiner Berücksichtigung von ESG-Faktoren eine Reihe von Maßnahmen an, einschließlich des Ausschlusses von Investitionen in bestimmte Branchen und/oder Aktivitäten. Dies schränkt das Anlageuniversum ein und kann sich positiv oder negativ auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zu einer Benchmark oder anderen Fonds ohne solche Beschränkungen auswirken.
- Der Fonds trägt aufgrund der Zusammenstellung seines Portfolios bzw. der eingesetzten Portfoliomanagement-Techniken für gewöhnlich das Risiko hoher Volatilität. Dies bedeutet, dass der Wert des Fonds häufiger und unter Umständen beträchtlicher als der Wert anderer Fonds sinkt und steigt.
- Die derzeit als für den Fonds maßgeblich identifizierten Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ dargelegt.

Anlageansatz

Die Fähigkeit von Qualitätsunternehmen, hohe Kapitalrenditen und ein überdurchschnittliches Wachstum aufrechtzuerhalten, wird häufig unterschätzt, was bedeutet, dass potenzielle langfristige Gewinner mit einem Abschlag gegenüber ihrem inneren Wert gehandelt werden.

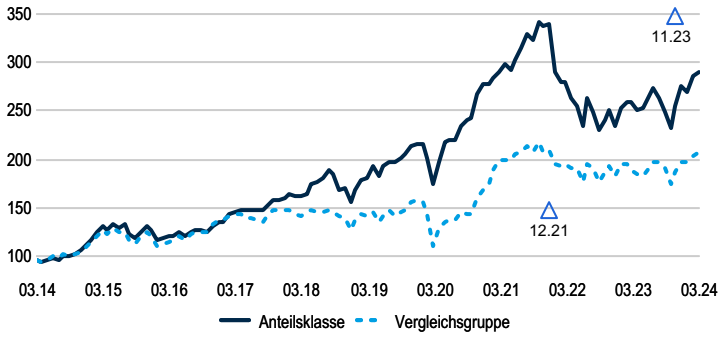
Wir suchen nach Qualitätsaktien, die über dauerhafte Wettbewerbsvorteile und robuste Geschäftsmodelle verfügen und somit ein starkes und nachhaltiges langfristiges Wachstumspotenzial aufweisen. Das globale Aktienteam analysiert sowohl die Fundamentaldaten der Unternehmen als auch die Branchenaussichten gründlich. Wir verwenden einen Research-Rahmen, um die Quellen und die Nachhaltigkeit der Wettbewerbsvorteile von Unternehmen zu identifizieren, wobei die ESG-Analyse im Mittelpunkt dieses Ansatzes steht. (ESG steht für Environmental, Social & Governance und bedeutet Umwelt, Soziales und Unternehmensführung.)

Wir arbeiten eng mit unseren regionalen Small-Cap-Aktienteams, dem globalen zentralen Researchteam und den Teams für verantwortungsvolle Anlagen auf der ganzen Welt zusammen, um ein überzeugungsgesteuertes, ideenreiches Portfolio mit einigen der besten Unternehmen der Welt aufzubauen. Wir suchen nicht nur nach Unternehmen mit den höchsten Renditen, sondern auch nach solchen, die entweder stabil sind oder sich verbessern und nachhaltig sind. Da wir einen offenen Ansatz verfolgen, ist die Titelauswahl maßgeblich für die Gewichtungen der Sektoren und Regionen, und wir sind davon überzeugt, dass wir durch unseren Fokus auf Unternehmen mit starken Fundamentaldaten bei unterschiedlichen Marktbedingungen für eine Outperformance sorgt.

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 Fondsänderungen finden Sie im PDF „Wesentliche Ereignisse – Columbia Threadneedle Luxemburg-domizilierten SICAV-Fonds“, verfügbar unter https://www.columbiathreadneedle.com/en/changes

Wertentwicklung im Kalenderjahr (EUR)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Anteilsklasse (netto)	17,8	-30,7	22,1	27,5	38,4	-3,1	18,4	5,8	14,2	16,7
Vergleichsgruppe (netto)	11,8	-16,1	25,4	5,0	27,6	-11,3	8,0	12,4	12,2	15,2
Percentil	11%	89%	73%	6%	7%	2%	5%	79%	27%	20%
Quartil	1	4	3	1	1	1	1	4	2	1
Fonds (brutto)	19,8	-29,4	24,3	29,3	40,1	-0,9	21,1	7,4	16,8	19,1
Index (brutto)	12,4	-13,0	25,0	6,9	29,1	-9,1	8,2	16,6	11,5	16,5

Annualisierte Wertentwicklung (EUR)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	10 J
Anteilsklasse (netto)	1,4	4,9	15,6	4,9	11,7	1,7	0,0	9,6	11,4
Vergleichsgruppe (netto)	3,6	6,5	13,8	6,5	15,2	3,3	3,6	8,5	7,8
Percentil	85%	67%	27%	67%	66%	66%	76%	12%	1%
Quartil	4	3	2	3	3	3	4	1	1
Fonds (brutto)	1,5	5,3	16,6	5,3	13,7	3,6	1,8	11,4	13,4
Index (brutto)	4,2	6,9	15,3	6,9	17,1	4,5	4,6	9,2	10,1

Rollierend 12M (EUR)

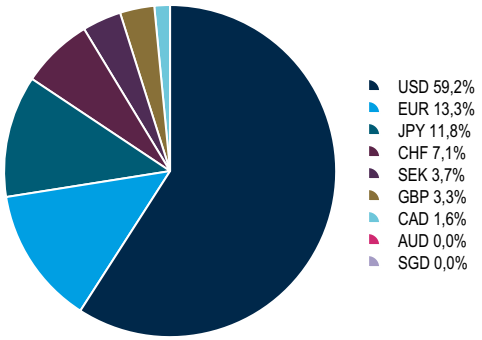
	04.23 - 03.24	04.22 - 03.23	04.21 - 03.22	04.20 - 03.21	04.19 - 03.20	04.18 - 03.19	04.17 - 03.18	04.16 - 03.17	04.15 - 03.16	04.14 - 03.15
Anteilsklasse (netto)	11,7	-7,3	-3,4	64,0	-3,7	12,4	10,4	19,5	-7,6	36,0
Vergleichsgruppe (netto)	15,2	-7,0	3,5	66,8	-20,6	3,7	0,7	23,1	-9,3	30,6
Percentil	66%	55%	81%	61%	7%	4%	5%	69%	24%	6%
Quartil	3	3	4	3	1	1	1	3	1	1
Fonds (brutto)	13,7	-5,5	-1,8	66,7	-2,4	14,1	13,1	21,6	-5,6	38,9
Index (brutto)	17,1	-6,7	4,9	70,1	-20,2	8,4	1,2	26,1	-9,0	33,4

Quelle Morningstar UK Limited © 2024, Stand 31.03.24. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.
Die Indexrenditen beinhalten Veräußerungsgewinne und gehen von der Wiederanlage etwaiger Erträge aus. Der Index enthält keine Gebühren oder Kosten und Sie können nicht direkt in den Index investieren.
Die Morningstar-Kategorien für Fonds aus dem Anlageuniversum Europa/Asien/Afrika enthalten Fonds, die in Europa ansässig sind und/oder an europäischen Märkten gehandelt werden. Morningstar überprüft regelmäßig die Struktur der Kategorien und die Fonds innerhalb jeder Kategorie, um sicherzustellen, dass das System den Erfordernissen der Anleger entspricht und mit den Marktentwicklungen Schritt hält. Die angebene 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 31.03.24. Portfoliorenditen vor Abzug von Gebühren sind zeitgewichtete Renditen ohne Berücksichtigung von Provisionen, Transaktionskosten und nicht rückforderbarer Steuern auf Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne unter Verwendung von Preisen für Anlagen, die entweder dem letzten Handelskurs oder einem Geldkurs entsprechen. Cashflows werden per Tagesende berücksichtigt und schließen Ein- und Ausstiegsgebühren aus.

Top 10 Positionen (%)

Wertpapier	Fonds	Index	
CTS Eventim AG & Co. KGaA	2,4	0,1	Kommunikationsdienste
SPX Technologies, Inc.	2,3	0,1	Industrie
Clean Harbors, Inc.	2,2	0,1	Industrie
Altair Engineering Inc. Class A	2,1	0,1	Informationstechnologie
Japan Elevator Service Holdings Co., Ltd.	2,1	0,0	Industrie
Ryman Hospitality Properties, Inc.	2,1	0,1	Immobilien
Intapp, Inc.	2,0	0,0	Informationstechnologie
WillScot Mobile Mini Holdings Corp. Class A	2,0	0,1	Industrie
Tecan Group AG	2,0	0,1	Gesundheit
Workiva Inc. Class A	1,9	0,1	Informationstechnologie
Summe	**21,1**	**0,7**	

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	34,4	20,6	13,8
Informationstechnologie	21,3	11,1	10,3
Gesundheit	10,8	9,7	1,0
Zyklische Konsumgüter	8,8	13,5	-4,7
Finanzen	8,6	14,9	-6,3
Nichtzykl. Konsumgüter	5,0	4,6	0,4
Rohstoffe	4,0	7,5	-3,5
Kommunikationsdienste	4,0	2,8	1,2
Immobilien	2,1	7,8	-5,7
Energie	--	5,1	-5,1
Versorger	--	2,4	-2,4
Barmittel ähnlich	0,6	--	0,6
Barmittel	0,5	--	0,5

Geografisch	Fonds	Index	Diff.
Vereinigte Staaten	58,5	60,9	-2,4
Japan	11,7	12,2	-0,5
Schweiz	7,1	1,6	5,5
Deutschland	5,4	1,6	3,8
Schweden	3,7	2,2	1,5
Grossbritannien	3,3	5,2	-1,8
Niederlande	2,3	0,6	1,7
Spanien	2,0	0,7	1,3
Italien	1,8	1,3	0,6
Kanada	1,6	3,7	-2,1
Belgien	0,9	0,4	0,4
Andere	0,5	9,6	-9,1
Barmittel ähnlich	0,6	--	0,6
Barmittel	0,5	--	0,5

Top 10 Übergewichtung/Untergewichtung (%)

Übergewichtung	Fonds	Index	Diff.
CTS Eventim AG & Co. KGaA	2,4	0,1	2,3
SPX Technologies, Inc.	2,3	0,1	2,2
Japan Elevator Service Holdings Co., Ltd.	2,1	0,0	2,1
Altair Engineering Inc. Class A	2,1	0,1	2,1
Clean Harbors, Inc.	2,2	0,1	2,1
Intapp, Inc.	2,0	0,0	2,0
Ryman Hospitality Properties, Inc.	2,1	0,1	2,0
Tecan Group AG	2,0	0,1	1,9
Workiva Inc. Class A	1,9	0,1	1,9
WillScot Mobile Mini Holdings Corp. Class A	2,0	0,1	1,9

Untergewichtung	Fonds	Index	Diff.
MicroStrategy Incorporated Class A	--	0,3	-0,3
EMCOR Group, Inc.	--	0,2	-0,2
Pure Storage, Inc. Class A	--	0,2	-0,2
Saia, Inc.	--	0,2	-0,2
Nutanix, Inc. Class A	--	0,2	-0,2
Lincoln Electric Holdings, Inc.	--	0,2	-0,2
XPO, Inc.	--	0,2	-0,2
TopBuild Corp.	--	0,2	-0,2
Toll Brothers, Inc.	--	0,2	-0,2
Floor & Decor Holdings, Inc. Class A	--	0,2	-0,2

Größte Änderungen bei den Positionen über 3 Monate

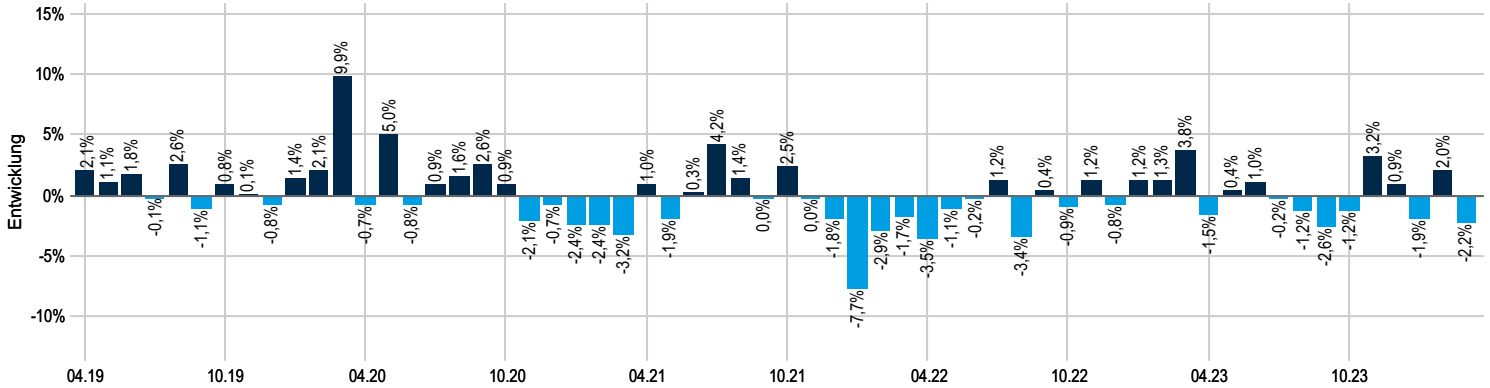
Wertpapier	3M Veränd.
Kokusai Electric Corporation	1,3
CONMED Corporation	-1,2
Remy Cointreau SA	-1,0
Vita Coco Company, Inc.	0,9
IMCD N.V.	-0,7
COMET Holding AG	0,7
CTS Eventim AG & Co. KGaA	0,7
TopBuild Corp.	-0,7
VAT Group AG	-0,6
Technoprobe SpA	-0,6

Zuordnung Top positive/negative Wertpapiere (3 Monate)

	Fonds			Index		Attri
Wertpapiername - 10 höchste	durch-schn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Beitrag zum Ertrag	durch-schn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Geo. Gesamt-effekt
CTS Eventim AG & Co. KGaA	2,0	31,6	0,6	0,1	31,7	0,4
Bruker Corporation	1,8	31,1	0,5	0,1	30,8	0,4
Freshpet Inc	1,6	36,5	0,5	0,1	36,6	0,4
SPX Technologies, Inc.	2,3	24,8	0,5	0,1	24,7	0,3
Armstrong World Industries, Inc.	1,6	29,5	0,4	0,1	29,5	0,3
Kadant Inc.	1,7	19,9	0,4	0,0	19,9	0,2
Core & Main, Inc. Class A	0,8	45,3	0,3	0,1	44,9	0,2
AAON, Inc.	1,7	22,1	0,4	0,1	22,1	0,2
ESAB Corporation	1,1	30,6	0,3	0,1	30,6	0,2
Clean Harbors, Inc.	1,9	17,9	0,3	0,1	18,0	0,2

	Fonds			Index		Attri
Wertpapiername - 10 niedrigste	durch-schn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Beitrag zum Ertrag	durch-schn. Gewicht.	Gesamt-ertrag	Geo. Gesamt-effekt
CONMED Corporation	0,9	-27,5	-0,4	0,0	-25,0	-0,4
Workiva Inc. Class A	1,9	-14,8	-0,3	0,1	-14,6	-0,4
SMS Co., Ltd.	1,7	-14,4	-0,3	0,0	-14,3	-0,4
Asahi Intecc Co., Ltd.	1,6	-13,3	-0,2	--	--	-0,3
Neogen Corp	1,1	-19,8	-0,3	0,0	-19,7	-0,3
SiTime Corporation	0,9	-21,9	-0,2	0,0	-21,9	-0,3
Genus plc	1,1	-17,1	-0,2	0,0	-17,1	-0,3
Intapp, Inc.	1,9	-7,7	-0,1	0,0	-7,7	-0,3
Cargojet Inc.	1,7	-6,2	-0,1	0,0	-6,1	-0,2
BELIMO Holding AG	1,5	-7,6	-0,1	0,1	-7,1	-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 derjenigen, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde.Quelle Morningstar UK Limited © 2024, Stand 31.03.24. 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	19,6	15,9	19,3	19,0
Relative Volatilität	1,2	--	1,0	--
Tracking Error	8,5	--	8,6	--
Sharpe-Ratio	0,0	--	0,6	--
Information Ratio	-0,3	--	0,3	--
Beta	1,1	--	0,9	--
Sortino Ratio	0,1	--	0,9	--
Jensen-Alpha	-3,3	--	2,9	--
Annualisiertes Alpha	-2,7	--	3,0	--
Alpha	-0,2	--	0,2	--
Max. Drawdown	-31,3	-15,6	-31,3	-28,4
R^2	82,1	--	80,8	--

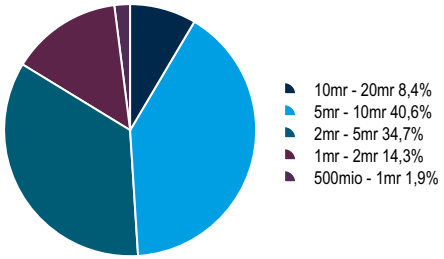
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

Portfolio-Statistik

	Fonds	Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis Geschäftsjahr 1	31,9	17,1
Kurs-Buchwert-Verhältnis	4,9	1,8
Dividendenrendite	0,9	2,0
Eigenkapitalrendite	14,9	11,6
Active Share	96,5	--

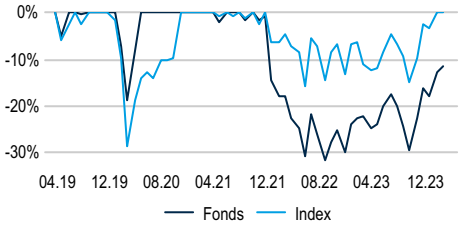
Die Analysen basieren auf globalen Bewertungen zum Börsenschluss unter Verwendung von durch Columbia Threadneedle Investments ermittelten Marktattributen. Die Daten für zugrunde liegende Wertpapiere können vorläufig sein oder auf Schätzungen basieren. Die Gewichtungen der Marktkapitalisierung umfassen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

Marktkapitalisierungsübersicht



Währung: EUR

Drawdown



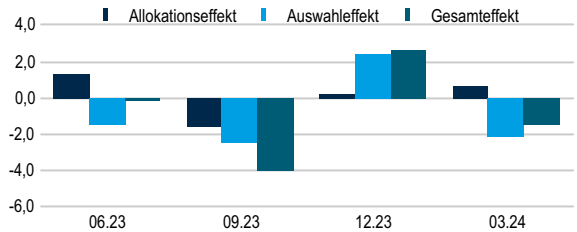
Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

	Abweich. durchschn. Gewicht.	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Rel. Gesamt-ertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Kommunikationsdienste	1,0	19,8	0,2	19,5	-6,2	-0,1	0,7	0,6
Zyklische Konsumgüter	-4,7	7,8	8,5	-0,6	1,5	-0,1	-0,1	-0,1
Nichtzykl. Konsumgüter	-0,2	13,9	6,6	6,9	-0,3	0,0	0,3	0,3
Energie	-4,9	--	13,0	-11,5	5,7	-0,3	--	-0,3
Finanzen	-6,8	1,1	6,8	-5,3	-0,1	0,0	-0,5	-0,5
Gesundheit	2,1	-1,9	6,3	-7,7	-0,6	0,0	-1,0	-0,9
Industrie	13,7	9,9	10,6	-0,6	3,5	0,5	-0,2	0,3
Informationstechnologie	9,1	-0,7	6,3	-6,7	-0,5	0,0	-1,4	-1,4
Rohstoffe	-3,4	0,5	4,7	-4,0	-2,0	0,1	-0,2	-0,1
Immobilien	-5,8	8,2	-0,2	8,4	-6,7	0,4	0,2	0,6
Versorger	-2,4	--	0,4	-0,4	-6,1	0,2	--	0,2
Summe	**--**	**5,3**	**6,9**	**-1,5**	**--**	**0,6**	**-2,1**	**-1,5**

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

	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Geo. Zuordnung Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Mrz-23 - Juni-23	2,8	3,0	1,3	-1,4	-0,1
Juni-23 - Sept-23	-5,2	-1,4	-1,5	-2,4	-3,9
Sept-23 - Dez-23	10,7	7,9	0,2	2,4	2,6
Dez-23 - Mrz-24	5,3	6,9	0,6	-2,1	-1,5

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.

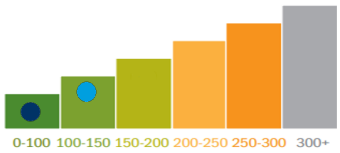
Der Fonds fördert ökologische oder soziale Merkmale und ist gemäß der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung) als ein Fonds nach Artikel 8 eingestuft.

Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

	Fonds	Index*	Ausrichtung
Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit Gewichteter Durchschnitt (1 = höchste Qualität, 5 = niedrigste Qualität)	2,57	2,74	+0,17
Kohlenstoffintensität Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	65,94	148,05	+82,11
Engagement in kontroversen Unternehmen Engagement in kontroversen Titeln[1]	--	0,06%	+0,06%
ESG-Score von MSCI Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	6,15	5,95	+0,20

Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit

Kohlenstoffintensität



Legende ▼ Fonds Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit ▲ Index Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit ● Fonds Kohlenstoffintensität ● Index Kohlenstoffintensität

*MSCI World Small Cap Index.

Bestimmte Informationen ©2024 MSCI ESG Research LLC. Nachdruck mit Genehmigung; keine weitere Verbreitung.[1]Quelle: UNGC – United Nations Global Compact; ILO – International Labor Organization Core Labor Standards (Kernarbeitsnormen der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO); UNGPBR – United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte)

Columbia Threadneedle Bewertung der ESG-Wesentlichkeit (ESGM)

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

Kohlenstoffintensität

Dabei werden die Kohlenstoffemissionen im Verhältnis zur Größe eines Unternehmens an den Umsätzen und nicht an der Marktkapitalisierung gemessen. Als Kennzahl wird Tonnen 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 ESG-Score nutzt die MSCI-eigene Methodik, um die Effektivität der Unternehmen bei der Handhabung ihres ESG-Engagements zu bewerten. Die Unternehmen mit den höchsten Ratings sind diejenigen, die ihr Engagement gegenüber diesen wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen am besten handhaben. Liegt der Portfolio-Score über der Benchmark, ist das Portfolio in Emittenten übergewichtet, die ihr ESG-Engagement besser handhaben als andere.

Ausrichtung

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

Es werden Kennzahlen verwendet, um die ESG-Merkmale des Fonds mit dem Index zu vergleichen. Dieser Index ist auch ein nützlicher Referenzwert, mit dem die Wertentwicklung verglichen werden kann. Dementsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, ökologische oder soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen.

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

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

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

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

Verfügbare Anteilsklassen

Anteil	Klasse	Abgesichnert	Währung	Steuer	OCF	OCF Datum	Max. Ausgabeaufschlag	Max. Rücknahmeabschlag	Transaktionskosten	Mindestanlage	Auflegungsdatum	ISIN	SEDOL	BBID	WKN/Valor/CUSIP
AE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,80%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	2.500	03.03.11	LU0570870567	BYWRPN4	XRZ0 GR	A1JJHG
AE	Acc	Nein	USD	Gross	1,80%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	2.500	17.08.12	LU0757428866	B8B7SZ6	TESAAEU LX	A1JVLE
AEP	Inc	Nein	EUR	Gross	1,80%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	2.500	31.07.18	LU1854166821	BFWYV12	THGSAEP LX	A2JQEM
AUP	Inc	Nein	USD	Gross	1,80%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	2.500	12.06.18	LU1815336091	BFNBMG4	THGSAUP LX	A2JK0Y
IE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,95%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,70%	100.000	03.03.11	LU0570871706	B73ZHJ8	TESAAIE LX	A1JJSS
IE	Acc	Nein	USD	Gross	0,95%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,70%	100.000	17.08.12	LU0757429088	B807VQ9	TESAIEU LX	A1JVLG
IEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,95%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,70%	100.000	28.07.20	LU2187597856	BMBKKF7	THGLSCI LX	A2P6A2
ZE	Acc	Nein	EUR	Gross	1,05%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	1.500.000	22.05.18	LU0957820193	BFZP156	THGSCZE LX	A2JMBG
ZG	Acc	Nein	GBP	Gross	1,05%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	1.000.000	22.05.18	LU1815336505	BFNBMM0	THGSCZG LX	A2JK03
ZGH	Acc	Ja	GBP	Gross	1,05%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,79%	1.000.000	16.10.12	LU0815285274	B8Q73W3	TESAAZA LX	A14ZY4
ZU	Acc	Nein	USD	Gross	1,05%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,70%	2.000.000	22.05.18	LU1815336687	BFNBMN1	THGSCZU LX	A2JK04

Anteilsklassenbezeichnung: Beginnend mit einer Ziffer – nur verfuegbar fuer bestehende Anleger. Beginnend mit einem Buchstaben – verfuegbar fuer 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 31.03.23. Zusätzliche Vertriebs- oder Vermittlungsgebühren dürfen nicht einbezogen werden. In einigen Fällen können die laufenden Kosten auf einer Schätzung der künftigen Kosten beruhen. Eine detailliertere Aufstellung finden Sie unter www.columbiathreadneedle.com/fees.

Wichtige Informationen

Nur zur Nutzung durch professionelle Kunden und/oder gleichwertige Anlegertypen in Ihren Rechtsordnungen (nicht für Privatkunden zu verwenden oder an diese weiterzugeben). Columbia Threadneedle (Lux) I is a Luxembourg domiciled investment company with variable capital ("SICAV"), managed by Threadneedle Management Luxembourg S.A.. This material should not be considered as an offer, solicitation, advice or an investment recommendation. This communication is valid at the date of publication and may be subject to change without notice. Information from external sources is considered reliable but there is no guarantee as to its accuracy or completeness. The SICAV´s current Prospectus, the Key Information Document and the summary of investor rights are available in English and/ or in German (where applicable) from the Management Company Threadneedle Management Luxembourg S.A., International Financial Data Services (Luxembourg) S.A., your financial advisor and/or on our website www.columbiathreadneedle.de. Threadneedle Management Luxembourg S.A. may decide to terminate the arrangements made for the marketing of the SICAV.
Past performance is calculated according to the BVI method in Germany.
Issued by Threadneedle Management Luxembourg S.A. registered with the Registre de Commerce et des Sociétés (Luxembourg), Registered No. B 110242, 44 rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg.
Columbia Threadneedle Investments is the global brand name of the Columbia and Threadneedle group of companies.

Quelle für Indexdaten: MSCI. Die MSCI-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. Keine der MSCI-Informationen sollen eine Anlageberatung oder eine Empfehlung für (oder gegen) eine Anlageentscheidung darstellen und niemand sollte sich diesbezüglich auf sie verlassen. Historische Daten und Analysen sollten nicht als Anhaltspunkt oder Garantie für zukünftige Analysen, Vorhersagen oder Prognosen hinsichtlich der Wertentwicklung dienen. Die MSCI-Informationen werden ohne Mängelgewähr bereitgestellt, und der Nutzer dieser Informationen trägt das volle Risiko für jedwede Verwendung dieser Informationen. MSCI, seine verbundenen Personen und alle anderen Personen, die an der Zusammenstellung, Berechnung oder Erstellung von MSCI-Informationen beteiligt sind oder damit in Verbindung stehen (zusammen die „MSCI-Parteien“) schließen ausdrücklich jedwede Garantie (insbesondere jedwede Garantie der Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Nichtverletzung von Schutzrechten Dritter, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck) im Hinblick auf diese Informationen aus. Ohne Einschränkung des Vorstehenden ist keine MSCI-Partei in irgendeinem Fall und in irgendeiner Weise für jedwede direkte, indirekte, besondere oder beiläufig entstandene Schäden, Schäden mit Strafcharakter, Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) oder sonstige Schäden haftbar. (www.msci.com) Standard & Poor’s GICS History wurde von S&P Global Market Intelligence LLC („S&P“) entwickelt und ist das ausschließliche Eigentum und eine Dienstleistungsmarke der S&P Global Market Intelligence LLC („S&P“) und wurde zur Nutzung durch Threadneedle lizenziert. Der Global Industry Classification Standard (GICS®) wurde von MSCI, Inc. und S&P Global Market Intelligence, Inc. („S&P Global Market Intelligence“) entwickelt und/oder ist deren alleiniges Eigentum. GICS ist eine Dienstleistungsmarke von MSCI und S&P Global Market Intelligence und wurde durch Nutzung durch Threadneedle Asset Management Limited lizenziert.