

**SICAV Deutschland**

**Kontaktdaten**

Tel: +352 46 40 10 7190\*

columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com

\* Bitte beachten Sie, dass Anrufe und elektronische Kommunikation aufgegeben werden können.

IFDS, 47, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

Fondsmanager: Scott Woods  
 Seit: Apr 19  
 Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.  
 Auflegungsdatum des Fonds: 03.03.11

Index: MSCI World Small Cap  
 Vergleichsgruppe: Morningstar Category Global Small/Mid-Cap Equity

Fondswährung: EUR  
 Fondsdomizil: Luxemburg

Ex-Dividenden-Datum: -  
 Zahlungsdatum: -

Fondsvolumen: €2.198,1m

Anzahl der Wertpapiere: 91

Alle Angaben in EUR

**GLOBAL SMALLER COMPANIES - AE EUR**

ISIN: LU0570870567

Preis der Anteilsklasse: 55,8531

Laufende Kosten (OCF): 1,80% (zum 31.03.21)

Performancegebühr: Nein

Die laufenden Kosten basieren in der Regel auf den Aufwendungen des letzten Geschäftsjahrs und können von Jahr zu Jahr unterschiedlich sein. Hierzu zählen Kosten wie die jährliche Verwaltungsgebühr, die Registrierungsgebühr, Verwahrgebühren und Vertriebskosten des Fonds, jedoch nicht die Kosten für den Kauf oder Verkauf von Vermögenswerten für den Fonds (sofern diese Vermögenswerte nicht Anteile eines anderen Fonds sind). Eine detailliertere Aufstellung finden Sie unter [www.columbiathreadneedle.com/fees](http://www.columbiathreadneedle.com/fees). In einigen Fällen können die laufenden Kosten auf einer Schätzung zukünftiger Kosten basieren. Dies ist dann der Fall, wenn die Anteilsklasse relativ neu ist und zur genauen Berechnung eine unzureichende Erfolgsbilanz aufweist oder wenn die historischen Zahlen die zukünftigen laufenden Kosten voraussichtlich nicht genau widerspiegeln. Der Jahresbericht des Fonds für jedes Geschäftsjahr enthält Angaben zu den genauen geltenden Kosten.

Siehe Tabelle der verfügbaren Anteilsklassen auf Seite 4.

**Änderungen des Fonds**

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>

**Ratings/Auszeichnungen**



Weitere Informationen zur Methodik des Morningstar-Ratings finden Sie unter [www.morningstar.com](http://www.morningstar.com)

**Scope A**

**Anlageziel und -politik**

Der Fonds zielt darauf ab, den Wert Ihrer Anlage langfristig zu steigern. Er ist bestrebt, die Wertentwicklung des MSCI World Small Cap Index nach Abzug der Gebühren zu übertreffen.

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

Der Fonds kann auch in andere als die oben angegebenen 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 einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Fondsperformance 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.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Fondsmanagers berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

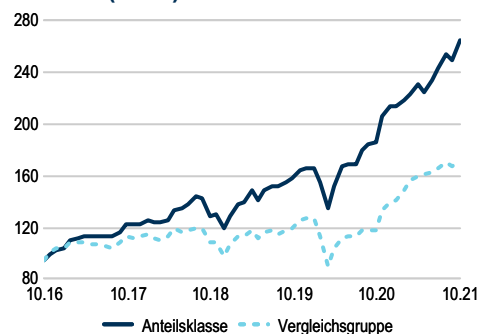
**Anlageansatz**

Wir gehen davon aus, dass hochwertige Gesellschaften für langfristig überlegene Anlagen sorgen. Grund hierfür ist, dass der Markt den Wert von Wettbewerbsvorteilen unterschätzt, durch die manche Gesellschaften nachhaltig hohe Renditen erzielen können. Diese Gesellschaften können Kapital zu höheren Ertragsraten reinvestieren und damit ein attraktives Gesamtwachstum für Anleger erzielen.

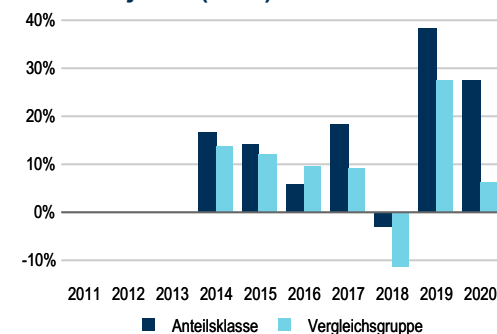
Das Anlageverfahren ist darauf ausgerichtet, diese Gesellschaften zu identifizieren und selektiv in jene zu investieren, die ein attraktives langfristiges Wachstum und eine angemessene Bewertung bieten. Das Verständnis der Branchenstruktur und der Geschäftsmodelle der Unternehmen wird groß geschrieben. Wir nutzen das Fünf-Kräfte-Modell nach Professor Michael Porter, um die Branchenattraktivität zu beurteilen, und für ein vollständiges Verständnis der Geschäftsmodelle finden Meetings mit dem Management statt.

Für Anlagen in Small- und Mid-Cap-Aktien wird ein echter globaler Ansatz mit der Auswahl der besten Gelegenheiten aus aller Welt gewählt. Dynamische Sektor- und Regionengewichtungen erfolgen eher nach Bottom-up- als nach Top-down-Ansätzen. Der Verwalter ist risikobewusst, und das Portfolio ist nach Aktien, Sektoren und Regionen diversifiziert. Der Portfoliostil zeigt einen klaren Fokus auf Qualität und Wachstum.

**5 Jahre (EUR)**



**Kalenderjahre (EUR)**



**Annualisierte Wertentwicklung (EUR)**

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	10 J	Seit Aufl.
Anteilsklasse (netto)	5,9	8,5	14,6	23,4	40,8	28,9	26,5	22,0	--	17,5
Vergleichsgruppe (netto)	3,1	4,6	7,3	23,4	45,4	18,0	14,8	12,1	--	11,1
Percentil	8%	9%	9%	50%	66%	12%	4%	1%	--	1%
Quartil	1	1	1	2	3	1	1	1	--	1
Fonds (brutto)	6,0	9,0	15,6	25,2	43,0	30,8	28,3	24,2	--	19,7
Index (brutto)	3,8	5,5	7,6	24,4	46,8	18,8	15,8	13,4	--	12,8

Renditen seit Auflegung von: 01.12.13

**Wertentwicklung im Kalenderjahr (EUR)**

	2020	2019	2018	2017	2016	11.20 - 10.21	11.19 - 10.20	11.18 - 10.19	11.17 - 10.18	11.16 - 10.17
Anteilsklasse (netto)	27,5	38,4	-3,1	18,4	5,8	40,8	18,0	21,8	5,2	26,9
Vergleichsgruppe (netto)	6,2	27,4	-11,3	9,3	9,5	45,4	-2,8	8,2	-4,1	17,9
Percentil	9%	4%	4%	5%	75%	66%	9%	1%	9%	1%
Quartil	1	1	1	1	3	3	1	1	1	1
Fonds (brutto)	29,3	40,1	-0,9	21,1	7,4	43,0	19,7	23,5	7,5	30,0
Index (brutto)	6,9	29,1	-9,1	8,2	16,6	46,8	-3,8	10,1	1,0	19,2

**Rollierend 12M (EUR)**

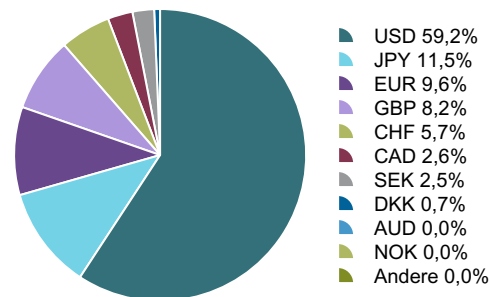
Nettorenditen – Bei allen Nettorenditen (nach Gebühren) wird davon ausgegangen, dass die Erträge für einen lokalen Steuerzahler wiederangelegt werden, Bid-to-Bid-Wertentwicklung (d.h., dass die Wertentwicklung nicht die Auswirkungen anfänglicher Gebühren umfasst). Quelle Copyright © 2021 Morningstar UK Limited. Bruttofondrenditen (wo gezeigt) - Die Brutto-Fondrenditen werden täglich intern zeitgewichtet auf der Grundlage globaler Bewertungen zum Börsenschluss mit Cashflows zum Tagesbeginn und vor Gebühren berechnet. Die frühere Wertentwicklung ist kein Indikator für die künftige Wertentwicklung. In den Performanceangaben sind die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt. Der Wert von Anlagen und Erträgen ist nicht garantiert. Er kann ebenso gut fallen wie steigen und zudem durch Wechselkurschwankungen beeinträchtigt werden. Ein Anleger erhält daher möglicherweise nicht den gleichen Betrag zurück, den er ursprünglich investiert hat. Indexrenditen gehen vom Reinvestieren von Dividenden und Kapitalerträgen aus und spiegeln, anders als Fondrenditen, keine Gebühren oder Kosten wider. Der Index ist nicht verwaltet und es kann nicht direkt darin investiert werden.

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.

## Top 10 Positionen (%)

Wertpapier	Fonds	Index	
Live Oak Bancshares, Inc.	2,6	0,0	Finanzen
Triumph Bancorp, Inc.	2,1	0,0	Finanzen
Workiva Inc. Class A	2,0	0,1	Informationstechnologie
Hamilton Lane Incorporated Class A	2,0	0,0	Finanzen
Ritchie Bros. Auctioneers Incorporated	2,0	--	Industrie
Simpson Manufacturing Co., Inc.	1,9	0,1	Industrie
Cargojet Inc.	1,9	0,0	Industrie
MSA Safety, Inc.	1,9	0,1	Industrie
WillScot Mobile Mini Holdings Corp. Class A	1,8	0,1	Industrie
Armstrong World Industries, Inc.	1,8	0,1	Industrie
<b>Summe</b>	<b>20,0</b>	<b>0,4</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.	Geografisch	Fonds	Index	Diff.
Industrie	28,3	18,7	9,7	Vereinigte Staaten	54,4	59,5	-5,1
Informationstechnologie	23,7	12,8	10,9	Japan	11,4	10,1	1,4
Gesundheit	12,9	11,4	1,5	Grossbritannien	8,2	6,3	1,9
Finanzen	10,1	13,5	-3,5	Schweiz	5,7	2,0	3,7
Zyklische Konsumgüter	8,3	13,2	-4,9	Kanada	4,5	3,6	0,9
Nichtzykl. Konsumgüter	5,1	4,1	1,0	Deutschland	3,9	1,9	2,0
Rohstoffe	4,6	6,9	-2,3	Frankreich	2,6	1,2	1,3
Kommunikationsdienste	4,0	3,2	0,8	Schweden	2,5	2,9	-0,4
Energie	--	3,7	-3,7	Spanien	1,2	0,7	0,5
Immobilien	--	10,0	-10,0	Finnland	0,8	0,6	0,2
Versorger	--	2,5	-2,5	Italien	0,7	1,1	-0,4
Barmittel ähnlich	1,8	--	1,8	Andere	1,1	10,0	-8,9
Barmittel	1,1	--	1,1	Barmittel ähnlich	1,8	--	1,8
				Barmittel	1,1	--	1,1

## Top 10 Übergewichtung/Untergewichtung (%)

Übergewichtung	Fonds	Index	Diff.	Untergewichtung	Fonds	Index	Diff.
Live Oak Bancshares, Inc.	2,6	0,0	2,5	Bill.com Holdings, Inc.	--	0,2	-0,2
Triumph Bancorp, Inc.	2,1	0,0	2,1	Entegris, Inc.	--	0,2	-0,2
Ritchie Bros. Auctioneers Incorporated	2,0	--	2,0	Diamondback Energy, Inc.	--	0,2	-0,2
Hamilton Lane Incorporated Class A	2,0	0,0	1,9	Signature Bank	--	0,2	-0,2
Workiva Inc. Class A	2,0	0,1	1,9	Quanta Services, Inc.	--	0,2	-0,2
Simpson Manufacturing Co., Inc.	1,9	0,1	1,9	Nuance Communications, Inc.	--	0,2	-0,2
Cargojet Inc.	1,9	0,0	1,9	Repligen Corporation	--	0,2	-0,2
MSA Safety, Inc.	1,9	0,1	1,8	Floor & Decor Holdings, Inc. Class A	--	0,2	-0,2
WillScot Mobile Mini Holdings Corp....	1,8	0,1	1,8	Williams-Sonoma, Inc.	--	0,2	-0,2
Armstrong World Industries, Inc.	1,8	0,1	1,8	Wolfspeed Inc	--	0,2	-0,2

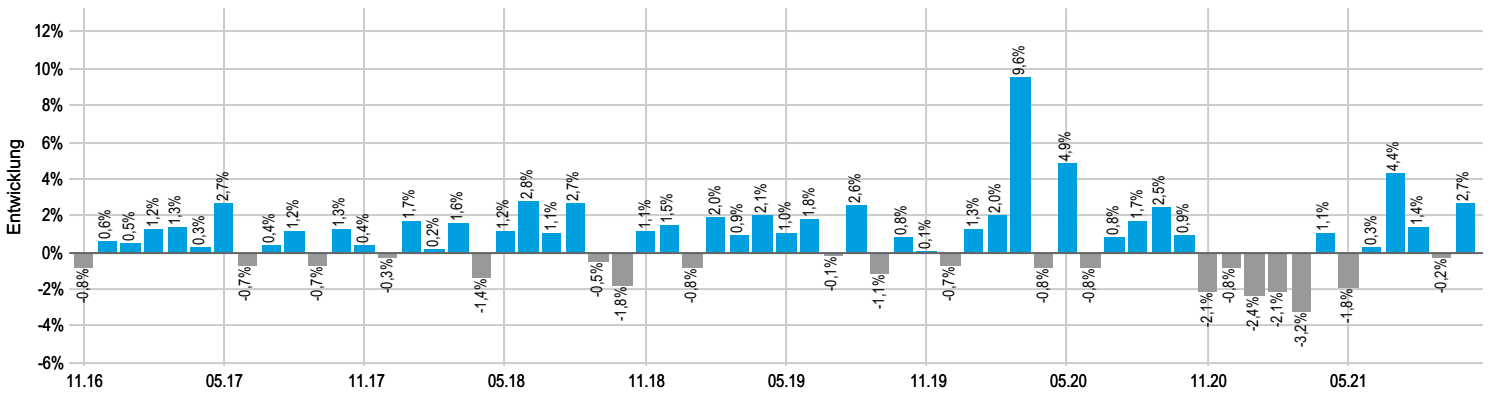
## Größte Änderungen bei den Positionen über 3 Monate

Wertpapier	3M Veränd.
Triumph Bancorp, Inc.	1,9
Stevanato Group SpA	1,7
Service Corporation International	-1,7
IMCD N.V.	-1,2
Floor & Decor Holdings, Inc. Class A	-1,2
VAT Group AG	-1,2
Goosehead Insurance, Inc. Class A	1,1
Bruker Corporation	-1,1
Diversey Holdings, Ltd.	1,0
Freshpet Inc	1,0

## Zuordnung Top positive/negative Wertpapiere (3 Monate)

Wertpapiernamen - 10 höchste	Fonds			Index			Attri	Wertpapiernamen - 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		
Live Oak Bancshares, Inc.	1,8	51,4	0,9	0,0	51,9	0,8	Shift4 Payments, Inc. Class A	1,5	-28,1	-0,5	0,0	-27,5	-0,5		
SPS Commerce, Inc.	1,9	43,7	0,9	0,1	43,6	0,7	Cardlytics, Inc.	0,7	-36,2	-0,5	0,0	-36,0	-0,5		
SiTime Corporation	1,2	98,2	0,8	0,0	100,1	0,7	Terminix Global Holdings Inc	1,0	-21,0	-0,3	0,1	-21,0	-0,3		
Triumph Bancorp, Inc.	1,2	55,3	0,6	0,0	56,8	0,5	Grocery Outlet Holding Corp.	0,4	-28,4	-0,3	0,0	-31,3	-0,3		
JTOWER, Inc.	1,2	46,5	0,5	0,0	46,6	0,4	Games Workshop Group PLC	1,4	-13,8	-0,2	0,1	-13,8	-0,3		
Certara, Inc.	1,1	55,6	0,5	0,0	55,6	0,4	EVO Payments, Inc. Class A	0,7	-24,5	-0,2	0,0	-23,9	-0,2		
Flywire Corp.	1,2	50,9	0,5	--	--	0,4	Duck Creek Technologies, Inc.	0,7	-25,9	-0,2	0,0	-26,5	-0,2		
Casella Waste Systems, Inc. Class A	1,7	29,4	0,4	0,0	29,2	0,3	SIG Combibloc Group Ltd	1,6	-9,3	-0,1	0,1	-9,1	-0,2		
WillScot Mobile Mini Holdings Corp. Clas...	1,7	24,0	0,4	0,1	24,0	0,3	Advanced Drainage Systems, Inc.	1,6	-5,4	-0,1	0,1	-5,2	-0,2		
Ranpak Holdings Corp. Class A	1,0	37,9	0,3	0,0	37,8	0,3	Simpson Manufacturing Co., Inc.	2,0	-3,2	-0,1	0,1	-3,1	-0,2		

## Relative monatliche Wertentwicklung gegenüber Median der Vergleichsgruppe



Nettorenditen - Alle Wertentwicklungen stammen von Morningstar. Renditen werden auf einer Bid-to-Bid-Basis berechnet und sind ohne alle Aufwendungen. Bei Renditen wird von Erträgen ausgegangen, die für einen lokalen Steuerpflichtigen investiert werden. Bruttofondrenditen (wo gezeigt) - Die Brutto-Fondrenditen werden täglich intern zeitgewichtet auf der Grundlage globaler Bewertungen zum Börsenschluss mit Cashflows zum Tagesbeginn und vor Gebühren berechnet. Relative Renditen werden geometrisch berechnet. Die frühere Wertentwicklung ist kein Indikator für die künftige Wertentwicklung. Der Wert der Anlagen und die daraus resultierenden Erträge können sowohl steigen als auch fallen. Alle Positionen basieren auf Bruttobewertungen von Portfoliobeständen zum globalen Börsenschluss. Wertpapiergruppierungen, z. B. Sektoren, werden intern festgelegt und dienen nur zu Vergleichszwecken.

### Risikoanalyse

	3 J		5 J	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Absolute Volatilität	17,2	20,6	14,9	17,4
Relative Volatilität	0,8	--	0,9	--
Tracking Error	7,7	--	6,7	--
Sharpe-Ratio	1,7	--	1,7	--
Information Ratio	1,6	--	1,6	--
Beta	0,8	--	0,8	--
Sortino Ratio	2,8	--	2,8	--
Jensen-Alpha	16,1	--	13,7	--
Annualisiertes Alpha	14,3	--	12,4	--
Alpha	1,1	--	1,0	--
Max. Drawdown	-18,7	-28,4	-18,7	-28,4
R <sup>2</sup>	87,0	--	85,5	--

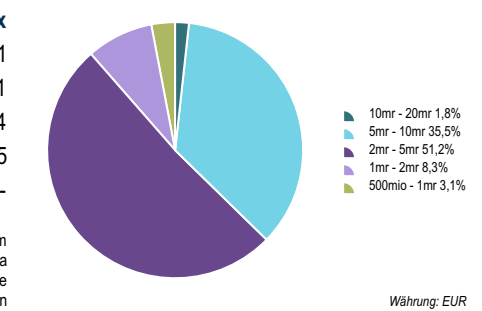
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

### Portfolio-Statistik

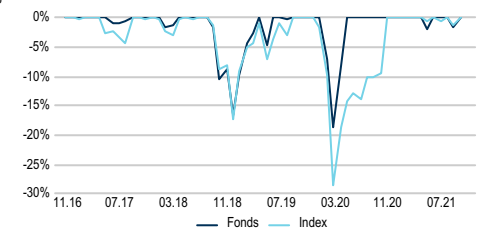
	Fonds	Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis Geschäftsjahr 1	42,4	19,1
Kurs-Buchwert-Verhältnis	7,0	2,1
Dividendenrendite	0,5	1,4
Eigenkapitalrendite	15,3	12,5
Active Share	96,8	--

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 Markt kapitalisierung umfassen Barmittel in den %-Berechnungen.

### Marktkapitalisierungsübersicht



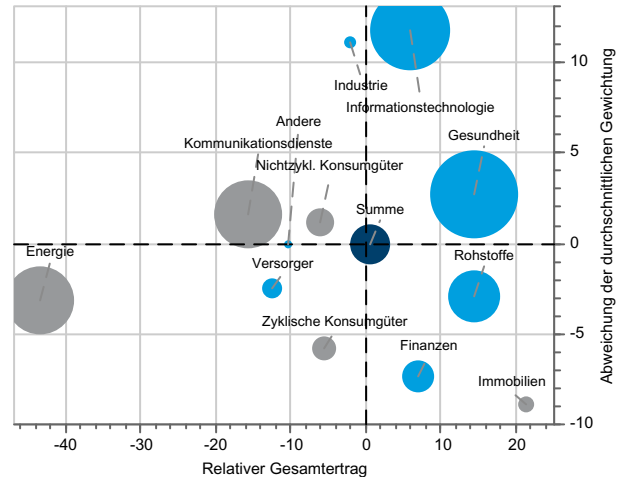
### Drawdown



### Performance-Attribution (seit Jahresbeginn)

	Abwech. durchschn. Gewicht.	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Rel. Gesamt-ertrag	Index Rel. zu Total	Geo. Zuordnung		
						Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Kommunikationsdienste	1,6	0,3	18,9	-15,7	-4,4	-0,1	-0,9	-1,0
Zyklische Konsumgüter	-5,7	19,1	25,9	-5,4	1,2	-0,2	-0,1	-0,3
Nichtzykl. Konsumgüter	1,2	5,2	11,9	-6,0	-10,1	-0,1	-0,3	-0,4
Energie	-3,2	--	77,0	-43,5	42,2	-1,1	--	-1,1
Finanzen	-7,3	46,2	36,5	7,1	9,7	-0,6	1,0	0,4
Gesundheit	2,7	21,2	5,9	14,4	-14,9	-0,4	1,9	1,4
Industrie	11,0	25,8	28,6	-2,2	3,3	0,4	-0,4	0,0
Informationstechnologie	11,8	28,2	21,0	6,0	-2,8	-0,2	1,5	1,3
Rohstoffe	-2,9	37,1	19,9	14,4	-3,6	0,1	0,6	0,8
Andere	0,0	--	11,7	-10,4	-10,3	0,0	--	0,0
Immobilien	-8,9	54,8	27,5	21,4	2,5	-0,2	0,1	-0,1
Versorger	-2,5	--	14,1	-12,4	-8,3	0,2	--	0,2
<b>Summe</b>	<b>--</b>	<b>25,2</b>	<b>24,4</b>	<b>0,6</b>	<b>--</b>	<b>-2,7</b>	<b>3,4</b>	<b>0,6</b>

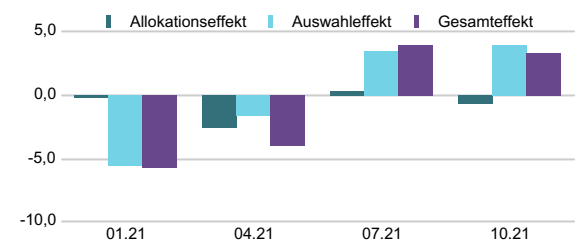
### Gesamteffekt-Analyse (seit Jahresbeginn)



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

	Fonds Gesamt-ertrag	Index Gesamt-ertrag	Geo. Zuordnung		
			Allok.-effekt	Auswahl-effekt	Gesamt-effekt
Okt-20 - Jan-21	14,6	21,3	0,0	-5,6	-5,6
Jan-21 - Apr-21	8,0	12,5	-2,5	-1,5	-4,0
Apr-21 - Juli-21	6,0	2,0	0,4	3,6	3,9
Juli-21 - Okt-21	9,0	5,5	-0,6	4,0	3,4

### Gesamteffekte über 3 Monate

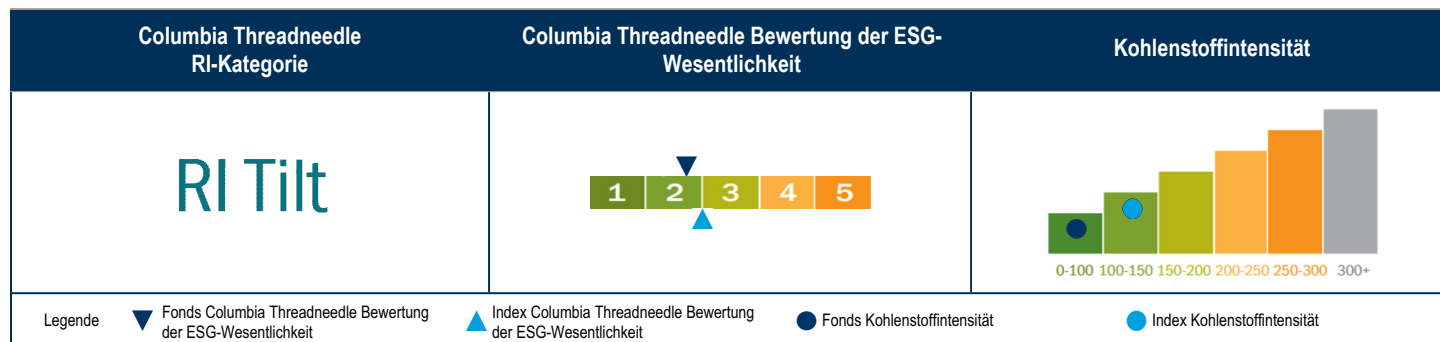


Die Erträge werden auf täglicher geometrischer Basis berechnet, sofern nicht anders angegeben. Fondserträge können aufgrund von Daten- und Berechnungsmethoden beim Vergleich mit geometrisch zugeordneten Gesamterträgen zu Residualfaktoren führen. Die Änderung bei den Gewichtungen ist die durchschnittliche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

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)	2,71	3,05	+0,34
<b>Kohlenstoffintensität</b> Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	78,26	138,85	+60,58
<b>Engagement in kontroversen Unternehmen</b> Engagement in kontroversen Titeln <sup>1</sup>	--	0,02%	+0,02%
<b>ESG-Score von MSCI</b> Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	5,33	5,26	+0,07



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/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	Währung	Steuer	OCF	Laufende Kosten Datum	Ausgabeaufschlag	Mindestanlage	Auflegungsdatum	ISIN	SEDOL	BBID	WKN/Valor/CUSIP	Abgesichert
AE	Acc	EUR	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	2.500	03.03.11	LU0570870567	B724NM1	TESAAAE LX	A1JJHG	Nein
AE	Acc	USD	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	2.500	17.08.12	LU0757428866	B8B7SZ6	TESAAEU LX	A1JVLE	Nein
AEP	Inc	EUR	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	2.500	31.07.18	LU1854166821	BFWYV12	THGSAEP LX	A2JQEM	Nein
AUP	Inc	USD	Gross	1,80%	31.03.21	5,00%	2.500	12.06.18	LU1815336091	BFNBMG4	THGSAUP LX	A2JK0Y	Nein
IE	Acc	EUR	Gross	0,95%	31.03.21	0,00%	100.000	03.03.11	LU0570871706	B73ZHJ8	TESAAIE LX	A1JJSS	Nein
IE	Acc	USD	Gross	0,95%	31.03.21	0,00%	100.000	17.08.12	LU0757429088	B807VQ9	TESAIEU LX	A1JVLG	Nein
IEP	Inc	EUR	Gross	0,95%	31.03.21	0,00%	100.000	28.07.20	LU2187597856	BMBKKF7	THGLSCI LX	A2P6A2	Nein
ZE	Acc	EUR	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	1.500.000	22.05.18	LU0957820193	BFZP156	THGSCZE LX	A2JMBG	Nein
ZU	Acc	USD	Gross	1,05%	31.03.21	5,00%	2.000.000	22.05.18	LU1815336687	BFNBMN1	THGSCZU LX	A2JK04	Nein

Anteilsklassenbezeichnung: Beginnend mit einer Ziffer – nur verfügbar fuer bestehende Anleger. Beginnend mit einem Buchstaben – verfügbar fuer neue und bestehende Anleger. Bei der Währung der Anteilsklassen handelt es sich, sofern eine Anteilsklasse nicht als abgesicherte Anteilsklasse ausgewiesen ist, um einen umgerechneten Preis, der unter Verwendung der zum offiziellen Bewertungszeitpunkt des Fonds gültigen Wechselkurse ermittelt wurde. Dies soll Ihnen die Möglichkeit bieten, in der von Ihnen gewählten Währung Zugang zu einer Anteilsklasse zu erhalten, und verringert nicht Ihr Gesamtengagement in Fremdwährung. Die Fondswährung gibt das größte Währungsengagement des Fonds an, es sei denn, die Währungsaufteilung ist in der Tabelle „Gewichtungen (%)“ auf Seite 2 aufgeführt.

## Risiken

- Der Wert von Anlagen kann sowohl fallen als auch steigen, und es kann sein, dass Anleger den ursprünglich investierten Betrag nicht zurückbekommen.
- Haben Anlagen im Fonds mehrere Währungen oder eine andere Währung als Ihre eigene Währung, können Änderungen der Wechselkurse den Wert der Anlagen beeinflussen.
- 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 anlegen, um das Risiko zu senken oder die Transaktionskosten zu minimieren. Solche Transaktionen mit Derivaten können die Wertentwicklung des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Die Anlagegesellschaft beabsichtigt mit dem Einsatz von Derivaten keine allgemeine Veränderung des Risikoprofils des Fonds.

## Chancen

- Der Fonds investiert in Anlagenmöglichkeiten kleinerer Unternehmen, die nach Auffassung des Fondsverwalters die attraktivsten weltweit sind.
- Zugang zu einem Portfolio aus gut recherchierten Unternehmen weltweit.
- Bietet länder-, sektoren- und branchenspezifische Diversifizierung.
- Zugang zu einem Anlageverfahren, das auf „qualitatives Wachstum“ setzt.
- Kleinere Unternehmen können eine Quelle langfristigen Wachstums sein: Auswahl der Marktführer von morgen.
- Verwaltet von einem Team mit breitgefächelter Erfahrung in unterschiedlichen Marktbedingungen.

## Wichtige Informationen

Nur zur Nutzung durch professionelle Kunden und/oder gleichwertige Anlegertypen in Ihren Rechtsordnungen (nicht für Privatkunden zu verwenden oder an diese weiterzugeben). Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die künftige Wertentwicklung. Der Wert der Anlagen und etwaige Einkünfte daraus sind nicht garantiert und können sowohl steigen als auch fallen sowie von Wechselkursveränderungen beeinflusst werden. Das bedeutet, dass ein Anleger unter Umständen den ursprünglich angelegten Betrag nicht zurückerhält. Mit der Anlage Ihres Kapitals ist ein Risiko verbunden.

Threadneedle (Lux) ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (Société d'Investissement à Capital Variable bzw. „SICAV“), die nach Luxemburger Recht gegründet wurde. Die SICAV gibt Anteile verschiedener Klassen aus, nimmt diese zurück und tauscht diese um. Die Verwaltungsgesellschaft der SICAV ist Threadneedle Management Luxembourg S.A., die von Threadneedle Asset Management Ltd. und/oder ausgewählten Unterberatern beraten wird.

Bestimmte Teilfonds der SICAV sind in Österreich, Belgien, Dänemark, Frankreich, Finnland, Deutschland, Hongkong, Irland, Italien, Liechtenstein, Luxemburg, Macau, den Niederlanden, Norwegen, Portugal, Singapur, Spanien, Schweden, der Schweiz, den Vereinigten Arabischen Emiraten (VAE) und dem Vereinigten Königreich zugelassen, jedoch unterliegt die Zulassung rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Auflagen in den jeweiligen Rechtsordnungen und einige Teilfonds und/oder Anteilsklassen sind möglicherweise nicht in allen Rechtsordnungen verfügbar. Fondsanteile dürfen in keinem anderen Land öffentlich angeboten werden, und das vorliegende Dokument darf nur dann herausgegeben, in Umlauf gebracht oder verbreitet werden, wenn es sich um kein öffentliches Angebot handelt und in Einklang mit geltendem Recht in dem betreffenden Land steht.

Die in diesem Dokument enthaltenen Hinweise dienen ausschließlich der Information und stellen kein Angebot und auch keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder anderen Finanzinstrumenten dar, noch gelten sie als Anlageberatung oder sonstige Leistungen.

Zeichnungen von Anteilen eines Fonds dürfen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts und der wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie des letzten Jahres- oder Zwischenberichts und auf der Grundlage der aktuellen Geschäftsbedingungen erfolgen. Anleger sollten sich auch im Verkaufsprospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ über die Risiken bei der Fondsanlage generell und speziell bei der Anlage in diesem Fonds informieren. Andere Dokumente als die wesentlichen Anlegerinformationen sind in Englisch, Französisch, Deutsch, Portugiesisch, Italienisch, Spanisch und Niederländisch (kein niederländischer Prospekt) verfügbar. Die Dokumente mit den wesentlichen Anlegerinformationen sind in Landessprachen erhältlich. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte steht auf unserer Website in englischer Sprache zur Verfügung. Die Dokumente können kostenlos schriftlich bei der Verwaltungsgesellschaft unter 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, von International Financial Data Services (Luxembourg) S.A. unter 47, avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg und unter [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com) angefordert werden.

Threadneedle Management Luxembourg S.A. kann beschließen, die Vereinbarungen über die Vermarktung des Fonds zu kündigen. Die Positionen des Portfolios basieren auf Bewertungen von Beständen zum globalen Börsenschluss (und nicht zum offiziellen NIW-Zeitpunkt). Der historische Ertrag spiegelt Ausschüttungen wider, die in den vergangenen zwölf Monaten deklariert wurden. Der Ausschüttungsertrag spiegelt die zu erwartenden Beträge wider, die in den nächsten zwölf Monaten möglicherweise ausgeschüttet werden. Der zugrunde liegende Ertrag spiegelt den annualisierten Ertrag des Fonds abzüglich Kosten wider. Die angegebenen Erträge enthalten keine vorläufigen Kosten und die Anleger unterliegen bei ihren Ausschüttungen möglicherweise einer Steuerpflicht.

Threadneedle Management Luxembourg S.A. Beim luxemburgischen Registre de Commerce et des Sociétés (Handels- und Gesellschaftsregister) unter der Nummer B 110242 eingetragen, 44, Rue de la Vallée, L-2661 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg;

Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia- und Threadneedle-Unternehmensgruppe.

Quelle für Indizes: 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 und 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 sollen 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 jede 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 jegliche Garantie (insbesondere jegliche Garantie der Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Nichtverletzung von Schutzrechten Dritter, Marktängigkeit 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 befallig entstandene Schäden, Schäden mit Strafcharakter, Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) oder sonstige Schäden haftbar. (www.msci.com/Disclaimer) Der Global Industry Classification Standard (GICS) wurde von MSCI Inc. („MSCI“) und Standard & Poor's, einem Geschäftsbereich von McGraw-Hill Companies Inc. („S&P“), entwickelt und ist deren alleiniges Eigentum sowie deren Dienstleistungsanbietung durch Threadneedle Asset Management Limited kontrolliert. Weder MSCI noch S&P oder an der Erstellung oder Zusammenstellung des GICS oder dessen Klassifizierungen beteiligte Dritte gibt ausdrückliche oder stillschweigende Garantien oder Zusicherungen im Hinblick auf diesen Standard oder diese Klassifizierungen (oder die Ergebnisse, die durch deren Nutzung erzielt werden können) ab und alle Parteien weisen hiermit ausdrücklich jegliche Garantien der Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Marktängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck im Hinblick auf jeden derartigen Standard bzw. jede derartige Klassifizierung von sich. Ohne Einschränkung des Vorstehenden sind MSCI, S&P, mit ihren verbundenen Personen oder an der Erstellung oder Zusammenstellung des GICS oder dessen Klassifizierungen beteiligte Dritte in irgendeinem Fall und in irgendeiner Weise für jedwede direkte, indirekte oder besondere Schäden, Schäden mit Strafcharakter, Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) haftbar, auch wenn sie vorab von der Möglichkeit solcher Schäden in Kenntnis gesetzt wurden. Einige dieser Kennungen wurden von Threadneedle Asset Management Limited bestimmt und können von der offiziellen Klassifizierung im GICS (Global Industry Classification System) abweichen. Sie werden von den GICS-Anbietern MSCI oder Standard & Poor's weder unterstützt noch gesponsert.