# Columbia Threadneedle (Lux) III

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV) nach Luxemburger Recht

Jahresbericht und Abschluss (geprüft) für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

R.C.S. Luxemburg B25570



### Columbia Threadneedle (Lux) III Inhaltsverzeichnis

Die Portfolios und deren Ziele	3
Verwaltungsrat	6
Erklärung der Verwaltungsratsmitglieder	7
Bericht des Abschlussprüfers	10
Vergleichstabelle	13
Anzahl der Anteile im Umlauf	17
CT (Lux) Diversified Growth	20
CT (Lux) Euro Bond	29
CT (Lux) European Growth & Income	34
CT (Lux) European Smaller Cap	38
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	43
CT (Lux) Global Convertible Bond	53
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity	59
CT (Lux) Global Total Return Bond	63
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	71
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	77
CT (Lux) Responsible Global Equity	81
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity	85
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income	92
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income	99
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity	110
CT (Lux) US Smaller Companies	114
Konsolidierte Zusammensetzung des Nettovermögens	119
Konsolidierte Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen	124
Erläuterungen zum Abschluss	134
Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüfte Abschnitte)	147
Ungeprüfte Abschnitte	148
Verwaltung des Fonds	168
Anhang I – Auflegung und Schließung von Portfolios und Anteilsklassen	170
Anhang II – Regelmäßige Angaben gemäß Offenlegungsverordnung	172

Weitere Exemplare des Berichts und des Abschlusses per 30. September 2023 sind am eingetragenen Sitz des Columbia Threadneedle (Lux) III (der "Fonds") unter der Anschrift 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, und bei den Vertretern in den jeweiligen Ländern erhältlich und werden den Anteilsinhabern auf Anfrage bereitgestellt. Mitteilungen an die Anteilsinhaber werden im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* ("RESA") sowie in luxemburgischen Zeitungen gemäß den luxemburgischen Rechtsvorschriften und in vom Verwaltungsrat festgelegten Zeitungen veröffentlicht. Die Satzung des Fonds (die "Satzung") ist beim *Handelsregister Luxemburg* hinterlegt, wo sie eingesehen werden kann und auf Anfrage als Kopie erhältlich ist. Der Nettoinventarwert aller Anteile des Fonds wird gemäß den Angaben in den jeweiligen Anhängen des jüngsten Verkaufsprospekts des Fonds (der "Prospekt") veröffentlicht. Die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind bei Columbia Threadneedle Management Limited, Exchange House, Primrose Street, London EC2A 2NY, Vereinigtes Königreich, am eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich und werden wie im Prospekt ausführlicher beschrieben veröffentlicht.

Auf der Grundlage von Rechenschaftsberichten können keine Anteile erworben werden. Käufe sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, der aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen und dem letzten Jahresbericht bzw. dem letzten Halbjahresbericht vorgenommen werden, sofern dieser später veröffentlicht wurde.

# Columbia Threadneedle (Lux) III

Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und sollte nicht als Maßstab für die künftige Wertentwicklung genommen werden. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III **Die Portfolios und deren Ziele**

#### CT (Lux) Diversified Growth

Das Anlageziel des Portfolios ist die Erzielung eines mittel- bis langfristigen Kapitalzuwachses durch einen breit diversifizierten Mix aus Beständen an traditionellen und alternativen Vermögenswerten wie Aktien, Rentenwerten, indirekten Immobilienanlagen und indirekten Rohstoffanlagen. Das Portfolio strebt eine Rendite von +4 % über dem ESTR (Euro Short-Term Rate) (oder dem Gegenwert des SONIA (Sterling Overnight Index Average) in Lokalwährung je abgesicherter Anteilsklasse) über einen rollierenden Dreijahreszeitraum an. Die Portfolioeffizienz wird maximiert und die Kosten minimiert, indem die effizientesten am Markt verfügbaren Produkte verwendet werden, die ein liquides und kostengünstiges Engagement in der jeweiligen Anlageklasse ermöglichen. Zur Portfoliostrukturierung wird eine Kombination aus Barmitteln, börsengehandelten Fonds (ETF), Derivaten, notierten Zertifikaten von Investmentbanken und Kontrakten und Währungen verwendet.

#### CT (Lux) Euro Bond

Das Anlageziel des Portfolios besteht darin, eine angemessene Rendite für das investierte Kapital zu gewährleisten und gleichzeitig durch eine angemessene Diversifizierung der Anlagen das Risiko zu reduzieren. Das Vermögen des Portfolios wird hauptsächlich, direkt oder über derivative Finanzinstrumente, in Schuldtitel mit fester oder variabler Verzinsung investiert, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt in einem OECD-Mitgliedstaat notiert sind oder gehandelt werden, wobei Wechselkursrisiken nach Möglichkeit reduziert werden. Ohne Änderung der spezifischen Anlagepolitik des Portfolios und unter Berücksichtigung der vorherrschenden Marktbedingungen und Anlagemöglichkeiten kann das Portfolio ergänzend in Wertpapiere investieren, die an einer Börse oder an einem geregelten Markt in einem Land außerhalb der OECD notiert sind oder gehandelt werden. Das Portfolio investiert – unter Beachtung des Grundsatzes der Streuung des Anlagerisikos – direkt oder indirekt über derivative Finanzinstrumente in Anleihen und Geldmarktinstrumente mit Investment-Grade-Rating (zum Zeitpunkt des Kaufs und gemäß Definition durch anerkannte Ratingagenturen wie Moody's Services oder Standard & Poor's). Das Portfolio kann in Finanzderivate investieren, um sein Anlageziel zu erreichen. Solche Instrumente können auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden. Zu diesen Instrumenten gehören insbesondere Futures, Forwards, Optionen, Optionen auf Swaps, Zins-Swaps und Inflationsswaps.

#### CT (Lux) European Growth & Income

Das Anlageziel des Portfolios ist die Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses und der Erwirtschaftung von Erträgen auf erhöhtem Niveau durch die Anlage in europäischen Unternehmen, die an einer der Börsen europäischer Staaten oder einem geregelten Markt notiert sind. Das Portfolio investiert mindestens 75 % seines Gesamtvermögens in Aktienwerte von Unternehmen, die gemäß den Gesetzen eines europäischen Landes gegründet wurden und deren Sitz sich dort befindet. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG"). Neben Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren kann das Portfolio auch in Optionsscheine auf Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die als übertragbare Wertpapiere gelten, investieren.

#### CT (Lux) European Smaller Cap

Das Anlageziel des Portfolios ist es, den Investoren die Beteiligung an einem Portfolio zu ermöglichen, das aus Wertpapieren von Unternehmen mit Sitz in Europa besteht, die an den Börsen der verschiedenen europäischen Staaten notiert sind. Die Anlagepolitik ist darauf ausgerichtet, langfristiges Kapitalwachstum durch Anlagen in kleine und mittlere Unternehmen zu erreichen.

Das Portfolio investiert mindestens 75 % seines Gesamtvermögens in Aktienwerte von Unternehmen, die gemäß den Gesetzen Europas gegründet wurden und deren Sitz sich dort befindet. Darüber hinaus investiert das Portfolio den überwiegenden Teil (d. h. mehr als 50 %) seines Gesamtvermögens in europäische Aktien von Unternehmen mit einer maximalen Marktkapitalisierung, die die höchste Marktkapitalisierung im Index nicht übersteigt. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 InvStRefG

#### CT (Lux) Global Absolute Return Bond

Das Anlageziel des Portfolios ist die Erzielung einer Rendite durch eine Kombination von Erträgen und Kapitalwachstum. Das Portfolio strebt eine absolute Rendite unabhängig von der Richtung des Anleihemarkts an. Zur Erreichung seines Anlageziels investiert das Portfolio mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Unternehmensanleihen. Darüber hinaus investiert das Portfolio in Anleihen anderer Körperschaften, einschließlich staatlicher und supranationaler Emittenten. Die Anlagen des Portfolios in CoCo-Bonds werden 10 % seines Nettovermögens nicht übersteigen. Das Engagement in China über das Hong Kong-Shanghai-Bond Connect-Programm überschreitet normalerweise nicht 5 % des Nettovermögens des Portfolios. Das Portfolio kann auch in andere übertragbare Wertpapiere, Organismen für gemeinsame Anlagen, Geldmarktinstrumente, Einlagen, Barmittel und Barmitteläquivalente, derivative Finanzinstrumente und Termingeschäfte investieren.

#### CT (Lux) Global Convertible Bond

Das Anlageziel des Portfolios ist die Erzielung hoher Erträge durch die Anlage seiner Vermögenswerte in einem ausgeglichenen Portfolio von wandelbaren Wertpapieren. Das Portfolio wird seine Vermögenswerte in ein ausgewogenes Portfolio aus wandelbaren Schuldtiteln und synthetischen Wandelanleihen investieren, die die attraktivsten Risiko-Rendite-Merkmale in Bezug auf Teilnahme am Wachstum und Schutz vor Wertrückgängen aufweisen. Das Portfolio investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Wandelanleihen, die von Unternehmen aus Europa, den USA, Japan und Asien begeben wurden.

### Columbia Threadneedle (Lux) III Die Portfolios und deren Ziele (Fortsetzung)

#### CT (Lux) Global Smaller Cap Equity

Das Anlageziel des Portfolios ist es, den Investoren die Beteiligung an einem Portfolio zu ermöglichen, das aus notierten Wertpapieren auf einer weltweiten Basis besteht. Die Anlagepolitik ist darauf ausgerichtet, langfristiges Kapitalwachstum durch Anlagen in kleine und mittlere Unternehmen zu erreichen. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG"). Das Portfolio investiert vornehmlich in Aktien und aktiengebundene Wertpapiere (außer Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen), die von kleinen und mittleren Unternehmen begeben werden. Kleine und mittlere Unternehmen sind in der Regel Unternehmen, deren Marktkapitalisierung zum Zeitpunkt des Kaufes nicht über 10 Mrd. USD bzw. einem entsprechenden Wert liegt. Das Portfolio darf Beteiligungen an Unternehmen mit einer höheren Marktkapitalisierung halten oder erweitern, sofern die Kapitalisierung des jeweiligen Unternehmens die Grenze von 10 Mrd. USD erst nach dem Erwerb durch das Portfolio erreicht oder übersteigt. Das Portfolio kann zudem Exchange Traded Funds und festverzinsliche Wertpapiere halten, sollte dies zu dem jeweiligen Zeitpunkt als angemessen erachtet werden. Vorbehaltlich der in Abschnitt S "Anlagebeschränkungen" dargelegten Anlagebeschränkungen kann das Portfolio auch in Geldmarktinstrumente, Bankeinlagen und andere zulässige liquide Vermögenswerte zum Zwecke des Finanzmanagements und im Falle ungünstiger Marktbedingungen investieren. Unter normalen Marktbedingungen werden die Investitionen in solche liquiden Mittel und Schuldinstrumente aller Art 15 % des Nettoinventarwerts des Portfolios nicht überschreiten.

#### CT (Lux) Global Total Return Bond

Das Anlageziel des Portfolios ist die Erzielung einer Rendite durch eine Kombination von Erträgen und Kapitalwachstum. Zur Erreichung seines Anlageziels investiert das Portfolio mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Unternehmensanleihen. Darüber hinaus investiert das Portfolio in Anleihen anderer Körperschaften, einschließlich staatlicher und supranationaler Emittenten. Die Anlagen des Portfolios in CoCo-Bonds werden 10 % seines Nettovermögens nicht übersteigen. Das Engagement in China über das Hong Kong-Shanghai-Bond Connect-Programm überschreitet normalerweise nicht 5 % des Nettovermögens des Portfolios. Das Portfolio kann auch in andere übertragbare Wertpapiere, Organismen für gemeinsame Anlagen, Geldmarktinstrumente, Einlagen, Barmittel und Barmitteläquivalente, derivative Finanzinstrumente und Termingeschäfte investieren.

#### CT (Lux) Plus II (liquidiert mit Wirkung zum 13. Dezember 2022)

Das Anlageziel des Portfolios besteht in einer langfristig überdurchschnittlichen Rendite in Euro durch Anlagen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen, die global in Aktien und Anleihen entwickelter Märkte investieren, oder durch direkte Anlagen in globale Aktien und Anleihen entwickelter Märkte. Bis zu 5 % des Gesamtvermögens des Portfolios können in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen investiert werden, die in Schwellenmarktaktien investieren.

#### CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond

Das Anlageziel des Portfolios besteht in einer langfristig überdurchschnittlichen Rendite in Euro, die vornehmlich durch Anlagen in festverzinsliche Investment-Grade-Schuldtitel, variabel verzinsliche und sonstige Schuldtitel einschließlich forderungsbesicherter Wertpapiere und CoCo-Bonds, die von Unternehmen begeben werden, erzielt werden soll. Investment-Grade-Wertpapiere sind Wertpapiere, die von Moody's, Standard & Poor's oder einer anderen anerkannten Ratingagentur mit Baa3/BBB- oder höher bewertet wurden. Das Portfolio kann auch bis zu 15 % seines Nettovermögens in festverzinsliche Schuldtitel mit einem Rating unterhalb von Investment Grade, variabel verzinsliche und sonstige Schuldtitel investieren. Die Anlagen des Portfolios in forderungsbesicherte Wertpapiere dürfen 10 % seines Nettovermögens nicht übersteigen. Die Anlagen des Portfolios in CoCo-Bonds werden 10 % seines Nettovermögens.

#### CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity

Das Portfolio soll Investoren die Beteiligung an einem aktiv verwalteten Portfolio ermöglichen, das vornehmlich in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere von Unternehmen in Schwellenmärkten weltweit investiert ist. Wie nachfolgend beschrieben, kann das Portfolio in Unternehmen investieren, die an einer anerkannten Börse in Schwellenländern weltweit notiert sind oder gehandelt werden und die nach Ansicht des Anlageverwalters das Potenzial haben, langfristige Renditen zu erwirtschaften und zur nachhaltigen wirtschaftlichen Entwicklung der Schwellenländer beizutragen bzw. davon zu profitieren. Die Zeichnungserlöse für die verschiedenen ausgegebenen Anteilsklassen werden in ein gemeinsames zugrunde liegendes Anlageportfolio investiert. Jede Anteilsklasse hat einen proportionalen Anspruch auf das Vermögen (und die Verbindlichkeiten) des Portfolios (berechnet gemäß dem entsprechenden Nettoinventarwert der jeweiligen Klasse). Das Portfolio investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Aktien und aktiengebundene Wertpapiere (außer Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen) von Unternehmen, die gemäß den Gesetzen eines Schwellenlandes gegründet wurden und deren Sitz sich in einem Schwellenland befindet oder deren Geschäftsaktivitäten überwiegend in Schwellenländern erfolgen, auch wenn sie an einer Börse in einem anderen Land notiert sind. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG").

### Columbia Threadneedle (Lux) III Die Portfolios und deren Ziele (Fortsetzung)

#### CT (Lux) Responsible Global Equity

Der Fokus des Portfolios liegt auf langfristigem Kapitalwachstum durch Investitionen in Unternehmen aus aller Welt. Sein Ziel ist die Maximierung der Rendite durch Investitionen in ein ethisch geprüftes und vielfältiges Universum von Unternehmen. Das Portfolio investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere (außer Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen) von Unternehmen in allen Märkten, die ethischen und nachhaltigen Kriterien entsprechen. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG").

#### CT (Lux) SDG Engagement Global Equity

Das Portfolio strebt die Erwirtschaftung eines langfristigen Kapitalwachstums und die Unterstützung nachhaltiger Entwicklung an. Das Portfolio investiert vornehmlich in ein diversifiziertes Portfolio aus Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren (ausgenommen Wandelanleihen und Optionsanleihen) von Unternehmen mit kleiner und mittlerer Marktkapitalisierung, die sich überall auf der Welt befinden und jeder beliebigen Branche bzw. jedem beliebigen Sektor angehören können. Das Portfolio hält mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG").

#### CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income (aufgelegt mit Wirkung zum 3. August 2023)

Das Portfolio zielt darauf ab, langfristig (mindestens 5 Jahre) Erträge in Kombination mit Kapitalwachstum zu erwirtschaften. Das Portfolio investiert mehr als 50 % seines Nettovermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG"). Das Portfolio strebt einen langfristigen Kapitalzuwachs an, indem es in erster Linie in nachhaltige Anlagen investiert. Für dieses Portfolio werden Aktien von Unternehmen als nachhaltig angesehen, die einen wesentlichen Teil (50 % oder mehr) ihres Nettoumsatzes mit Aktivitäten erzielen, die in direktem Zusammenhang mit einem oder mehreren der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ("SDGs") stehen, oder die sich auf einem glaubwürdigen kurz- bis mittelfristigen Weg dorthin befinden. Vorbehaltlich der Kriterien des Anlageverwalters für nachhaltige Anlagen investiert das Portfolio in Aktien von Unternehmen weltweit, unabhängig von deren Größe, Branche oder Wirtschaftssektor.

#### CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income

Das Investitionsziel des Portfolios ist langfristiger Kapitalzuwachs und Ertrag durch nachhaltige Investitionen bei zugleich langfristigem Werterhalt. Das Portfolio investiert in eine diversifizierte Mischung aus nachhaltigen Anlagen an traditionellen und alternativen Anlagekategorien. Das Portfolio wird einen Großteil seines Vermögens in Kapitalbeteiligungen, Schuldtitel (sowohl mit Investment Grade) sowie bedingte Wandelanleihen investieren. Das Portfolio kann in Derivate investieren, um seine Performance zu verbessern, indem es ein Engagement in einer Reihe alternativer Ertragsquellen eingeht und das Risiko kontrolliert. Diese Derivate können an anerkannten Börsen oder im Freiverkehr ("OTC") gehandelt werden und können unter anderem Optionen, Futures, Swaps (einschließlich u. a. Total Return Swaps auf Strategien, Aktienkörbe, Aktienindizes, Immobilienindizes oder Rohstoffindizes), Differenzkontrakte und Terminkontrakte umfassen. Das Portfolio kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel unterhalb von Investment Grade investieren. Das Portfolio wird nicht in Wertpapiere investieren, die zum Zeitpunkt ihres Kaufs durch das Portfolio im Kurs gefallen oder notleidend sind. Falls es zu einer Abstufung eines Schuldtitels kommt, der durch das Portfolio gehalten wird, wird der Anlageverwalter alle vertretbaren Bemühungen unternehmen, um dieses Engagement unter 5 % des Nettovermögens des Portfolios zu halten und diese im Kurs gefallenen oder notleidenden Wertpapiere baldmöglichst zu veräußern, falls dies im besten Interesse der Anteilsinhaber/innen ist. Die Anlagen des Portfolios in CoCo-Bonds werden 5 % seines Nettovermögens nicht übersteigen. Das Portfolio investiert mindestens 26 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG").

#### CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity

Das Anlageziel des Portfolios ist eine langfristige Kapitalwertsteigerung durch nachhaltige Anlagen. Das Portfolio investiert in europäische Unternehmen, die an einer der europäischen Börsen oder einem regulierten Markt notiert sind. Das Portfolio investiert mindestens 75 % seines Gesamtvermögens in Aktienwerte von Unternehmen, die gemäß den Gesetzen eines europäischen Landes gegründet wurden und deren Sitz sich dort befindet. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG").

#### CT (Lux) US Smaller Companies

Das Anlageziel des Portfolios ist es, den Investoren die Beteiligung an einem Portfolio zu ermöglichen, der aus Wertpapieren von an den US-Börsen oder am NASDAQ notierten US-Gesellschaften besteht. Die Anlagepolitik ist darauf ausgerichtet, langfristiges Kapitalwachstum durch Anlagen in kleine und mittlere Unternehmen zu erreichen. Das Portfolio investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Aktien und aktiengebundene Wertpapiere (außer Wandelanleihen und Anleihen mit Optionsscheinen) von Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung, die gemäß den Gesetzen der Vereinigten Staaten gegründet wurden und deren Sitz sich in den USA befindet oder deren Geschäftsaktivitäten überwiegend in den USA erfolgen, auch wenn sie in einem anderen Land notiert sind. Das Portfolio investiert mehr als 50 % des Vermögens in Kapitalbeteiligungen im Sinne von Art. 2 Abs. 8 des deutschen Gesetzes zur Reform der Investmentbesteuerung ("InvStRefG"). Das Portfolio investiert in Unternehmen, deren Marktkapitalisierung zum Zeitpunkt des Kaufes nicht über 10 Mrd. USD bzw. einem entsprechenden Wert liegt. Das Portfolio darf Beteiligungen an Unternehmen mit einer höheren Marktkapitalisierung halten oder erweitern, sofern die Kapitalisierung des jeweiligen Unternehmens die Grenze von 10 Mrd. USD erst nach dem Erwerb durch das Portfolio erreicht oder überstiegen hat.

## Columbia Threadneedle (Lux) III Verwaltungsrat

#### Patrick Johns – Vorsitzender

Nicht der Geschäftsführung angehöriger Berater für Columbia Threadneedle Investments Norfolk, Vereinigtes Königreich

#### Jacques Elvinger – Verwaltungsratsmitglied

Partner - Elvinger Hoss Prussen, société anonyme 2, Place Winston Churchill L-1340 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

# Rogier van Harten – Verwaltungsratsmitglied

Head of Institutional Distribution for Continental Europe, Columbia Threadneedle Netherlands B.V., Jachthavenweg 109-E, 1081 KM Amsterdam, Niederlande

#### Ailbhe Jennings – nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied Schuttrange, Großherzogtum Luxemburg

#### **Tina Watts - Director**

EMEA Head of Fund Services & CASS, Columbia Threadneedle Investments Exchange House, Primrose Street London EC2A 2NY, Vereinigtes Königreich

## Columbia Threadneedle (Lux) III Erklärung der Verwaltungsratsmitglieder

#### Chairman

Patrick Johns – Nicht der Geschäftsführung angehöriger Berater für Columbia Threadneedle Investments

#### Verwaltungsratsmitglieder

Jacques Elvinger Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied, Partner EHP

Ailbhe Jennings Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

Rogier van Harten Head of Institutional Distribution for Continental Europe Columbia Threadneedle Investments

Tina Watts EMEA Head of Fund Services & CASS Columbia Threadneedle Investments

Der Verwaltungsrat (der "Verwaltungsrat\") freut sich, den geprüften Jahresbericht des Columbia Threadneedle (Lux) III (der "Fonds") für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 vorzulegen, und ist der Ansicht, dass er insgesamt fair und ausgewogen ist und den Anteilsinhabern die erforderlichen Informationen zur Beurteilung der Lage und der Performance des Fonds liefert.

Während des Geschäftsjahrs verringerte sich der Umfang des Portfolios um 754 Mio. EUR auf 3.078 Mio. EUR (3.832 Mio. EUR zum 30. September 2022). Der Rückgang wurde durch den ernsten weltweiten Wirtschaftsabschwung in Verbindung mit deutlichen Nettoabflüssen aus CT (Lux) Euro Bond, CT (Lux) Global Total Return Bond, CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond, CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity und CT (Lux) Responsible Global Equity verursacht. Die Schließung von CT (Lux) Plus II im Dezember 2022 trug ebenfalls zu diesem Rückgang bei. Der Gesamtrückgang wurde durch die Auflegung des CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income im August 2023 mit einem Nettovermögen von 431 Millionen USD zum Jahresende abgemildert.

#### Struktur des Fonds

Der Fonds ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die als "Société Anonyme" nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg errichtet wurde. Der Verwaltungsrat hat Carne Global Fund Managers (Luxembourg) S.A. zur Verwaltungsgesellschaft des Fonds (die "Verwaltungsgesellschaft") bestellt. Der Fonds ist als "Umbrella"-Fonds mit mehreren Teilfonds organisiert, von denen jeder sein eigenes Anlageziel, seine eigene Anlagepolitik und seine eigenen Anlagebeschränkungen hat.

Ziel des Fonds ist es, die ihm zur Verfügung stehenden Mittel in übertragbaren Wertpapieren und anderen zulässigen Vermögenswerten jeglicher Art gemäß dem Fondsprospekt anzulegen, um die Anlagerisiken zu streuen und den Anteilsinhabern die Ergebnisse der Verwaltung ihrer Portfolios zukommen zu lassen.

Der Fonds erfüllt die Anforderungen an einen Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) im Sinne der EU-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 und unterliegt dem luxemburgischen Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung. Der Fonds kann daher in den Mitgliedstaaten der Europäischen Union zum Verkauf angeboten werden, vorbehaltlich der Notifizierung in anderen Ländern als dem Großherzogtum Luxemburg. Die Zulassung des Fonds und seiner Teilfonds kann darüber hinaus auch in anderen Ländern beantragt werden.

Der Fonds umfasst derzeit 16 Teilfonds. Alle Teilfonds und Anteilsklassen sind für das Angebot und den Vertrieb im Großherzogtum Luxemburg registriert, und einige der Teilfonds und Anteilsklassen sind für den Vertrieb in den folgenden Ländern registriert: Österreich, Belgien, Dänemark, Schweiz, Deutschland, Spanien, Finnland, Vereinigtes Königreich, Irland, Italien, Luxemburg, Liechtenstein, Niederlande, Norwegen, Portugal, Schweden und Singapur.

Im Laufe des Geschäftsjahres wurde 1 neuer Teilfonds aufgelegt:

• CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income

Während des Berichtszeitraums wurde 1 Teilfonds liquidiert:

• CT (Lux) Plus II Fund

#### Rolle und Verantwortung des Verwaltungsrats

Die Aufgaben und Verantwortungsbereiche des Verwaltungsrats unterliegen ausschließlich luxemburgischem Recht. In Bezug auf den Jahresabschluss des Fonds unterliegen die Pflichten des Verwaltungsrats dem Gesetz vom 10. Dezember 2010 über unter anderem die Rechnungslegung und den Jahresabschluss von Organismen für gemeinsame Anlagen und dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung.

Eine Vereinbarung zwischen dem Fonds und der Verwaltungsgesellschaft regelt die Angelegenheiten, für die die Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 zuständig ist. Dazu zählen die Verwaltung des Fondsvermögens und die Erbringung von Verwaltungs- und Vermarktungsdienstleistungen. Alle anderen wichtigen

### Columbia Threadneedle (Lux) III Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

Angelegenheiten sind der Genehmigung durch den Verwaltungsrat vorbehalten, einschließlich der Festlegung des Anlageziels und der Anlagepolitik jedes Teilfonds, der Anlagebeschränkungen und -befugnisse, der Vornahme von Änderungen am Verkaufsprospekt, der Prüfung und Genehmigung des Jahresabschlusses sowie der Ernennung der Verwaltungsgesellschaft, des Abschlussprüfers und der Verwahrstelle und der Überprüfung der von diesen erbrachten Dienstleistungen.

Die Verwaltungsratsmitglieder treffen Entscheidungen im Interesse des Fonds und seiner Anteilsinhaber insgesamt und nehmen nicht an Beratungen oder Entscheidungen teil, die zu einem Interessenkonflikt zwischen ihren persönlichen Interessen und denen des Fonds und seiner Anteilsinhaber führen.

Der Verwaltungsrat kann bei Bedarf und auf Kosten des Fonds unabhängige professionelle Beratung in Anspruch nehmen.

#### Zusammensetzung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat setzt sich aus fünf Mitgliedern zusammen, von denen zwei von dem/den Anlageverwalter(n) unabhängig sind und alle Mitglieder von der Verwaltungsgesellschaft unabhängig sind.

Der Verwaltungsrat begrenzt die Anzahl der Dienstjahre der Verwaltungsratsmitglieder nicht und berücksichtigt die Art und die Anforderungen der Fondsbranche und der Geschäftstätigkeit des Fonds, wenn er den Anteilsinhabern Empfehlungen für die Ernennung von Verwaltungsratsmitgliedern gibt. Die Bedingungen für die Ernennung eines jeden Verwaltungsratsmitglieds werden in einem Dienstleistungsvertrag festgehalten.

#### **Einarbeitung und Schulung**

Alle neuen Verwaltungsratsmitglieder erhalten eine Einführung, die relevante Informationen über den Fonds und ihre Pflichten und Verantwortlichkeiten als Verwaltungsratsmitglied umfasst. Darüber hinaus ergreifen der Verwaltungsrat und die einzelnen Verwaltungsratsmitglieder aktive Maßnahmen, um durch Schulungen oder auf andere Weise über für den Fonds relevante Entwicklungen auf dem Laufenden zu bleiben.

#### Vergütung des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass die Vergütung seiner Mitglieder die Verantwortlichkeiten und die Erfahrung des Verwaltungsrats als Ganzes widerspiegeln und angesichts des Umfangs, der Komplexität und der Anlageziele des Fonds fair und angemessen sein sollte. Die Vergütung wird regelmäßig überprüft. Der Vorsitzende erhält jährliche 27.000 EUR und die anderen Mitglieder des Verwaltungsrats erhalten 22.000 EUR. [Alle geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder haben sich bereit erklärt, auf ihre Vergütung zu verzichten] Kein Bestandteil der vom Fonds an die Verwaltungsratsmitglieder gezahlten Vergütung ist leistungsabhängig.

#### Verwaltungsratssitzungen

Der Verwaltungsrat tritt vierteljährlich zusammen, bei Bedarf werden jedoch zusätzliche Sitzungen anberaumt. [In Anbetracht des Umfangs und der Art der Geschäftstätigkeit des Fonds hält der Verwaltungsrat derzeit die Einsetzung eines formellen Prüfungsoder Vergütungsausschusses nicht für erforderlich.]

#### Unternehmensführung und ALFI-Verhaltenskodex

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich sicherzustellen, dass ein hoher Unternehmensführungsstandard gewahrt wird. Er ist der Ansicht, dass der Fonds die Best Practices der luxemburgischen Fondsbranche eingehalten hat.

Insbesondere hat der Verwaltungsrat die Grundsätze des ALFI-Verhaltenskodex (der "Kodex") übernommen, welcher die Grundsätze einer guten Unternehmensführung darlegt.

Hierbei handelt es sich um folgende Grundsätze:

- 1. Der Verwaltungsrat muss klare und transparente Standards für die Unternehmensführung festlegen.
- Der Verwaltungsrat muss über ein gutes fachliches Ansehen und eine angemessene Erfahrung verfügen und sich nach besten Kräften bemühen sicherzustellen, dass er insgesamt über die erforderliche Kompetenz verfügt, um seiner Verantwortung gerecht zu werden.
- 3. Der Verwaltungsrat muss fair und unabhängig im besten Interesse der Anleger handeln.
- 4. Der Verwaltungsrat muss bei der Erfüllung seiner Pflichten mit der gebotenen Sorgfalt handeln.
- 5. Der Verwaltungsrat muss sicherstellen, dass alle maßgeblichen Gesetze und Vorschriften sowie die Gründungsdokumente des Fonds eingehalten werden.
- 6. Der Verwaltungsrat muss sicherstellen, dass Anleger angemessen informiert und fair und gerecht behandelt werden und die Leistungen und Dienste erhalten, auf die sie ein Anrecht haben.
- 7. Der Verwaltungsrat muss sicherstellen, dass ein angemessener Risikomanagementprozess und angemessene interne Kontrollen eingeführt wurden.

### Columbia Threadneedle (Lux) III Verwaltungsratsmitglieder (Fortsetzung)

- Der Verwaltungsrat muss tatsächliche, potenzielle oder scheinbare Interessenkonflikte identifizieren und nach besten Kräften gerecht und effektiv handhaben und dabei gewährleisten, dass diesbezügliche Belange ordnungsgemäß offengelegt werden.
- 9. Der Verwaltungsrat muss sicherstellen, dass die Rechte der Anteilsinhaber überlegt und im besten Interesse des Fonds ausgeübt werden.
- 10. Der Verwaltungsrat muss sicherstellen, dass die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder angemessen und gerecht ist und ordnungsgemäß offengelegt wird.
- 11. Der Verwaltungsrat sollte in angemessener Weise Nachhaltigkeitsstandards und -ziele, einschließlich ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Aspekte (ESG), in sein Geschäftsmodell und seine Geschäftstätigkeit integrieren.

Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass der Fonds die Grundsätze des Kodex während des gesamten Geschäftsjahres in allen wesentlichen Aspekten eingehalten hat. Der Verwaltungsrat überprüft die laufende Einhaltung der Grundsätze des Kodex jährlich.

#### Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ("ESG")

Bestimmte Teilfonds haben ESG als Teil ihrer Anlagepolitik aufgenommen. Einzelheiten dazu sind im Prospekt enthalten.

#### Haftpflichtversicherung für Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte

Gemäß der Satzung des Fonds werden die Verwaltungsratsmitglieder für Kosten entschädigt, die ihnen im Zusammenhang mit Ansprüchen entstehen, die gegen sie in Ausübung ihrer Pflichten oder Verantwortlichkeiten erhoben werden, sofern sie nicht in betrügerischer oder unredlicher Absicht gehandelt haben. [Zum Schutz der Anteilsinhaber vor derartigen Ansprüchen hat der Verwaltungsrat eine Haftpflichtversicherung für Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte abgeschlossen, die die Verwaltungsratsmitglieder gegen bestimmte Haftungsansprüche im Zuge der Erfüllung ihrer Pflichten und Verantwortlichkeiten absichert, jedoch nicht gegen betrügerische oder unredliche Handlungen ihrerseits.]

#### Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers (PwC) ist seit 2002 der Abschlussprüfer des Fonds. Der Verwaltungsrat hat beschlossen, dass dieses Unternehmen den Anteilsinhabern weiterhin zur Ernennung als Abschlussprüfer vorgeschlagen werden soll.

#### Jahreshauptversammlungen ("JHV")

Die nächste Jahreshauptversammlung des Fonds findet am 25. Januar 2024 am eingetragenen Sitz des Fonds statt, um Angelegenheiten in Bezug auf das am 30. September 2023 beendete Geschäftsjahr zu erörtern. Auf dieser Versammlung werden die Anteilsinhaber gebeten, über die für solche Versammlungen üblichen Angelegenheiten zu beraten. Hierzu zählen unter anderem:

- 1. Die Feststellung des Jahresabschlusses und die Genehmigung der Ergebnisverwendung,
- 2. die Genehmigung der Honorare der Verwaltungsratsmitglieder,
- 3. die Wahl von Verwaltungsratsmitgliedern,
- 4. die Wahl des Abschlussprüfers und
- 5. die Entlastung der Verwaltungsratsmitglieder.

Der Verwaltungsrat schlägt keine außerordentlichen Tagesordnungspunkte vor.

#### Entlastung der Verwaltungsratsmitglieder

Einer der Beschlüsse der JHV ist, wie nach luxemburgischem Recht vorgeschrieben, die Abstimmung der Anteilsinhaber über die Entlastung des Verwaltungsrats für das betreffende Geschäftsjahr. Diese Entlastung ist nur gültig, wenn der Jahresabschluss keine Auslassungen oder falschen Informationen über die tatsächliche Finanzlage des Fonds enthält.

#### **Bedeutende Ereignisse**

Einzelheiten zu bedeutenden Ereignissen während des Geschäftsjahres und nach dem Ende des Geschäftsjahres finden Sie im Anhang.

#### **Patrick Johns**

Verwaltungsratsvorsitzender Oktober 2023



#### Bericht des Abschlussprüfers

An die Anteilsinhaber des Columbia Threadneedle (Lux) III

#### Bestätigungsvermerk

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen betreffend ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenslage des Columbia Threadneedle (Lux) III (der "Fonds") und jedes seiner Teilfonds zum 30. September 2023 sowie der Ergebnisse seiner Transaktionen und der Veränderung seines Nettovermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

#### Prüfungsumfang

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Aufstellung des Nettovermögens zum 30. September 2023;
- die Anlagenaufstellung zum 30. September 2023;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Entwicklung des Nettovermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- die Erläuterungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

#### Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir führten unsere Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den in Luxemburg von der "Commission de Surveillance du Secteur Financier" (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISAs) durch. Unsere Pflichten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs sind im Abschnitt "Pflichten des "Réviseur d'entreprises agréé" in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses" in unserem Bericht näher beschrieben.

Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen.

Wir sind gemäß dem International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der International Independence Standards, die vom International Ethics Standards Board for Accountants herausgegeben wurden (IESBA Code) und von der CSSF für Luxemburg verabschiedet wurden, und den ethischen Anforderungen, die für unsere Abschlussprüfung relevant sind, unabhängig vom Fonds. Wir sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen ethischen Anforderungen gerecht geworden.

#### Ergänzung zum Bestätigungsvermerk

Wir verweisen auf Erläuterung 21 zu diesem Jahresabschluss, die besagt, dass aufgrund des Beschlusses des Verwaltungsrats der vorliegende geprüfte Jahresabschluss den vorherigen Abschluss ersetzt, der unseren unterzeichneten Bestätigungsvermerk vom 24. Januar 2024 enthält und vom Verwaltungsrat am 22. Januar 2024 genehmigt wurde. Unser Bestätigungsvermerk wird mit Blick auf diesen Sachverhalt nicht abgeändert.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu

Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n° 10028256) R.C.S. Luxemburg B 65 477 – TVA LU25482518



#### Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht angegebenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren diesbezüglichen Revisionsbericht.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir geben keinerlei Art von Prüfungsurteil hinsichtlich der Zuverlässigkeit der sonstigen Informationen ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen vorstehend genannten Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Tätigkeiten zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

#### Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats des Fonds für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die Erstellung und die den tatsächlichen Verhältnissen entsprechende Darstellung des Abschlusses gemäß den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung von Abschlüssen und für entsprechende interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat des Fonds für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen wesentliche falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und jedes seiner Teilfonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat des Fonds hat die Absicht, den Fonds oder einen seiner Teilfonds zu liquidieren bzw. zu schließen oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

#### Pflichten des "Réviseur d'entreprises agréé" in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Revisionsbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bestehende wesentliche falsche Darstellungen bei einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs durchgeführten Abschlussprüfung immer entdeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs gehen wir während der gesamten Abschlussprüfung nach pflichtgemäßem Ermessen und mit professioneller Skepsis vor. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

 die Identifizierung und Beurteilung des Risikos wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können;



- Erlangung eines Verständnisses der f
  ür die Abschlusspr
  üfung relevanten internen Kontrollen, um den Umst
  änden angemessene Pr
  üfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der verwendeten Rechnungslegungsgrundsätze und die Plausibilität der geschätzten Werte in der Rechnungslegung und der vom Verwaltungsrat des Fonds diesbezüglich gemachten Angaben;
- Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Revisionsbericht auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerung beruht auf den bis zum Datum unseres Revisionsberichts erlangten Prüfungsnachweisen. Allerdings können zukünftige Ereignisse oder Bedingungen dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht mehr fortgeführt werden kann.
- Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen, und der Frage ob die Grundgeschäfte und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Wir geben den mit der Unternehmensführung beauftragten Personen gegenüber zudem eine Erklärung ab, dass wir die relevanten ethischen Anforderungen in Bezug auf die Unabhängigkeit erfüllt haben, und teilen ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte mit, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, sowie gegebenenfalls die Maßnahmen zur Beseitigung von Bedrohungen bzw. die demgegenüber getroffenen Schutzvorkehrungen.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative Vertreten durch

Luxemburg, 30. Januar 2024

Elektronisch unterzeichnet durch Lena Serafin

Lena Serafin

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergleichstabelle

#### GESAMTES NETTOVERMÖGEN

GESAMTES NETTOVERMOGEN				
Portfolio	Portfoliowährung	30. September 2023	30. September 2022	30. September 2021
CT (Lux) Diversified Growth	Euro	107.090.084	104.780.459	124.591.255
CT (Lux) Euro Bond	Euro	86.063.404	195.650.491	220.553.944
CT (Lux) European Growth & Income	Euro	36.939.391	31.772.310	38.443.982
CT (Lux) European Smaller Cap	Euro	7.221.481	7.184.580	14.258.265
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	Euro	172.334.423	188.073.564	594.928.247
CT (Lux) Global Convertible Bond	Euro	29.491.266	43.063.394	147.796.126
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity	USD	3.991.941	3.892.026	7.381.924
CT (Lux) Global Total Return Bond	Euro	29.579.423	96.412.283	103.623.386
CT (Lux) Plus II *	Euro	K. A.	48.662.658	168.038.728
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	Euro	43.984.068	136.764.855	149.162.223
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	USD	342.392.652	454.811.665	728.167.995
CT (Lux) Responsible Global Equity	Euro	746.339.696	1.257.752.063	1.563.267.074
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity	USD	1.052.196.572	1.123.515.114	1.801.879.502
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income *	USD	430.548.760	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income	Euro	63.941.425	76.050.831	95.804.399
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity	Euro	13.715.687	17.663.799	33.828.131
CT (Lux) US Smaller Companies	USD	14.154.214	12.836.801	16.737.142

\*Siehe Anhang I.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergleichstabelle (Fortsetzung)

#### NETTOINVENTARWERT PER ANTEIL

NETTOINVENTARWERT PER ANTEIL				
Währung der	Währung der Anteilsklasse	30. September 2023	30. September 2022	30. September 2021
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - Euro	Euro	10,71	10,24	11,58
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	GBP	12,03	11,34	12,70
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	10,17	9,67	10,87
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	GBP	11,38	10,59	11,70
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse X - Euro	Euro	163,50	154,05	171,49
CT (Lux) Euro Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	111,68	114,60	136,29
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	23,46	19,45	22,30
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	GBP	23,55	19,78	22,20
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro	Euro	26,92	23,99	37,45
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	12,53	11,16	17,26
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	Euro	15,27	13,56	21,14
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	13,89	12,27	18,83
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	CHF	10,39	9,34	14,37
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	Euro	9,75	8,65	13,49
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	14,97	13,24	20,32
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged)	GBP	10,66	10,32	11,05
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	9,87	9,70	10,51
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged)	GBP	10,40	10,09	10,85
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	JPY	966,12	978,16	1.059,56
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - USD (Hedged)	USD	11,02	10,61	11,39
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)	CHF	11,34	11,08	13,68
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)	CHF	11,35	11,10	13,68
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro	Euro	19,38	19,26	22,33
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)	Euro	16,11	15,49	19,57
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	Euro	12,07	11,60	14,26
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - GBP	GBP	17,29	17,39	19,84
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged)	USD	13,98	13,11	15,86
CT (Lux) Global Convertible Bond Hong Kong - Anteile Klasse A - USD	USD	13,18	12,11	16,55
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - CHF (Hedged)	CHF	10,87	10,60	13,02
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	13,99	13,85	15,81
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)	Euro	17,23	16,46	20,42
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged)	Euro	10,25	9,81	12,24
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro	Euro	12,64	12,52	14,32
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	23,09	21,35	25,65
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	15,02	12,85	18,26
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	18,74	16,04	22,80
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I Acc - GBP	GBP	25,18	23,37	27,32
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I - USD	USD	K. A.	K. A.	22,62
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	K. A.	K. A.	21,64
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	9,99	9,84	11,10
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	JPY	942,55	955,56	1.073,98
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged)	USD	10,14	9,95	11,24
CT (Lux) Plus II - Anteile Klasse I Acc - Euro*	Euro	K. A.	12,26	13,05
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	Euro	9,21	8,92	10,58
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	9,34	9,00	10,64
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	9,38	9,03	10,68
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged)	GBP	8,91	8,53	9,99
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF	CHF	7,95	7,61	10,58
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	9,95	9,65	11,88
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	23,99	21,53	31,35
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD CHF	8,57	7,68	11,18
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF		8,21	7,81	10,75
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	10,39	10,01	12,20
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	8,94	7,95	11,48
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - CHF	CHF	8,19	7,80	10,76
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	Euro	9,29	8,94	10,89
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	8,98	7,98	11,49
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF	CHF	8,20	7,80	10,77
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	12,70	12,23	14,91
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	13,40	13,05	15,57
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	11,93	10,60	15,31
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse X Acc - USD	USD	K. A.	K. A.	13,75
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	8,15	7,89	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	7,70	6,88	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	Euro	8,22	7,93	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	7,78	6,91	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	27,63	26,84	31,07
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	14,95	14,52	16,81
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc – SEK CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD	SEK USD	135,24	124,17	134,09
		26,76	24,08	32,96

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergleichstabelle (Fortsetzung)

#### NETTOINVENTARWERT PER ANTEIL

NETTOINVENTARWERT PER ANTEIL				
Währung der	Währung der Anteilsklasse	30. September 2023	30. September 2022	30. September 2021
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	12,70	11,41	15,64
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	CHF	11,81	11,33	14,58
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	Euro	30,27	29,25	33,62
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	13,48	12,99	14,92
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	GBP	13,72	13,41	15,08
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	USD	16,70	15,51	21,11
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	13,20	11,76	15,96
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	Euro	18,66	17,98	20,66
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	GBP	14,27	13,98	15,75
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	17,84	15,91	21,62
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	Euro	24,23	23,45	26,96
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	18,76	18,09	20,78
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	17,80	15,88	21,58
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse X - Euro	Euro Euro	12,92 8,32	12,34 8,06	14,17 K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	8,32	8,06	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	7,84	7,03	K. A. K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - 03D	Euro	8,42	8,11	K. A. K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR - Euro	Euro	8,39	8,11	K. A.
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse AK - Euro	Euro	12,97	12,65	14,91
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	Euro	12,03	11,19	14,49
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	12,05	10,90	15,18
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - GGD	Euro	13,47	13,04	15,22
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	12,51	11,21	15,49
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	11,09	9,93	13,73
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	CHF	8,29	7,78	10,11
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	13,46	13,02	15,21
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	GBP	12,80	12,60	14,46
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	12,94	12,69	14,52
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP (Hedged)	GBP	8,74	7,98	10,15
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	11,06	9,92	13,71
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse X Inc - USD*	USD	9,19	K. A.	K. A.
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	13,05	12,73	14,96
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - USD	USD	12,10	10,92	15,20
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	CHF	10,74	10,42	13,72
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)	CHF	11,86	11,17	14,60
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - CHF (Hedged)	CHF	12,18	11,39	14,77
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - Euro (Hedged)	Euro	12,59	11,60	14,88
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - GBP (Hedged)	GBP	12,91	11,76	14,93
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - USD (Hedged)	USD	13,65	12,28	15,68
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	Euro	13,62	13,15	15,31
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	12,65	11,32	15,60
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)*	CHF	9,52	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)*	CHF	9,52	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro*	Euro	9,67	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)*	Euro	9,53	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro*	Euro	9,67	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)*	Euro	9,53	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - USD*	USD	9,36	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - USD*	USD	9,36	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro*	Euro	9,68	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)*	Euro	9,54	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro*	Euro	9,68	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro (Hedged)*	Euro	9,54	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - USD*	USD	9,37	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - USD*	USD	9,37	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R - Euro*	Euro	9,68	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Acc - Euro*	Euro	9,68	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - USD*	USD	9,37	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)*	CHF	9,54	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - Euro (Hedged)*	Euro	9,55	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - USD*	USD	9,38	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - CHF (Hedged)*	CHF	9,53	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - CHF (Hedged)*	CHF	9,53	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - Euro (Hedged)*	Euro	9,55	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - Euro (Hedged)*	Euro	9,55	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - GBP (Hedged)*	GBP	9,57	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - USD*	USD	9,37	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - CHF	CHF	K. A.	K. A.	11,70
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	739,59	784,91	923,28

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergleichstabelle (Fortsetzung)

NETTOINVENTARWERT PER ANTEIL

Währung der	Währung der Anteilsklasse	30. September 2023	30. September 2022	30. September 2021
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1.189,96	1.222,14	1.393,62
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	101,19	103,89	118,35
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	Euro	10,05	10,41	11,88
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	10,59	10,75	12,08
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	Euro	847,51	893,24	1.043,33
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	10,46	10,64	12,01
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	Euro	9,89	10,31	11,85
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	10,35	10,56	11,97
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	24,50	21,45	26,87
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	12,50	10,82	13,53
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	12,15	10,41	12,89
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	10,74	9,25	11,50
CT (Lux) US Smaller Companies - Anteile Klasse A - USD	USD	240,95	208,92	265,70

\*Siehe Anhang I.

Wir weisen darauf hin, dass in diesem Bericht enthaltene Vergleiche mit einer Benchmark lediglich zu Informationszwecken bzw. zur Berechnung einer Performancevergütung verwendet werden. Die Anlageziele der Portfolios bestehen nicht in der Nachbildung oder Nachahmung einer spezifischen Benchmark.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Anzahl der Anteile im Umlauf

zum 30. September 2023

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Anteile im Umlau
CT (Lux) Diversified Growth, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - Euro	Euro	112.105
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	GBP	1.653.041
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	610
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	GBP	297.523
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse X - Euro	Euro	483.595
CT (Lux) Euro Bond, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Euro Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	770.646
CT (Lux) European Growth & Income, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	176.612
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	GBP	1.207.791
CT (Lux) European Smaller Cap, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro	Euro	213.348
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	50.012
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	Euro	6.024
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	3.369
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	CHF	8.020
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	Euro	28.194
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	23.471
CT (Lux) Global Absolute Return Bond, Portfolio ausgedrückt in Euro	075	
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged)	GBP	10.054.747
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged)	GBP	4.063.473
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	JPY	1.000
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - USD (Hedged)	USD	1.000
CT (Lux) Global Convertible Bond, Portfolio ausgedrückt in Euro		45.000
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)	CHF	15.289
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)	CHF	121.488
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro	Euro	778.820
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	Euro Euro	132.107 44.481
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A ACC - Luto (nedged)	GBP	25.874
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged)	USD	52.533
CT (Lux) Global Convertible Bond Hong Kong - Anteile Klasse A - USD	USD	54.311
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - CHF (Hedged)	CHF	770
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	14.936
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)	Euro	40.412
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged)	Euro	82.001
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro	Euro	513.176
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity, Portfolio ausgedrückt in USD		
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1.829
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	1.350
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	141.041
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I Acc - GBP	GBP	41.776
CT (Lux) Global Total Return Bond, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	2.932.448
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	JPY	1.000
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged)	USD	29.502
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	Euro	3.723.85
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	846.83
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	34.88
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged)	GBP	142.279
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity, Portfolio ausgedrückt in USD		
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF	CHF	300
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	677.08
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	1.936.61
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	674.005
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	CHF	100
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	2.177.679
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	5.008.380

# Columbia Threadneedle (Lux) III Anzahl der Anteile im Umlauf (Fortsetzung) zum 30. September 2023

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Anteile im Umlau
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - CHF	CHF	97.900
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	Euro	20.657
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	100
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF	CHF	42.266
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	6.475.273
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	2.824.010
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	6.532.360
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	100
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	Euro	192.671
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	100
CT (Lux) Responsible Global Equity, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	3.746.737
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	838.397
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - SEK	SEK	251.268
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	384.118
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	153.292
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	CHF	906.865
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	Euro	7.678.039
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	4.929.000
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	GBP	115.819
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	USD	10.741
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	4.283.431
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	Euro	93.500
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	GBP USD	373.687
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD		67.986 325.865
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	2.836.205
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro USD	2.830.200
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse X - Euro	Euro	102
CT (Lux) Responsible Global Equity - Antelle Klasse XA Acc - Euro	Euro	102
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - Euro	Euro	100
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	100
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XP - Euro	Euro	100
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR - Euro	Euro	21.082.425
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity, Portfolio ausgedrückt in USD		
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	162.522
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	Euro	38.152
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	113.973
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	738.825
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	238.978
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	5.100
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	CHF	26.194
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	233.703
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	GBP	3.591.041
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	457.653
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP (Hedged)	GBP	5.207
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	42.607
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse X Inc - USD*	USD	1.367
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	10.452
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - USD	USD	19.754
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	CHF	260.000
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)	CHF	1.447.94
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - CHF (Hedged)	CHF	19.224.38
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - Euro (Hedged)	Euro	14.411.75
T (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - GBP (Hedged)	GBP	6.823.69
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - USD (Hedged)	USD	28.354.30
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	Euro	33.96
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	133.04
T (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income, Portfolio ausgedrückt in USD		
T (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)*	CHF	1.30
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)*	CHF	1.304

# Columbia Threadneedle (Lux) III Anzahl der Anteile im Umlauf (Fortsetzung) zum 30. September 2023

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Anteile im Umlauf
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)*	Euro	1.362
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)*	Euro	110.784
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - USD*	USD	100
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - USD*	USD	100
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)*	Euro	1.362
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro (Hedged)*	Euro	1.362
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - USD*	USD	100
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - USD*	USD	100
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Acc - Euro*	Euro	91
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - USD*	USD	47.500
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)*	CHF	41.298
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - Euro (Hedged)*	Euro	43.143
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - USD*	USD	45.348.861
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - CHF (Hedged)*	CHF	41.244
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - CHF (Hedged)*	CHF	41.298
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - Euro (Hedged)*	Euro	43.126
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - Euro (Hedged)*	Euro	43.143
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - GBP (Hedged)*	GBP	36.916
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - USD*	USD	47.500
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	74.395
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	7.245
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	1.590
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	Euro	105
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	Euro	103
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	Euro	2.670
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	16.142
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity, Portfolio ausgedrückt in Euro		
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	193.454
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	718.151
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	100
CT (Lux) US Smaller Companies, Portfolio ausgedrückt in USD	_0.0	.50
CT (Lux) US Smaller Companies - Anteile Klasse A - USD	USD	58.743
	000	00.1-40

\*Siehe Anhang I.

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Diversified Growth

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A eine Rendite von 4,6 %. Im Vergleich dazu erzielte die Benchmark, die ESTR (Euro Short Term Rate) + 4 % p. a., im gleichen Zeitraum eine Rendite von 6,5 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Aktien waren der Haupttreiber für die Renditen, da der Markt stieg. Unterstützt wurde dies durch eine taktische Übergewichtung der Positionierung im Vereinigten Königreich zu Beginn des Berichtszeitraums, während eine im Juli umgesetzte Optionsabsicherung gegen einen Rückgang des S&P500 dazu beitrug, die Erträge weiter zu steigern, als der US-Markt fiel. Unsere bevorzugten Märkte, Japan und später das Vereinigte Königreich, erzielten eine Outperformance. Das globale Aktienteam verzeichnete ein starkes Jahr, wobei sowohl die Titelauswahl als auch die Sektorpositionierung zu den Erträgen beitrugen. Da die Anleiherenditen stiegen, schmälerten sowohl Staats- als auch Unternehmensanleihen die Rendite des Portfolios im Berichtszeitraum. Alternative Anlagen leisteten einen positiven Beitrag, wobei die alternativen Strategien, wie zum Beispiel Risikoprämien, den größten Beitrag leisteten. Die steigenden Zinssätze wirkten sich jedoch negativ auf mehrere alternative Beta-Bereiche aus, wie Private Equity und Immobilienbeteiligungen, bei denen sich die Abschläge vergrößerten und die Nettoinventarwerte sanken.

#### Marktrückblick

Die globalen Aktienmärkte legten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und stiegen dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die Besorgnis über Inflation und Rezession blieb jedoch bestehen, auch wenn sie abnahm. Das Jahr 2023 begann mit einer Reihe von Börsenrallys, unterstützt durch die Aufhebung der Covid-Beschränkungen in China, einen warmen Winter, der eine Energiekrise in Europa verhinderte, und eine erwartete Abschwächung der Zinsanhebungen. Dennoch hielt die US-Notenbank (Fed) angesichts der robusten US-Wirtschaft an ihrer restriktiven Zinspolitik fest, was zu Marktvolatilität führte. Darüber hinaus sorgten der Zusammenbruch zweier regionaler Kreditinstitute in den USA und die Rettung der Credit Suisse durch die UBS im Frühjahr für eine kurzzeitige Angst vor einer Finanzkrise. Die Konjunkturerholung in Chinas nach der Aufhebung der Covid-Beschränkungen enttäuschte angesichts des angeschlagenen chinesischen Immobilienmarktes trotz bescheidener Konjunkturmaßnahmen, was sowohl den Binnenmarkt als auch die auf China ausgerichteten Aktien belastete. Darüber hinaus haben die Anleger gegen Ende des Berichtszeitraums die Aktienbewertungen neu kalibriert, als sie feststellten, dass die höheren Zinssätze anhalten und die Kreditkosten steigen würden. Die Renditen der weltweiten Staatsanleihen stiegen im Berichtszeitraum, als Reaktion auf die steigenden Zinssätze. Im letzten Quartal 2022 kam es zu einem sprunghaften Anstieg, da Inflationsängste und das Tempo der Zinsanhebungen im Vordergrund standen. Die Renditen gingen jedoch wieder zurück, als das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 nachließ und die Anleger mit einem Höchststand der Zinssätze und sogar mit Zinssenkungen rechneten, falls sich das Wirtschaftswachstum abschwächen sollte. In den letzten Monaten des Berichtszeitraums stiegen sie jedoch auf neue Höchststände, selbst als sich der Höchststand der Zinssätze näherte, da die Zentralbanken signalisierten, dass die Zinssätze "länger höher" bleiben würden. Dies wurde von einer Versteilerung der Renditekurve begleitet, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit in Erwartung einer lockereren Geldpolitik stiegen, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Während die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads, was die relative Widerstandsfähigkeit des Wirtschaftswachstums und solide Erträge widerspiegelte.

#### Ausblick

Mit Blick auf die Zukunft rechnen wir nach wie vor mit einer Verlangsamung des globalen Wachstums gegenüber dem Trendniveau, begleitet von einer geringeren, aber immer noch über dem Trend liegenden Inflation. Unsere jüngsten Untersuchungen deuten darauf hin, dass die Auswirkungen der bereits erfolgten Zinserhöhungen in den USA, der Eurozone und dem Vereinigten Königreich auf das BIP-Wachstum wahrscheinlich erst Ende dieses Jahres oder Anfang 2024 vollständig spürbar werden, wenn die bisherigen Straffungszyklen als Anhaltspunkt genommen werden können. Auch wenn der genaue Zeitpunkt ungewiss ist, sind wir zuversichtlich, dass die Wirtschaftstätigkeit von nun an zunehmend die Auswirkungen der früheren geldpolitischen Straffung spüren wird. Dies deutet auf einen positiven fundamentalen Ausblick für Kern-Staatsanleihen hin, deren Renditeaufschläge im Vergleich zu den langfristigen BIP-Prognosen historisch hoch sind. Obwohl wir die Anlageklasse konstruktiv einschätzen, erwarten wir weiterhin eine hohe Volatilität. Bei Unternehmenskrediten, deren Bewertungen eher angemessen als attraktiv sind, dürften die geringen Wachstumsaussichten im kommenden Jahr zu unterdurchschnittlichen, aber immer noch positiven Überschussrenditen gegenüber Kernanleihen führen. Die ermutigende Mischung aus Disinflation und Wirtschaftswachstum in den USA hat dazu geführt, dass wir die Aussichten für Aktien konstruktiver einschätzen als noch vor einigen Monaten. Dennoch bleiben wir in Bezug auf die Anlageklasse als Ganzes etwas zurückhaltend. Das schleppende Wachstum stellt ein leichtes Risiko für die Unternehmensgewinne dar, und, was besorgniserregender ist, die globalen Aktienbewertungen (auf der Basis des Kurs-Gewinn-Verhältnisses) sind im historischen Vergleich hoch, sowohl absolut als auch im Vergleich zu anderen Anlageklassen. Der anhaltende Konflikt in der Ukraine zeigt keine Anzeichen für ein baldiges Ende, und die Eskalation der Spannungen im Nahen Osten bedeutet, dass geopolitische Risiken auf absehbare Zeit weiterhin die Schlagzeilen beherrschen werden.

#### Multi-Asset-Team

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODE	R AN EINEM AND	DEREN GEREGELTEN	MARKT NOTIER	TE ÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIER	E
ANLEIHEN						
Deutschland	0.50.%	15.04.2020	EUR	4 061 240	4 096 090	4.66
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	0,50 %	15.04.2030	EUR	4.961.240	4.986.989	4,66
USA United States Treasury Inflation Indexed Bonds	0,13 %	15.01.2032	USD	3.859.450	3.056.488	2,85
ANLEIHEN GESAMT					8.043.477	7,51
FONDS						
Guernsey				505 700	1 050 0 40	
Apax Global Alpha Ltd. Hipgnosis Songs Fund Ltd.				565.780 1.131.635	1.059.243 1.046.268	0,99 0,98
NB Private Equity Partners Ltd. 'L'				59.631	1.040.208	1,02
Renewables Infrastructure Group Ltd.				778.474	956.673	0,89
Irland					4.149.712	3,88
iShares Core U.K. Gilts UCITS ETF				926.070	4.409.945	4,12
iShares USD High Yield Corp. Bond UCITS ETF 'D'				364.000	1.418.399	1,32
iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF				1.140.855	4.597.988	4,29
Leadenhall Ucits IIs Fund PLC 'B' Twelve Cat Bond Fund 'SI2'				24.962 27.862	2.993.598 3.294.740	2,80 3,08
				21.002	0.20 111 10	0,00
Jersey					16.714.670	15,61
3i Infrastructure PLC				292.726	1.027.568	0,96
Digital 9 Infrastructure PLC				1.452.177	647.877	0,60
Luxemburg					1.675.445	1,56
Amundi Euro High Yield Bond ESG UCITS ETF DR				7.000	1.571.710	1,47
Amundi Prime Euro Corporates UCITS ETF DR Amundi Prime Euro Govies UCITS ETF DR				877.262 300.665	15.477.972 4.936.919	14,45
Lyxor ESG USD Corporate Bond DR UCITS ETF				117.876	9.875.977	4,61 9,22
						00.75
Vereinigtes Königreich				071 040	31.862.578	29,75
Downing Renewables & Infrastructure Trust PLC Greencoat U.K. Wind PLC				871.248 627.794	894.915 1.013.228	0,83 0,95
					1.908.143	1,78
FONDS GESAMT					56.310.548	52,58
ANTEILE						
Australien						
BHP Group Ltd.				3.432	92.576	0,09
National Australia Bank Ltd.				6.228	110.364	0,10
Qantas Airways Ltd.				14.677	46.345	0,04
Rio Tinto Ltd. Westpac Banking Corp.				1.299 7.831	89.915 100.963	0,08 0,10
Kanada					440.400	0.41
Kanada Brookfield Corp.				3.846	<b>440.163</b> 114.109	<b>0,41</b> 0,11
Canadian Natural Resources Ltd.				2.433	149.301	0,11
Imperial Oil Ltd.				3.100	181.180	0,17
Loblaw Cos. Ltd.				2.306	185.907	0,17
Suncor Energy, Inc.				5.401	176.244	0,16
Dänemark					806.741	0,75
AP Moller - Maersk AS 'B'				30	51.234	0,05
Novo Nordisk AS 'B'				6.498	561.093	0,52
Finnland					612.327	0,57
Nordea Bank Abp				8.846	92.378	0,09

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Frankreich			
BNP Paribas SA	2.542	153.613	0,14
Cie de Saint-Gobain	659	37.484	0,04
Eiffage SA	436	39.257	0,04
Engie SA	8.320	120.890	0,11
L'Oreal SA	331	130.149	0,12
TotalEnergies SE Vinci SA	5.632 500	350.930 52.510	0,33 0,05
-	500	884.833	0,83
Deutschland		100.005	
Bayerische Motoren Werke AG Deutsche Lufthansa AG	4.236	408.265	0,38
Deutsche Telekom AG	10.897 12.214	81.793 242.668	0,07 0,23
		732.726	0,68
Irland			
Accenture PLC 'A'	1.543	447.576	0,42
Italien			
Eni SpA	5.158	78.691	0,07
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	3.727	46.699	0,05
Snam SpA	10.375	46.158	0,04
Japan		171.548	0,16
ANA Holdings, Inc.	16.500	327.197	0,31
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd	13.800	403.889	0,38
Honda Motor Co. Ltd.	16.500	175.661	0,16
Hoya Corp.	1.000	96.999	0,09
ITOCHU Corp.	7.300	249.783	0,23
Japan Airlines Co. Ltd.	4.200	77.305	0,07
Japan Post Bank Co. Ltd.	11.500	94.698	0,09
Japan Tobacco, Inc.	4.000	87.093	0,08
Mitsubishi Corp.	3.700	166.930	0,16
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	56.700	455.238	0,42
Mitsui & Co. Ltd.	2.200	75.514	0,07
Nippon Telegraph & Telephone Corp. Nitto Denko Corp.	317.500 2.000	354.895	0,33 0,12
Ono Pharmaceutical Co. Ltd.	3.900	124.158 70.796	0,12
Shimano, Inc.	1.400	178.686	0,07
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	7.200	197.919	0,17
Tokio Marine Holdings, Inc.	5.700	125.009	0,12
		3.261.770	3,05
Luxemburg ArcelorMittal SA	14.907	354.414	0,33
Niederlande			
ABN AMRO Bank NV	4.421	59.418	0,06
ASML Holding NV	521	291.291	0,27
Koninklijke Ahold Delhaize NV	5.078	144.825	0,13
NXP Semiconductors NV	1.242	234.523	0,22
OCI NV	3.149	83.102	0,08
Randstad NV Stellantis NV	3.092 23.544	161.959 428.736	0,15 0,40
		1.403.854	1,31
Norwegen	2.524	40.000	0.04
DNB Bank ASA Equinor ASA	2.524 13.360	48.302 416.418	0,04 0,39
		464.720	0,43
Singapur	0.000	74.400	0.07
DBS Group Holdings Ltd. Singapore Airlines Ltd.	3.200 23.500	74.492 105.053	0,07 0,10
		179.545	0,17
Spanien			
Endesa SA	7.533	145.199	0,14
Iberdrola SA Industria de Diseno Textil SA	32.557 4.894	344.941	0,32
	4.094	172.709 662.849	0,16
Schweden		002.043	0,02
Investor AB	5.664	103.309	0,10

Shree         Section         Section <thsection< th=""> <thsection< th=""> <thsec< th=""><th>Wertpapierbezeichnung</th><th>Stück/ Nennwert</th><th>Marktwert in EUR</th><th>% des Nettover- mögens</th></thsec<></thsection<></thsection<>	Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Kuhne K Nagel International AG         441         129.618         0.12           Racin Humano Group AG.         148         52.699         0.00           Actin Humano Group AG.         148         52.999         0.00           Variand Lass         42.344         52.999         0.00           Actin Humano Group AG.         42.344         97.716         0.00           Actin Humano Group AG.         42.344         0.00				
Nacaria Na, <sup>-</sup> 2.039         197.617         0.16           Zurin humano Group AC,         108         89.470         0.06           Xana DL, Comp AC,         108         89.470         0.06           Varialges Köngreich         44.02         89.77         43.46         0.04           Ava PLC         44.02         89.77         43.46         0.04           Land Inogat Healinger Koll         29.25         49.04         0.03           J Samston FG         109.75         1.08         1.03           Land Inogat Healinger Koll         29.25         1.03         1.03           Land Inogat Healinger Koll         100.75         1.03         1.03           Nathore Koll         1.03         1.03         1.03         1.03           Nathore Koll         3.03         1.02,55         0.17         1.03           Nathore Koll         3.03         27.55         0.17         1.03         1.03           Nathore Koll         3.03         27.55         0.17         0.13         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03         1.03				
Rache Molang AG         346         98.470         0.06           Versingles Kolmpich         559.992         0.50           Avers PLG         0.677         0.68         0.017           Avers PLG         0.677         0.53.992         0.50           Status PLG         0.677         0.53.992         0.50           HSGC Holdings PLG         2.50.96         0.012.91         0.013           Status PLG         0.51.97         0.51.95         0.013           Status PLG         0.51.97         0.51.95         0.013           Status PLG         0.51.97         0.75.97         0.75.95         0.77           Variables Graup PLC         0.51.97         0.75.95         0.77         0.75.95         0.77           Variables Graup PLC         0.52.97         0.72.95         0.77         0.75.95         0.77           Variables Graup PLC         0.52.97         0.72.95         0.77         0.75.96         0.77.95           Variables Graup PLC         0.50.97         0.77.46         0.70.97         0.72.46         0.77.97           Variables Graup PLC         0.50.97         0.77.46         0.77.46         0.77.46         0.77.46         0.77.47         0.75.97				
S93.992         0.50           Versinglics         9.37         13.486         0.01           Commits PLC         25.3961         105.201         0.01           HSBC Holdings PLC         25.3961         105.201         0.01           Jainstony PLC         15.51.81         45.51.61         0.01           Jainstony PLC         15.51.81         45.51.61         0.01           Marking Singup PLC         15.51.81         0.21         0.22           Voldings PLC         33.397         304.64.53         0.28           Marking Inc         33.300         473.050         0.44           Ababin, Inc         373.050         0.44         0.28           Ababin, Inc         373.050         0.44         0.28           Ababin, Inc         373.050         0.44         0.26           Ababin, Inc         1.066         215.510         0.22           Ababin, Inc         1.066         215.510         0.26           Ababin, Inc         1.066         215.510         0.26           Ababin, Inc         1.038         10.016         0.15           Amazon, Com         1.038         10.016         0.15           Amazon, Com         1.038				
Verticipate Kinigraphi         Verticipate           Centrics PLG         45.246         0.77         45.460         0.04           BSC Holdings PLG         92.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.258         193.259         194.443         0.258         193.259         194.443         0.258         193.259         194.443         0.258         193.259         193.4444         0.258         193.259         193.4444         0.258         193.259         193.4444         0.258         193.259         193.4444         0.258         143.253         0.44         43.566         0.500         143.4445         0.258         143.145         10.566         0.563         0.564         0.533         85.662         0.50         143.444         0.258         143.253         0.229         A44.44         0.258         143.244         0.428         143.444         0.258         143.243         143.444         0.258         143.243         143.444         0.258         143.243         143.243         143.243         143.	Zurich Insurance Group AG.	168		
Avia PLC         9.877         43.848         0.04           HBGC Hadings PLC         25.981         93.251         0.91           HBGC Hadings PLC         15.911         95.911	Manala Internet Manalak		539.992	0,50
HBSC Holdings PLC         25.084         822.234         083           J.Sinstow PLC         15.618         45.514         00.33           J.Sinstow PLC         15.618         45.514         00.34           J.Sinstow PLC         15.618         45.514         00.34           Volatows Group PLC         240.879         0.704.83         00.28           USA         2.300         727.616         0.28           USA         3.530         727.616         0.28           USA         3.530         727.616         0.26           Aphylin, Inc.         3.530         727.616         0.26           Aphylin, Inc.         1.580         221.510         0.20           Aphate, Inc. Y         6.331         856.62         0.80           Aphate, Inc. Y         1.580         2.511         0.20           Aphate, Inc. Y         1.580         0.31         0.38         40.019         0.13           Aphate, Inc. Y         1.580         0.31         0.38         40.919         0.13           Aphate, Inc. Y         1.580         0.31         0.38         40.919         0.13           Ampend Corp. W         1.591         1.533         0.38         40.918		9.677	43.486	0,04
Impain Real PLC         B82.364         0.03.           Joinsbury PLC         1.07.561         1.06.144         1.00.           LN RET PLC         1.07.561         1.06.144         1.00.           Valian Group PLC         9.57.97         3.04.643         0.07           Valian Group PLC         3.04.643         0.07           Valian Group PLC         3.04.643         0.07           Valian Group PLC         3.06.0         473.050         0.44           Abble, Inc.         3.08.0         473.050         0.44           Abble, Inc.         1.63.1         0.65.67         0.26.           Aphabel, Inc. Group PLC         1.63.4         40.65.67         0.28.           Aphabel, Inc. Group PLC         1.03.4         40.65.67         0.38.           Aphabel, Inc. Group PLC         1.03.6         1.03.8         1.03.4         0.03.8           Amaron.com         1.03.8         1.03.8         0.11.3         0.13.8<				,
J Sameshuy PLC         15.618         4.5.518         0.00.514           NatWest Group PLC         0.00.5144         1.000           NatWest Group PLC         0.00.5144         1.000           Valadium Group PLC         0.28.597         0.200         0.28           Valadium Group PLC         0.330         473.050         0.44           AbbVie, Inc.         3.300         473.050         0.44           Abbvie, Inc.         5.70         2.74.515         0.26           Ahbrie, Inc.         0.600         2.15.33         0.20           Aphabet, Inc.         0.600         2.15.33         0.20           Aphabet, Inc.         0.600         2.15.33         0.20           Aphabet, Inc.         0.540         4.05.03         0.20           Aphabet, Inc.         0.540         4.05.03         0.20           American Tower Corp.         1.056         4.05.13         0.23           American Tower Corp.         1.566         4.05.13         0.22           Aphe Inc.         2.020         66.831         0.22           Automatic Dhar Processing Inc         2.020         66.831         0.22           Backery Mark Standers         2.767         35.55         0.23				,
LN RET PLC         10.01.75.81         1.065.144         1.00           NartNet Group PLC         36.497         775.558         0.07           Vadianc Group PLC         289         7         304.843         0.28           USA         280         280         7         243.997         7         243.907         0.44           Abble, Inc.         3.360         473.050         0.44         4.066, Inc.         7.70         274.315         0.260           Aphabet, Inc. 'G         5.405         673.164         0.03         3.41         0.03           Aphabet, Inc. 'G         5.405         673.164         0.03         3.41         460.93         0.66           Amprox.         1.660         1.562         0.16         0.43         0.43           Amprox.         1.660         1.563         0.15         0.16				
Voldiome Group Pic         343.997         304.643         0.28           USA         2.808.678         2.808.678         2.808.678         2.808.678           USA         3.300         473.605         0.44           Abovin Inc         1.60         1.60         2.73.500         0.44           Aphabet, Inc. Y         6.301         865.652         0.600           Aphabet, Inc. Y         5.405         6.73.104         0.633           Aphabet, Inc. Y         6.301         856.662         0.600           Aphabet, Inc. Y         6.303         866.662         0.600           Aphabet, Inc. Y         6.304         0.640         0.400           Amazon.com         1.528         0.401         0.610         0.15           Applent Corp.         1.608         1.63.81         0.413         0.330         0.221           Applent Dorp. Y         1.608         1.53.893         0.21         0.200         666.331         0.66           Applent Dorp. Y         1.608         1.53.893         0.21         0.200         0.66         0.46           Applent Dorp. Inc.         1.608         2.33.90         0.200         0.66         0.45.41         0.77         0.731 <t< td=""><td>•</td><td></td><td></td><td></td></t<>	•			
USA         Abbits         Z400.678         Z402           Abbits         3.060         473.050         0.44           Adbots, Inc.         5.70         274.915         0.26           Abbits, Inc.         70         274.915         0.26           Aphabit, Inc. Y         1.660         271.103         0.20           Aphabit, Inc. Y         1.64         400.687         0.33           Aphabit, Inc. Y         1.024         400.687         0.33           Amazon.com         1.024         400.687         0.33           Amazon.com         1.036         160.916         0.15           Amphenol Corp. A'         1.000         128.827         0.12           Apple, Inc.         1.096         405.139         0.33           Apple, Inc.         1.022         223.033         0.22           Bortshir balayses         1.02         23.033         0.22           Bortshir balayses         1.02         23.033         0.22           Bortshir balayses         1.02         23.033         0.23           Bristo-Mayer Systems, Inc.         1.02         23.03         0.33           Bradoom, Inc.         7.77         33.30         0.33				
Ubb         Subje         S	Vodatone Group PIC	343.997		
Abde, Inc.         570         274.515         0.28           Aphabet, Inc. 'A'         6.60         251.50         0.20           Aphabet, Inc. 'A'         6.63         656.62         0.80           Aphabet, Inc. 'A'         5.66         673.104         0.63           Ariar Group, Inc.         10.24         406.857         0.38           Amean.com         3.80         425.034         0.40           Amean.com         10.86         425.034         0.40           Amean.com         3.80         425.034         0.40           Amean.com         10.86         425.034         0.40           Amean.com         1.80         425.034         0.40           Amean.com         1.80         425.034         0.40           Apple.in         1.80         1.138.89         0.11           Apple.in         1.80         4.133.879         1.34           Autodesk, Inc.         2.80         6.867         1.32.89         0.12           Brakine Matamay Inc         2.80         6.864         0.48         0.43           Brakine Matamay Inc         2.77         2.52.03         0.30           Brakine Matamay Inc         2.80         0.60	USA		2.000.070	2,02
Arbnie, Inc.         16.60         215.130         0.20           Aphabet, Inc. 'C         6.40         6.605         73.104         0.63           Arbnie Grup, Inc.         12.24         406.857         0.38           Arma Group, Inc.         3.540         425.034         0.63           Armeican Tower Corp.         1.56         605.139         0.354           Ampenol Corp. A'         1.600         12.827         0.12           Apple, Inc.         8.867         1.33.87         1.34           Apple, Inc.         8.867         1.33.87         0.33           Apple, Inc.         8.867         4.33.87         0.33           Apple, Inc.         2.020         8.867         1.33.87         0.43           Apple, Inc.         2.020         8.867         1.33.87         0.43           Apple, Inc.         2.020         8.867         1.33.87         0.43           Boodon, Mayer Spubb Co.         6.712         87.948         0.42           Boodon, Prosessing Inc.         2.767         325.30         0.30           Cadenco Design Systems, Inc.         2.767         325.30         0.30           Cadenco Design Systems, Inc.         2.767         325.30         0.	,			
Aphabet, Inc. 'A'         6.03         655.662         0.00           Aphabet, Inc. 'C'         6.06         673.104         0.63           Arina Group, Inc.         13.24         406.857         0.38           Amazon.com         15.60         452.303         0.04           Amenican Tower Corp.         15.06         405.133         0.03           Ampenican Corp. A'         8.87         1.33.57         1.34           Autoreak, Inc.         8.87         1.33.57         0.13.4           Autoreak, Inc.         8.87         1.33.57         0.13.4           Autoreak, Inc.         8.87         1.33.57         0.13.4           Autoreak, Inc.         2.07         457.33         0.34.5           Beaking Hellingar, Inc.         2.07         457.33         0.34.5           Broakorn, Inc.         2.07         457.33         0.34.5           Broakorn, Inc.         2.07         2.05.30         0.30.5           Capial One Financial Corp.         2.06         9.09         0.090           Capial One Financial Corp.         2.07         25.99         0.00           Capial One Financial Corp.         2.08         9.01         0.01           Capiad One Financial Corp.				
Alphabel, Inc. C         5.405         673.104         0.633           Atria Group, Inc.         12.44         406.857         0.83           Amazon.com         3.540         425.034         0.40           Ampenel Corp.         1.568         405.139         0.38           Ampenel Corp. A'         1.600         125.297         0.12           Apple. Inc.         8.867         1.433.873         1.34           Antolest, Inc.         8.867         1.433.873         0.43           Apple. Inc.         6.867         4.53.93         0.62           Berkshire Hahnavay Inc.         2.020         685.341         0.62           Boolang Holdings, Inc.         7.67         325.30         0.33           Cadenco Design Systems, Inc.         2.767         325.30         0.30           Cadenco Design Systems, Inc.         2.767         325.30         0.30           Cadenco Design Systems, Inc.         1.68         4.21.776         0.39           Calean O Design Systems, Inc.         8.44         4.38.197         0.43           Deso Systems, Inc.         8.44         4.38.197         0.43           Deso Systems, Inc.         2.64         136.24         0.29           Catera Car				
Amaconom         3.540         425.034         0.04           American Tower Cop.         1.596         400.916         0.15           Ampheni Corp. 'A'         1.596         405.139         0.38           Appheni Corp. 'A'         8.867         1.433.879         0.12           Apple, Inc.         8.867         1.433.879         0.12           Actodesk, Inc.         1.028         233.593         0.02           Berkhite Fathanway Inc         0.020         668.341         0.62           Booking Holdings, Inc.         157         457.313         0.43           Bradkorn, Inc.         733         575.032         0.24           Bradkorn, Inc.         1128         249.186         0.33           Cadence Design Systems, Inc.         1128         249.186         0.33           Cadence Design Systems, Inc.         1128         649.06         0.63           Cadence Design Systems, Inc.         1128         649.06         0.63           Cadence Design Systems, Inc.         1128         649.06         0.64           Cadence Design Corp.         101         132.56         0.41           CAME Corp.         101         132.56         0.41           Commast Corp.				
American Tower Corp.         1036         160,916         0.61,513         0.038           Ampen Icorp. 'A'         1.600         126,927         0.12           Apple, Inc.         1.600         126,927         0.12           Autotask, Inc.         553         115,889         0.11           Autotask, Inc.         2.020         668,341         0.02           Berkshire Hahaway Inc         2.020         668,341         0.02           Borking Holfings, Inc.         67,713         357,503         0.03           Bridshe FirstSource, Inc.         2.767         325,500         0.03           Caphen Deling Systems, Inc.         2.767         325,500         0.09           Caphen Deling Systems, Inc.         2.767         325,500         0.09           Caphen Deling Systems, Inc.         1.681         421,776         0.93           Consol Systems, Inc.         1.681         421,776         0.93           Consol Systems, Inc.         3.34         137,360         0.16           Contera Corp.         1.944         4.940         0.16           Contera Corp.         1.945         345,606         0.016           Contera Corp.         1.945         319,607         0.31         0.10				
Ampeninci         15.66         405.139         0.38           Amphenic Corp, 'A'         16.00         128.927         0.12           Aple, Inc.         8.867         1.433.879         1.34           Autodask, Inc.         533         115.889         0.11           Autodask, Inc.         1.028         233.593         0.22           Berkshire Hahmswip Inc.         1.62         233.593         0.23           Broadom, Inc.         7.3         375.032         0.54           Broadom, Inc.         7.33         375.032         0.54           Broadom, Inc.         7.12         367.946         0.30           Cadence Design Systems, Inc.         2.169         118.08         0.10           Cadence Design Systems, Inc.         1.126         249.176         0.31           Cadence Drap.         2.699         169.085         0.10           Cadence Drap.         1.64         421.767         0.31           Cadence Drap.         1.64         421.767         0.34           Cadence Drap.         1.64         421.767         0.34           Cadence Drap.         1.64         421.767         0.34           Cadence Drap.         1.64         421.76				
Amplenic Corp. 'A'         16.00         126.027         0.12           Autoensic Data Processing Inc         58.67         1.433.879         0.11           Autoensic Data Processing Inc         10.28         233.593         0.22           Borkshire Hathaway Inc         2.020         668.341         0.62           Borkshire Hathaway Inc         2.020         668.341         0.43           Bridsto-Mayers Squibb Co.         6.712         367.5032         0.30           Bradcorn, Inc.         2.767         325.530         0.30           Captal One Financial Corp.         2.699         0.09         0.09           Captal One Financial Corp.         1.60         97.990         0.09           Captal One Financial Corp.         1.61         421.776         0.39           Content Corp.         1.64         423.891         0.41           Comeat Corp.         1.64         438.915         0.41           Comeat Corp.         701         122.668         0.101           Comeat Corp.         3.33         135.997         0.131           Comeat Corp.         3.34         137.360         0.13           Comeat Corp.         2.830         102.344         0.00           Derbok,				
Apple, In.         1.433, A79         1.433, A79         1.433, A79         1.433, A79         1.433, A79         1.15, A89         0.11           Autodesk, Inc.         593         115, 889         0.22         668, 341         0.62           Borkine Halthawa Inc         16, 7         457, 313         0.43         0.42           Broadcom, Inc.         73         375, 032         0.54           Broadcom, Inc.         733         375, 032         0.54           Caphal One Financial Corp.         1.126         249, 182         0.23           Caphal One Financial Corp.         1.68         97, 990         0.090           Carlera Corp.         2.599         119, 086         0.16           Cigna Croup         1.581         421, 776         0.339           Cisos Systems, Inc.         1.681         421, 776         0.393           Coreas Corp.         1.84         486, 064         0.46           Coreas Corp.         1.84         438, 915         0.113           Coreas Corp.         1.84         496, 064         0.46           Coreas Corp.         1.84         496, 064         0.46           Coreas Corp.         1.84         496, 064         0.40 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>				
Automatic Data Processing Inc       1.028       323.593       0.22         Berkshire Haltwayn Inc       2.020       668.344       0.62         Booking Holdings, Inc.       157       457.313       0.43         Bristol-Myers Synbb Co.       733       575.032       0.04         Bradkorn, Inc.       2.767       325.350       0.03         Cadence Design Systems, Inc.       1.069       97.990       0.09         Capital One Financial Corp.       1.069       97.990       0.09         Carlen Corp.       2.599       169.085       0.16         Cigna Group       1.561       421.776       0.39         Cisco Systems, Inc.       701       132.566       0.12         Corneast Corp.       11.845       440.44       0.46         Corterat Energy, Inc.       5.323       139.997       0.13         Delta Air Lines, Inc.       2.930       100.394       0.10         Derobox, Inc. 'A       48.04       438.91       0.13         Elevance Health, Inc.       2.33       139.997       0.13         Elevance Health, Inc.       3.04       170.13       0.16         Elevance Health, Inc.       3.04       170.13       0.16         Elev		8.867		
Berkshire Hathaway Inc         2.020         668.341         0.62           Boxing Holdings, Inc.         157         457.313         0.43           Bristo-Myers Squibb Co.         6.712         3567.948         0.34           Bridsot-Myers Squibb Co.         2.767         3525.350         0.50           Cadenco Design Systems, Inc.         1.166         249.142         0.23           Cadenco Design Systems, Inc.         1.561         424.176         0.33           Cadenco Design Systems, Inc.         1.561         424.176         0.39           Cisco Systems, Inc.         701         112.256         0.12           Corncast Corp.         2.930         102.394         0.10           Ordera Energy, Inc.         5.33         135.997         0.13           Delta Air Lines, Inc.         2.930         102.394         0.10           Drapbox, Inc.'A'         4.005         170.11         0.16           Elevance Health, Inc.         3.34         137.360         0.33           Expedia Group. Inc.         4.005         170.11         0.16           Elevance Health, Inc.         2.961         170.13         0.16           Elevance Health, Inc.         3.03         173.10         0.16 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td>,</td>				,
Booking Holdings, Inc.         157         457.313         457.313           Bristol-Myers Syubb Co.         577.032         67.498         0.34           Breadcom, Inc.         273         575.032         0.44           Breadcom, Inc.         2767         252.350         0.30           Cadence Design Systems, Inc.         1.126         249.182         0.23           Cadence Cop.         2.599         160.085         0.166           Cigna Group         8.644         435.915         0.41           Concast Cop.         8.184         435.915         0.41           Concast Cop.         1.186         466.064         0.46           Concast Cop.         2.303         102.34         0.10           Concast Cop.         2.303         102.34         0.10           Dropbox, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           Bey, Inc.         3.34         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         3.34         137.360         0.13           Stard Lop, Inc.         3.34         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         3.34         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         3.34         137.360				,
Bristol Myers Squibb Co.         67.12         367.948         0.34           Broadcom, Inc.         2.767         325.350         0.30           Cadence Design Systems, Inc.         1.06         97.990         0.09           Centere Corp.         2.599         169.085         0.10           Centere Corp.         2.599         169.085         0.16           Cigna Group         1.61         42.177         0.39           Cisco Systems, Inc.         701         132.566         0.12           Cortera Energy, Inc.         5.323         135.997         0.13           Cortera Energy, Inc.         5.331         102.394         0.10           Cortera Energy, Inc.         2.330         102.394         0.10           Cortera Energy, Inc.         3.34         137.360         0.13           Evance Health, Inc.         3.40         21.834         0.20           Evance Health, Inc.         2.96         242.819         0.30           Fait Isac Corp.         2.607         12.938         0.13           Evance Health, Inc.         3.03         157.810         0.15           Fait Inclame BancShares, Inc. M         6.33         561.92         0.30           Fait Citzenes BancSh	•			,
Builders FirstSource, Inc.         2.767         325.350         0.20           Cadence Design Systems, Inc.         1.068         9.79.90         0.09           Centene Corp.         2.599         160.085         0.161           Cigna Group         1.561         421.776         0.39           Cisco Systems, Inc.         8.644         438.915         0.41           Corp. Inc.         701         132.566         0.12           Cortera Energy, Inc.         2.33         135.997         0.13           Cortera Energy, Inc.         2.930         102.394         0.10           Oropbox, Inc.         2.930         102.394         0.10           Dropbox, Inc.         4.849         2.823         102.394         0.10           Systems, Inc.         2.930         102.394         0.10         0.13           Dropbox, Inc.         4.849         128.354         0.20         0.13         2.950         137.360         0.13           Systems, Inc.         1.60         1.60         136.921         0.13         2.950         137.360         0.13           Systems, Inc.         1.707         104.329         0.10         137.360         0.13         1.51         1.51         0.		6.712		
cadene Design Systems, Inc.         1.126         249.130         249.130           Capital One Financial Corp.         1.069         97.990         0.090           Centene Corp.         2.599         169.085         0.16           Cigna Group         1.561         421.776         0.39           Comcast Corp.         701         132.566         0.12           Comcast Corp.         713         135.997         0.13           Delta Air Lines, Inc.         5.323         135.997         0.13           Dorpoko, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           Belta Air Lines, Inc.         2.930         102.394         0.10           Dropkox, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           Belta Air Lines, Inc.         2.930         102.394         0.10           Speciati Group, Inc.         2.930         102.394         0.10           Expeditos International of Washington, Inc.         2.950         139.827         0.30           Fair Isac Corp.         2.96         242.219         0.23           Fait Mizens BancShares, Inc. 'A'         6.67         87.336         0.08           Fortinet Inc         7.009         388.466         0.86				
Capital One Financial Corp.         1.069         97.990         0.09           Centene Corp.         2.569         160.055         0.1561         421.776         0.39           Cisco Systems, Inc.         8.644         438.915         0.41           CME Group, Inc.         701         132.566         0.12           Contras Corp.         11.845         496.064         0.46           Cottera Energy, Inc.         2.930         102.394         0.00           Orphox, Inc.         2.930         102.394         0.00           Orphox, Inc.         4.840         318.4         0.20           Orphox, Inc.         4.933         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         4.965         170.113         0.16           Expedia Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fair Isac Corp.         2.954         319.827         0.30           Fair Isac Corp.         2.956         319.827         0.30           Fair Isac Corp.         2.957         123.81         0.12           Fried Eir Mational Information Services, Inc.         3.023         157.810         0.15           Fried Citzens BancShares, Inc. 'A'         67         87.366         0.080 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>				
Center Corp.         2.599         15.61         421.77         6.75           Cigna Group, Inc.         701         13.561         0.12           Concast Corp.         701         13.2566         0.12           Concast Corp.         5.323         135.997         0.13           Delta Air Lines, Inc.         2.393         102.394         0.10           Dropbox, Inc.*         8.490         2.183.4         0.20           Belta Air Lines, Inc.         3.34         173.730         0.13           Dropbox, Inc.*         4.408.5         170.11         0.16           Elevance Health, Inc.         3.34         173.730         0.13           Expedia Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fair Isace Corp.         2.667         129.381         0.12           Staterial Co.         3.023         157.810         0.15           First Citzens BancShares, Inc.*         3.023         157.810         0.15           Fortine Ir Brands Innovations, Inc.         7.009         388.466         0.36           Fortine Ir Corp.         7.41         21.00         0.30           Krade Corp.         7.83.33         53.126         0.49           Hub Non. </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>				
Cisco Systems, Inc.         8.644         438.915         0.41           CME Group, Inc.         701         132.866         0.12           Concast Corp.         11.845         496.064         0.64           Coterra Energy, Inc.         2.930         102.394         0.10           Dropbox, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           Belta Air Lines, Inc.         4.065         170.113         0.016           Expeditors International OWashington, Inc.         2.934         138.297         0.30           Expeditors International OWashington, Inc.         2.954         318.827         0.30           Fair Isac Corp.         2.964         248.819         0.23           Fait Isac Corp.         2.507         129.381         0.12           Fait Isac Corp.         2.507         129.381         0.12           Frist Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.36         0.08           Fortine Ira         7.009         384.466         0.33         52.126         0.49           Hom Depto, Inc.         1.833         523.126         0.49         4.48         0.33         53.126         0.49           Hom Depto, Inc.         1.833         523.126         0.49				
CME Group, Inc.         701         132.566         0.12           Concast Corp.         11.845         496.064         0.46           Cottera Energy, Inc.         5.323         135.997         0.13           Delta Air Lines, Inc.         2.930         102.394         0.10           Dropbox, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           eBay, Inc.         334         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         334         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         1.400         136.291         0.13           Expedia Group, Inc.         2.966         242.819         0.23           Fair Isaac Corp.         2.966         242.819         0.23           Fair Isaac Stares, Inc. 'A'         3.023         157.810         0.15           First Citzens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortine Inc         7.009         388.466         0.36           Forture Brands Innovations, Inc.         1.777         104.329         0.10           Hom Depot, Inc.         2.61         121.410         0.11           Huana, Inc.         2.61         121.410         0.11           HubSpot, Inc.				
Concast Corp.         11.845         496.064         0.46           Coterra Energy, Inc.         5.323         135.997         0.13           Dropbox, Inc. 'A'         2.930         102.394         0.10           Dropbox, Inc. 'A'         4.840         218.354         0.20           Bay, Inc.         4.840         173.360         0.13           Expeditors International of Washington, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fait Isaac Corp.         2.954         319.827         0.30           Fait Isaac Corp.         2.954         319.827         0.30           Fait Isaac Corp.         2.957         129.381         0.12           Fidelity National Information Services, Inc.         3.023         157.810         0.15           First Otitzens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortinet Inc         7.009         388.466         0.36           Fortune Brands Innovations, Inc.         1.377         104.32         0.10           Hom Depot, Inc.         8.000         194.191         0.18           Hore Depot, Inc.         8.000         194.191         0.18           Lowe Corp.         6.633         361.925         0.34				
Cotera Energy, Inc.         5.223         135.997         0.13           Delta Air Lines, Inc.         2.930         102.394         0.10           Dropbox, Inc. 'A'         8.490         218.384         0.20           eBay, Inc.         4.085         170.113         0.16           Elevance Health, Inc.         3.34         137.360         0.13           Expedia Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Expedia Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fair Isaac Corp.         2.96         242.819         0.23           Fastenal Co.         2.507         129.381         0.15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         3.023         157.810         0.15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortine Brands Innovations, Inc.         1.03         523.126         0.49           HP, Inc.         8.000         194.191         0.18           HubSpot, Inc.         8.00         194.191         0.18           HubSpot, Inc.         8.00         194.191         0.18           Love's Corp.         6.633         361.925         0.30           Kroger Co.				
Dropox, Inc. 'A'         8.490         218.354         0.20           eBay, Inc.         4.085         170.113         0.16           Elevance Health, Inc.         334         137.360         0.13           Expedicis International of Washington, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fair Isaac Corp.         2.96         242.819         0.23           Fair Isaac Corp.         2.96         242.819         0.23           Fair Isaac Corp.         2.96         3.023         157.810         0.15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         6.67         87.336         0.08           Fortine Tands Innovations, Inc.         1.077         104.329         0.10           Hom Depot, Inc.         8.000         194.191         0.18           Hubspot, Inc.         8.000         1.200         235.68 <t< td=""><td></td><td>5.323</td><td></td><td></td></t<>		5.323		
eBay, Inc.         4.085         170.113         0.16           Elevance Health, Inc.         334         137.360         0.13           Expedic Group, Inc.         1.400         136.291         0.13           Expedic Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fair Isaac Corp.         2.967         129.381         0.12           Faitenal Co.         2.507         129.381         0.15           Fidelity National Information Services, Inc.         3.023         157.810         0.15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortime Brands Innovations, Inc.         7.009         388.466         0.036           Home Depot, Inc.         1.877         104.329         0.10           Hum Expedic Group, Inc.         1.873         523.126         0.49           HP, Inc.         8.000         194.191         0.18           HubSpot, Inc.         261         121.410         0.11           Humana, Inc.         812         373.133         0.35           Incyte Corp.         6633         361.925         0.34           KA Corp.         741         321.008         0.30           Lowe's Cos., Inc.				,
Elevance Health, Inc.         334         137.360         0,13           Expeditors International of Washington, Inc.         1.400         136.291         0,13           Expeditors International of Washington, Inc.         2.954         319.827         0,30           Fair Isaac Corp.         296         242.819         0,23           Fastenal Co.         3.023         157.810         0,15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0,08           Fortine Inc         7.009         388.466         0.36           Fortune Brands Innovations, Inc.         1.777         104.329         0,10           Home Depot, Inc.         1.833         523.126         0,49           HP, Inc.         8.000         194.191         0,18           HubSpot, Inc.         261         121.410         0,11           Humana, Inc.         812         373.133         0,35           Incyte Corp.         741         321.008         0,30           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Koger Cos., Inc.         1.500         577.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         1.500         577.133         0,53           Me				,
Expedia Group, Inc.         1.400         136.291         0,13           Expedia Group, Inc.         2.954         319.827         0.30           Fast Isaac Corp.         296         242.819         0,23           Fastenal Co.         2.507         129.381         0,12           Fidelity National Information Services, Inc.         3.023         157.810         0,15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0,08           Fortune Brands Innovations, Inc.         7.009         388.466         0.36           Fortune Brands Innovations, Inc.         1.077         104.329         0,10           Home Depot, Inc.         8.000         194.191         0,18           HubSpot, Inc.         812         373.133         0,35           Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos, Inc.         1.530         572.130         0,53           MetterToledo International, Inc.         557         157.938         0,15				,
Fair Isaac Corp.         296         242.819         0.23           Fastenal Co.         2.507         129.381         0.12           Fidelity National Information Services, Inc.         3.023         157.810         0.15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortune Brands Innovations, Inc.         7.009         388.466         0.36           Fortune Brands Innovations, Inc.         1.777         104.329         0,10           Home Depot, Inc.         1.833         523.126         0.49           Hubspot, Inc.         8.000         194.191         0,18           HubSpot, Inc.         8.000         194.191         0,18           Hubspot, Inc.         8.12         237.313         0,35           Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Low's Cos., Inc.         1.200         235.568         0.22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         577.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15 <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>				
Fastenal Co.         2.507         129.381         0,12           Fidelity National Information Services, Inc.         3.023         157.810         0,15           First Citizens BancShares, Inc. 'A'         67         87.336         0.08           Fortinet Inc         7.009         388.466         0.36           Fortune Brands Innovations, Inc.         1.777         104.329         0,10           Home Depot, Inc.         1.833         523.126         0,49           HP, Inc.         8.000         194.191         0,18           Husspot, Inc.         261         121.410         0,11           Humana, Inc.         812         373.133         0,35           Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Leonar Corp. 'A'         1.530         572.130         0,53           Lowe's Cos., Inc.         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         1.530         577         157.38         0,15           Meta Platforms, Inc. 'A'         1.530         557         157.38         0,15 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>				
Fidelity National Information Services, Inc.       3.023       157.810       0,15         First Citizens BancShares, Inc. 'A'       67       87.336       0,08         Fortine Brands Innovations, Inc.       7.009       388.466       0,36         Fortune Brands Innovations, Inc.       1.777       104.329       0,10         Home Depot, Inc.       1.833       523.126       0,49         HP, Inc.       8.000       194.191       0,11         Humana, Inc.       261       121.410       0,11         Humana, Inc.       812       373.133       0,35         Incyte Corp.       6.633       361.925       0,34         KLA Corp.       741       321.008       0,30         Kroger Co.       9.276       392.067       0,37         Lennar Corp. 'A'       3.495       370.478       0,35         Low's Cos., Inc.       1.200       235.568       0,22         Mastercard, Inc. 'A'       1.530       577.130       0,53         Metta Platforms, Inc. 'A'       557       157.938       0,15         Metta Platforms, Inc. 'A'       315       329.674       0,31         Microsoft Corp.       371       1.107.623       1,03         Monolit	•			
First Citizens BancShares, Inc. 'A'       67       87.336       0,08         Fortinet Inc       7.009       388.466       0,36         Fortune Brands Innovations, Inc.       1.777       104.329       0,10         Home Depot, Inc.       1.833       523.126       0,49         HP, Inc.       8.000       194.191       0,18         HubSpot, Inc.       8.000       194.191       0,18         HubSpot, Inc.       812       373.133       0,35         Incyte Corp.       6633       361.925       0,34         KLA Corp.       741       321.008       0,30         Kroger Co.       9.276       392.067       0,37         Lennar Corp. 'A'       3.495       370.478       0,35         Lowe's Cos., Inc.       1.500       572.130       0,53         Mastercard, Inc. 'A'       1.530       572.130       0,53         MetLife, Inc.       558       322.093       0,31         MetLife, Inc.       5158       322.093       0,31         MetLife, Inc.       3.57       157.938       0,15         MetLife, Inc.       3.58       322.037       0,31         Microsoft Corp.       3.714       1.107.623       1,03			153 010	0.15
Fortune Brands Innovations, Inc.         1.777         104.329         0,10           Home Depot, Inc.         1.833         523.126         0,49           HP, Inc.         8.000         194.191         0,18           HubSpot, Inc.         261         121.410         0,11           Humana, Inc.         812         373.133         0,35           Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         32.08         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Low's Cos., Inc.         1.200         325.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.074         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.5				
Home Depot, Inc.         1.833         523.126         0,49           HP, Inc.         8.000         194.191         0,18           HubSpot, Inc.         261         121.410         0,11           Humana, Inc.         812         373.133         0,35           Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           MetLife, Inc.         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         315         329.074         0,31				
HP, Inc.       8.000       194.191       0,18         HubSpot, Inc.       261       121.410       0,11         Humana, Inc.       812       373.133       0,35         Incyte Corp.       6.633       361.925       0,34         KLA Corp.       741       321.008       0,30         Kroger Co.       9.276       392.067       0,37         Lennar Corp. 'A'       3.495       370.478       0,35         Lowe's Cos., Inc.       1.200       235.568       0.22         Mastercard, Inc. 'A'       1.530       572.130       0,53         Metal Platforms, Inc. 'A'       557       157.938       0,15         Metlife, Inc.       5.589       332.093       0,31         Microsoft Corp.       3.714       1.107.623       1,03         Monolithic Power Systems, Inc.       124       54.109       0,05         Monster Beverage Corp.       7.813       390.742       0,36         Morgan Stanley       4.571       1525.89       0,33         Netflix, Inc.       317       113.057       0,10				
HubSpot, Inc.       261       121.410       0,11         Humana, Inc.       812       373.133       0,35         Incyte Corp.       6.633       361.925       0,34         KLA Corp.       741       321.008       0,30         Kroger Co.       9.276       392.067       0,37         Lennar Corp. 'A'       3.495       370.478       0,35         Lowe's Cos., Inc.       1.200       235.568       0,22         Mastercard, Inc. 'A'       1.530       572.130       0,53         Meta Platforms, Inc. 'A'       557       157.938       0,15         Metler-Toledo International, Inc.       315       329.674       0,31         Microsoft Corp.       3.714       1.107.623       1,03         Monolithic Power Systems, Inc.       124       54.109       0,05         Monster Beverage Corp.       7.813       390.742       0,36         Morgan Stanley       4.571       1352.598       0,33         Netflix, Inc.       317       113.057       0,10				
Incyte Corp.         6.633         361.925         0,34           KLA Corp.         741         321.008         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         515         332.093         0,31           Mettifer-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.588         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
KLÅ Corp.         741         321.008         0,30           Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         5.589         332.093         0,31           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,33           Norgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Kroger Co.         9.276         392.067         0,37           Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           Metal-Platforms, Inc. 'A'         558         332.093         0,31           Metal-Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Lennar Corp. 'A'         3.495         370.478         0,35           Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         5589         332.093         0,31           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Mongan Stanley         4.571         352.588         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Lowe's Cos., Inc.         1.200         235.568         0,22           Mastercard, Inc. 'A'         1.530         572.130         0,53           Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         5.589         332.093         0,31           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Meta Platforms, Inc. 'A'         557         157.938         0,15           MetLife, Inc.         5.589         332.093         0,31           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Morgan Stanley         7.813         390.742         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10		1.200	235.568	0,22
MetLife, Inc.         5.589         332.093         0,31           Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10	•			
Mettler-Toledo International, Inc.         315         329.674         0,31           Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Microsoft Corp.         3.714         1.107.623         1,03           Monolithic Power Systems, Inc.         124         54.109         0,05           Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Monster Beverage Corp.         7.813         390.742         0,36           Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10		3.714		1,03
Morgan Stanley         4.571         352.598         0,33           Netflix, Inc.         317         113.057         0,10				
Netflix, Inc. 317 113.057 0,10	•			
	NVIDIA Corp.	901		0,35

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Owens Corning	2.071	266.829	0,25
PayPal Holdings, Inc.	1.293	71.394	0,07
PepsiCo, Inc.	2.848	455.788	0,43
Pfizer, Inc.	7.268	227.702	0,21
Pinterest, Inc. 'A'	3.949	100.818	0,09
Principal Financial Group, Inc.	1.811	123.276	0,11
Progressive Corp.	400	52.628	0,05
Realty Income Corp.	1.787	84.291	0,08
SEI Investments Co.	726	41.301	0,04
ServiceNow, Inc.	342	180.557	0,17
Sirius XM Holdings, Inc.	90.822	387.736	0,36
Tesla, Inc.	752	177.724	0,17
Tradeweb Markets, Inc. 'A'	1.248	94.536	0,09
Uber Technologies, Inc.	8.229	357.451	0,33
Valero Energy Corp.	1.200	160.616	0,15
Veeva Systems, Inc. 'A'	1.941	372.984	0,35
Ventas, Inc.	9.693	385.706	0,36
VeriSign Inc	2.011	384.687	0,36
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	934	306.767	0,29
Visa, Inc. 'A'	910	197.695	0,18
Westlake Corp.	1.408	165.795	0,15
		23.800.063	22,23
Uruguay MercadoLibre, Inc.	312	373.628	0,35
	512	373.020	0,33
ANTEILE GESAMT		38.141.114	35,62
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT		102.495.139	95,71
ANLAGEN INSGESAMT		102.495.139	95,71
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		4.594.945	4,29
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	-	107.090.084	100,00
	-		

#### DERIVATE

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn a	aus Devisenterminkontrakten				
AUD	216.057	EUR	(128.647)	24.10.2023	3.048
AUD	15.918	EUR	(9.508)	24.10.2023	194
AUD	19.213	EUR	(11.632)	24.10.2023	79
CAD	293.713	EUR	(200.132)	24.10.2023	4.951
EUR	17.863	CAD	(25.416)	24.10.2023	116
EUR	415.243	CHF	(395.955)	24.10.2023	5.874
EUR	13.929	CHF	(13.299)	24.10.2023	179
EUR	514.940	DKK	(3.835.727)	24.10.2023	445
EUR	10.043.682	GBP	(8.636.683)	19.10.2023	92.681
EUR	56.202	GBP	(48.429)	19.10.2023	403
EUR	6.255	GBP	(5.375)	19.10.2023	62
EUR	237.859	GBP	(203.885)	19.10.2023	2.948
EUR	7.765	GBP	(6.656)	19.10.2023	96
EUR	20.393	GBP	(17.516)	19.10.2023	212
EUR	30.738	GBP	(26.363)	19.10.2023	363
EUR	26.708	GBP	(23.014)	19.10.2023	191
EUR	18.651	GBP	(16.067)	19.10.2023	139
EUR	83.106	GBP	(71.411)	19.10.2023	828
EUR	308.206	GBP	(264.834)	19.10.2023	3.070
EUR	16.389	GBP	(14.189)	20.10.2023	41
EUR	647.872	GBP	(558.066)	24.10.2023	4.993
EUR	18.313	GBP	(15.791)	24.10.2023	123
EUR	22.744	GBP	(19.551)	24.10.2023	221
EUR	138.086	GBP	(119.752)	31.10.2023	169
EUR	1.326	GBP	(1.150)	31.10.2023	2
EUR	40.652	GBP	(35.240)	31.10.2023	66
EUR	23.723	GBP	(20.573)	31.10.2023	29
EUR EUR	28.315	JPY JPY	(4.452.120)	18.10.2023	84
EUR	33.422 9.156	JPY	(5.246.318)	19.10.2023 19.10.2023	151 20
EUR	32.808	JPY	(1.440.583) (5.166.261)	19.10.2023	45
EUR	34.256	JPY	(5.397.015)	19.10.2023	45 30
EUR	53.698	JPY	(8.436.124)	19.10.2023	199
EUR	30.563	JPY	(4.795.591)	19.10.2023	151
EUR	106.340	JPY	(16.732.718)	19.10.2023	226
EUR	24.383	JPY	(3.836.301)	20.10.2023	52
EUR	74.068	JPY	(11.659.245)	24.10.2023	83
EUR	176.317	JPY	(27.756.728)	24.10.2023	183
EUR	70.205	JPY	(11.063.110)	24.10.2023	3
EUR	21.288	JPY	(3.347.746)	24.10.2023	45
EUR	7.071	JPY	(1.109.212)	24.10.2023	32
EUR	110.342	USD	(116.452)	24.10.2023	447
EUR	29.532	USD	(31.167)	24.10.2023	120
GBP	35.466	EUR	(40.822)	19.10.2023	41
GBP	8.918.602	EUR	(10.244.096)	19.10.2023	31.726
GBP	14.189	EUR	(16.297)	20.10.2023	50
GBP	44.535	EUR	(51.145)	24.10.2023	158
JPY	793.946	EUR	(5.021)	19.10.2023	13
JPY	3.836.301	EUR	(24.314)	20.10.2023	17
JPY	4.786.238	EUR	(30.349)	24.10.2023	22
SEK	6.078	EUR	(523)	31.10.2023	5
SEK	117	EUR	(10)	31.10.2023	0
SGD	1.656	EUR	(1.130)	19.10.2023	16
SGD	1.658	EUR	(1.144)	24.10.2023	3
USD	190.212	EUR	(179.438)	18.10.2023	109
USD	22.700	EUR	(21.414)	18.10.2023	13
USD	12.172	EUR	(11.249)	19.10.2023	240
USD	18.588	EUR	(17.036)	19.10.2023	509
USD USD	26.727	EUR	(24.546)	19.10.2023	682
USD	5.533	EUR	(5.111)	19.10.2023	112
USD	94.775 104	EUR	(87.545)	19.10.2023 19.10.2023	1.913 2
USD	8.694	EUR EUR	(97) (8.081)	19.10.2023	2 125
USD	16.701	EUR	(15.534)	19.10.2023	229
USD	152.353	EUR	(15.534) (141.753)	19.10.2023	229 2.052
USD	29.311	EUR	(141.753) (27.456)	19.10.2023	2.052
USD	130.463	EUR	(122.498)	19.10.2023	645
USD	20.396	EUR	(122.498) (19.151)	19.10.2023	645 101
USD	151.420	EUR	(19.151) (142.218)	19.10.2023	706
USD	35.195	EUR	(33.200)	19.10.2023	20
USD	5.506.350	EUR	(5.194.239)	19.10.2023	3.161
USD	3.133.242	EUR	(2.955.644)	19.10.2023	1.799
USD	10.589.410	EUR	(9.989.181)	19.10.2023	6.079
USD	5.877	EUR	(5.544)	20.10.2023	3
		-	( ·)		-

Nicht realisierte Gewinn/(Verlus in EU	Fälligkeitsdatum	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Kauf
6	20.10.2023	(109.951)	EUR	116.563	USD
	24.10.2023	(8.806)	EUR	9.340	USD
174.23			inkontrakten	ten Gewinns aus Devisenterm	Summe des nicht realisier
		()		us Devisenterminkontrakten	
((	24.10.2023	(22.676)	EUR EUR	32.475 12.122	CAD CHF
(184 (13	24.10.2023 24.10.2023	(12.716) (44.352)	EUR	330.566	DKK
(10)	24.10.2023	(21.906)	EUR	163.248	DKK
(11.436	24.10.2023	(751.736)	AUD	446.777	EUR
(370	24.10.2023	(22.110)	AUD	13.107	EUR
(124	24.10.2023	(19.899)	AUD	12.005	EUR
(25.533	24.10.2023 24.10.2023	(1.170.472) (106.814)	CAD DKK	791.740 14.324	EUR EUR
(39	18.10.2023	(100.014)	GBP	12.667	EUR
(73	19.10.2023	(48.742)	GBP	56.087	EUR
(19	19.10.2023	(7.486)	GBP	8.606	EUR
(29	19.10.2023	(8.225)	GBP	9.447	EUR
(31.667	24.10.2023	(8.898.726)	GBP	10.219.458	EUR
(2 (20	24.10.2023 19.10.2023	(1.842) (633.557)	GBP JPY	2.120 3.998	EUR EUR
(20	19.10.2023	(1.113.465)	JPY	7.057	EUR
(10.540	24.10.2023	(347.460.017)	JPY	2.194.313	EUR
(7.849	24.10.2023	(3.660.921)	NOK	317.013	EUR
(188	24.10.2023	(102.313)	NOK	8.891	EUR
(146	24.10.2023	(108.440)	NOK	9.477	EUR
(140 (4.21)	24.10.2023 24.10.2023	(110.111) (1.692.962)	NOK SEK	9.631 142.969	EUR EUR
(4.21	19.10.2023	(1.656)	SGD	1.143	EUR
(2.610	24.10.2023	(200.418)	SGD	136.088	EUR
(2.279	18.10.2023	(190.212)	USD	177.268	EUR
(272	18.10.2023	(22.700)	USD	21.155	EUR
(57.733	19.10.2023	(2.926.703)	USD	2.704.759	EUR
(208.888 (96.849	19.10.2023 19.10.2023	(10.589.410) (4.909.656)	USD USD	9.786.372 4.537.337	EUR EUR
(30.043	19.10.2023	(4.303.030)	USD	449	EUR
(3.28	19.10.2023	(215.675)	USD	200.293	EUR
(2.284	19.10.2023	(158.918)	USD	147.717	EUR
(260	19.10.2023	(23.586)	USD	22.003	EUR
(2.934	19.10.2023	(213.557)	USD	198.641	EUR
(317 (1.81)	19.10.2023 19.10.2023	(25.223) (144.000)	USD USD	23.491 134.109	EUR EUR
(130	19.10.2023	(9.665)	USD	8.993	EUR
(25	19.10.2023	(1.785)	USD	1.660	EUR
(868)	19.10.2023	(120.754)	USD	113.111	EUR
(56	19.10.2023	(7.674)	USD	7.187	EUR
(438 (415	19.10.2023 19.10.2023	(41.628) (83.978)	USD USD	38.854 78.851	EUR EUR
(366	19.10.2023	(73.336)	USD	68.855	EUR
(281	19.10.2023	(56.385)	USD	52.940	EUR
(1.607	19.10.2023	(322.026)	USD	302.351	EUR
(33	19.10.2023	(6.987)	USD	6.562	EUR
(62	20.10.2023	(5.877)	USD	5.485	EUR
(1.226 (211.870	20.10.2023 24.10.2023	(116.563) (7.590.942)	USD USD	108.792 6.951.680	EUR EUR
(10.042	24.10.2023	(356.914)	USD	326.776	EUR
(185.039	24.10.2023	(6.325.785)	USD	5.784.585	EUR
(181.285	24.10.2023	(6.062.680)	USD	5.540.048	EUR
(7	24.10.2023	(12.491)	USD	11.781	EUR
(1.660	24.10.2023	(2.900.182)	USD USD	2.735.233	EUR
(6.052 (3.38	24.10.2023 24.10.2023	(10.570.602) (5.906.127)	USD	9.969.394 5.570.213	EUR EUR
(0.00	03.10.2023	(40.693)	EUR	35.240	GBP
(104	18.10.2023	(12.811)	EUR	11.028	GBP
(30	19.10.2023	(3.233)	EUR	2.780	GBP
(68	19.10.2023	(5.087)	EUR	4.356	GBP
(276	19.10.2023	(21.794)	EUR	18.676	GBP
(232 (568	19.10.2023 19.10.2023	(17.921) (67.953)	EUR EUR	15.352 58.485	GBP GBP
(300	19.10.2023	(3.184)	EUR	2.744	GBP
(1.507	19.10.2023	(216.734)	EUR	186.800	GBP
(663	19.10.2023	(163.609)	EUR	141.425	GBP
(367	24.10.2023	(29.238)	EUR	25.062	GBP
(90	24.10.2023	(23.512)	EUR	20.332	GBP
	24.10.2023	(38.785)	EUR	33.567	GBP
(117			FUD	/51 700	GBP
	24.10.2023 31.10.2023	(521.943) (23.084.103)	EUR EUR	451.722 20.010.224	GBP GBP

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
JPY	4.452.120	EUR	(28.291)	18.10.2023	(60)
JPY	903.743	EUR	(5.737)	19.10.2023	(6)
JPY	3.983.937	EUR	(25.374)	19.10.2023	(109)
JPY	5.573.008	EUR	(35.555)	19.10.2023	(213)
JPY	9.015.367	EUR	(57.496)	19.10.2023	(323)
JPY	2.696.800	EUR	(17.109)	19.10.2023	(6)
JPY	13.698.956	EUR	(86.988)	19.10.2023	(113)
JPY	2.397.046	EUR	(15.272)	19.10.2023	(70)
JPY	7.656.041	EUR	(48.679)	19.10.2023	(127)
JPY	2.242.788	EUR	(14.223)	19.10.2023	(0)
JPY	6.372.521	EUR	(40.644)	24.10.2023	(206)
SGD	5.795	EUR	(4.014)	24.10.2023	(4)
USD	714.715	EUR	(677.227)	24.10.2023	(2.753)
USD	8.399	EUR	(7.967)	24.10.2023	(41)
ne des nicht realisie	erten Verlusts aus Devisentern	inkontrakten			(1.131.669)

#### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
EURO STOXX 50	EUR	(75)	15.12.2023	(3.153.000)	56.625
FTSE 100 Index	GBP	37	15.12.2023	3.272.018	27.725
MSCI World Index	USD	(71)	15.12.2023	(6.048.160)	220.935
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten insgesamt				(5.929.142)	305.285
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	20	07.12.2023	2.572.800	(55.400)
Nikkei 225 Index	JPY	16	07.12.2023	3.226.493	(95.196)
UK Long Gilt Future	GBP	20	27.12.2023	2.170.993	(15.909)
US Treasury Note 10YR	USD	32	19.12.2023	3.266.116	(69.657)
US Treasury Ultra 10YR	USD	26	19.12.2023	2.739.669	(87.101)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten				13.976.071	(323.263)

insgesamt

#### OPTIONEN

Währung	Menge Bezeichnung	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Gekaufte Optionen				
USD	1.550 Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 4150	15.12.2023	97.721	26.008
USD	3.100 Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 4300	15.12.2023	323.542	(27.164)
Gekaufte Optionen ges	samt		421.263	(1.156)
Verkaufte Optionen				
USD	(3.100) Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 3950	15.12.2023	(101.015)	(12.428)
Veräußerte Optionen g	esamt		(101.015)	(12.428)

#### SWAPKONTRAKTE

Währung	Nennbetrag	Zahlung/Einnahme	Fälligkeits datum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Total Return Sv	waps				
USD	29.186.143	BMO Gear Strategy Index	06.10.2023	29.625.200	0
USD	25.388.055	BMO Global Asset Management FX Index	04.04.2024	25.388.055	0
USD	28.069.641	BMO Global Asset Management IR Index	23.04.2024	28.069.642	911.410
USD	23.360.472	BMO Merger Arbitrage Strategy Index	15.05.2024	23.359.663	(50.038)
USD	28.126.218	JP Morgan JMABRP10 Index	01.04.2024	28.621.169	262.599
Total Return Sv	waps			135.063.729	1.123.971
	er Gewinn aus Swap er Verlust aus Swap				1.174.009 (50.038)

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, BNP Paribas S.A., Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Ltd., HSBC Bank Plc., JP Morgan Securities Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Gegenpartei für Optionskontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Kontrahenten bei Swaps waren Citigroup Global Markets Ltd. und JP Morgan Securities Plc.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Diversified Growth Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Bau- und Ingenieurswesen	0,09
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	0,12
Freizeit und Tourismus	0,17
Wohnungsbauunternehmen	0,35
Landwirtschaft	0,46
Transport und Verkehr	0,47
Metalle und Bergbau	0,50
Chemikalien	0,53
Elektrische Geräte	0,57
Vertrieb und Großhandel	0,58
Gesundheitswesen	0,64
Baustoffe	0,69
Fluggesellschaften	0,69
Medien	0,82
Einzelhandel	0,92
Biotechnologie	1,01
Automobilzulieferer	1,11
Telekommunikation	1,25
Versicherungen	1,32
Nahrungsmittel und Getränke	1,50
Öl und Gas	1,66
Halbleiter	2,25
Computer	2,30
Immobilien	2,42
Arzneimittel	2,61
Software	2,84
Finanzdienstleistungen	4,07
Internet	4,13
Staatliche Emittenten	7,51
Gewerbliche Dienstleistungen	52,13
Anlagen insgesamt	95,71
Sonstige Aktiva / (Passiva)	4,29
Gesamtes Nettovermögen	100,00

## Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Euro Bond

#### Performance

In den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 erzielte die Anteilsklasse I Acc EUR eine Rendite von -2,5 %. Im Vergleich dazu erzielte der BBI Euro Aggregate Treasury TR Index eine Rendite von -2,2 %. Die Performance ist die Gesamtrendite, in Euro ausgedrückt.

Über den Zwölfmonatszeitraum entwickelte sich der CT (Lux) Euro Bond im Einklang mit seiner Benchmark. Die Untergewichtung der Duration war hilfreich, da die Renditen sprunghaft anstiegen, wobei unsere Umstellung auf eine Long-Duration-Ausrichtung zu früh erfolgte, was die Renditen in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums beeinträchtigte. Die Untergewichtung in italienischen Staatsanleihen wirkte sich vor dem Hintergrund restriktiveren Drucks vonseiten der Europäischen Zentralbank (EZB) positiv aus. Dies wurde ausgeglichen durch Verluste aus Übergewichtungen von regierungsnahen Anleihen und Kurven-Steepenern in Europa, die der Fonds im früheren Verlauf des Berichtszeitraums hielt.

#### Marktrückblick

Die Renditen der europäischen Staatsanleihen stiegen im Berichtszeitraum, als Reaktion auf die steigenden Zinssätze. Im letzten Quartal 2022 kam es zu einem sprunghaften Anstieg, da Inflationsängste und das Tempo der Zinsanhebungen im Vordergrund standen. Die Renditen gingen jedoch wieder zurück, als das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 nachließ und die Anleger mit einem Höchststand der Zinssätze und sogar mit Zinssenkungen rechneten, falls sich das Wirtschaftswachstum abschwächen sollte. Die EZB erhöhte den Einlagensatz im September zum zehnten Mal in Folge auf ein 22-Jahres-Hoch von 4.0 %. Dadurch wurden die Zinssätze annähernd auf das Niveau der immer noch sinkenden Inflationsraten angehoben, und die EZB gab an, dass der Höchststand der Zinssätze fast erreicht wäre, so dass eine weitere Anhebung unwahrscheinlich ist. Da sich die Deflation im Energiesektor verstärkte, sank die Inflation nach vorläufigen Schätzungen im September 2023 auf 4,3 % und damit auf den niedrigsten Stand seit Oktober 2021. Die EZB dämpfte jedoch die Erwartungen der Anleger auf eine schnelle Zinswende bei einem weiteren Rückgang der Inflation und wies darauf hin, dass die Zinssätze möglicherweise "länger höher" bleiben müssen, bis der Lohndruck nachlässt. Diese Verschiebung führte zu einer steileren Renditekurve, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit nahe des Leitzinses verharrten, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Der Beginn der quantitativen Straffung, da die Reinvestitionen im Rahmen des Programms zum Ankauf von Vermögenswerten (Asset Purchase Programme, APP) im Juli 2023 endeten, erhöhte den Druck auf den Markt, das Angebot an Schuldtiteln aufzunehmen, weiter und führte zu einer Verlagerung zu höheren Renditen für Anleihen mit längerer Laufzeit.

#### Ausblick

Unsere Haltung in Bezug auf die Renditen der Staatsanleihen der Eurozone ist nach wie vor bullisch, wenn auch mit einer Tendenz zur Versteilerung, da wir Long-Positionen am vorderen Ende der Kurven bevorzugen. Während es Quartals sind die Renditen sprunghaft angestiegen, mit einer starken Versteilerung, die vor allem durch das hintere Ende der Kurve verursacht wurde. Dies lässt sich durch eine Kombination von Themen erklären: eine Herabstufung des Kreditratings der US-Bundesbehörden, ein längerfristig höheres Zinsniveau, ein nach wie vor robustes Wachstum und eine zunehmende Emission von Schuldtiteln ohne Ankäufe durch die Zentralbank. Obwohl die Bewertungen attraktiver geworden sind, warten wir weiterhin auf weitere Anzeichen einer Schwäche des Arbeitsmarktes, bevor wir unsere Positionen aufstocken. Wir gehen davon aus, dass sich die Renditespreads für Staatsanleihen mit niedrigerem Rating im Vergleich zu Deutschland im Jahr 2023 weiter weiten werden, da sich das Wachstum abschwächt und die Angebotsdynamik nachlässt, wenn die EZB ihre Ankäufe italienischer und anderer Schuldtitel reduziert.

#### **Global Rates Team**

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Euro Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE	ODER AN EINEM AND	EREN GEREGELTEN	MARKT NOTIERT	E ÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIERI	=
ANLEIHEN						
Österreich						
Staatsanleihe der Republik Österreich	0,00 %	20.10.2028	EUR	877.000	747.450	0,87
Staatsanleihe der Republik Österreich	0,00 %	20.02.2031	EUR	1.492.000	1.172.712	1,36
Staatsanleihe der Republik Österreich	0,90 %	20.02.2032	EUR	2.362.000	1.942.622	2,26
Staatsanleihe der Republik Österreich	2,90 %	20.02.2033	EUR	1.727.000	1.655.069	1,92
Staatsanleihe der Republik Österreich Staatsanleihe der Republik Österreich	2,10 % 0,85 %	20.09.2117	EUR EUR	107.000 95.000	67.703 33.658	0,08
	0,85 %	30.06.2120	EUR	95.000	5.619.214	0,04 6,53
Belgien						
Kingdom of Belgium Government Bond	0,80 %	22.06.2027	EUR	2.063.000	1.896.184	2,20
Kingdom of Belgium Government Bond	0,35 %	22.06.2032	EUR	84.000	64.961	0,08
Kingdom of Belgium Government Bond	1,25 %	22.04.2033	EUR	162	134	0,00
Kingdom of Belgium Government Bond	3,00 %	22.06.2033	EUR	207.000	199.000	0,23
Kingdom of Belgium Government Bond	3,45 %	22.06.2043	EUR	1.738.000	1.632.965	1,90
Kingdom of Belgium Government Bond Kingdom of Belgium Government Bond	1,60 %	22.06.2047 22.06.2071	EUR EUR	633.000 738.000	411.259 254.082	0,48
Kingdom of Beigium Government Bond	0,65 %	22.00.2071	EUK	738.000	4.458.585	0,29 <b>5,18</b>
Kanada						
CPPIB Capital, Inc.	0,75 %	02.02.2037	EUR	1.319.000	892.156	1,04
Export Development Canada	0,50 %	25.02.2027	EUR	1.531.000	1.389.780	1,61
Ontario Teachers' Finance Trust	1,85 %	03.05.2032	EUR	1.280.000	1.092.854	1,27
Finnland					3.374.790	3,92
Finnische Staatsanleihe	1,38 %	15.04.2027	EUR	2.678.000	2.517.566	2,93
Finnische Staatsanleihe	2,88 %	15.04.2029	EUR	3.157.000	3.102.160	3,60
Finnische Staatsanleihe	2,75 %	15.04.2038	EUR	710.000	640.347	0,74
Frankreich					6.260.073	7,27
French Republic Government Bond OAT	0,00 %	25.02.2026	EUR	513.000	475.230	0,55
French Republic Government Bond OAT	0,00 %	25.11.2030	EUR	750.000	598.889	0,70
French Republic Government Bond OAT	1,00 %	25.11.2025	EUR	3.876.000	3.696.006	4,30
French Republic Government Bond OAT	1,00 %	25.05.2027	EUR	2.956.000	2.739.669	3,18
French Republic Government Bond OAT	0,75 %	25.05.2028	EUR	2.329.000	2.091.919	2,43
French Republic Government Bond OAT	3,00 %	25.05.2033	EUR	726.000	703.695	0,82
French Republic Government Bond OAT	1,75 %	25.06.2039	EUR	468.000	363.603	0,42
French Republic Government Bond OAT	4,50 %	25.04.2041	EUR	125.000	137.310	0,16
French Republic Government Bond OAT	3,25 %	25.05.2045	EUR	216.000	199.030	0,23
French Republic Government Bond OAT	2,00 %	25.05.2048	EUR	1.117.000	798.035	0,93
French Republic Government Bond OAT	1,50 %	25.05.2050	EUR	1.158.000	714.926	0,83
French Republic Government Bond OAT	0,75 %	25.05.2053	EUR	137.800	63.467	0,07
French Republic Government Bond OAT	3,00 %	25.05.2054	EUR	120.080	101.081	0,12
French Republic Government Bond OAT	4,00 %	25.04.2055	EUR	304.600	311.465	0,36
Societe Generale SFH SA	0,01 %	02.12.2026	EUR	500.000	446.800	0,52
Deutschland					13.441.125	15,62
Bundesobligation	0,00 %	13.10.2023	EUR	700	699	0,00
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2026	EUR	1.051.000	967.776	1,12
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,50 %	15.08.2027	EUR	431.000	395.383	0,46
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,50 %	15.02.2028	EUR	48	44	0,00
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,25 %	15.02.2029	EUR	2.644.000	2.322.622	2,70
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2,30 %	15.02.2033	EUR	474.000	454.992	0,53
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1,00 %	15.05.2038	EUR	1.524.000	1.168.888	1,36
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4,25 %	04.07.2039	EUR	511.000	589.896	0,69
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1,25 %	15.08.2048	EUR	671.000	470.387	0,55
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe Kreditapstalt für Wiederaufbau	1,80 %	15.08.2053	EUR	464.000	353.980	0,41
Kreditanstalt für Wiederaufbau Kreditanstalt für Wiederaufbau	3,13 % 3,25 %	10.10.2028 24.03.2031	EUR EUR	1.000 6.600.000	991 6.561.515	0,00 7,62
					13.287.173	15,44
Irland Irische Staatsanleihe	0,35 %	18.10.2032	EUR	421.000	327.273	0,38
Irische Staatsanleihe	3,00 %	18.10.2043	EUR	728.000	668.865	0,78
					996.138	1,16
Italien Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0,35 %	01.02.2025	EUR	637.000	607.800	0,70
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1,85 %	01.07.2025	EUR	3.894.000	3.759.462	4,37
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2,10 %	15.07.2026	EUR	2.503.000	2.383.542	2,77

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0,25 %	15.03.2028	EUR	3.783.000	3.199.616	3,72
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1,65 %	01.12.2030	EUR	496.000	412.543	0,48
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2,50 %	01.12.2032	EUR	621.000	525.539	0,61
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,40 %	01.05.2033	EUR	2.144.000	2.104.505	2,44
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,00 %	30.04.2035	EUR	2.132.000	1.984.874	2,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3,25 %	01.03.2038	EUR	596.000	492.438	0,57
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,45 %	01.09.2043	EUR	867.000	798.111	0,93
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4,50 %	01.10.2053	EUR	1.127.000	1.015.258	1,18
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2,15 %	01.03.2072	EUR	172.000	87.881	0,10
Lettland					17.371.569	20,18
Internationale Staatsanleihe von Lettland	0,38 %	07.10.2026	EUR	447.000	403.748	0,47
Litauen Lithuania Government International Bond	0,25 %	06.05.2025	EUR	406.000	380.578	0,44
	0,20 %	00.00.2020	LOIX	400.000	300.370	0,44
Niederlande Niederländische Staatsanleihe	0,00 %	15.07.2031	EUR	56.000	44.314	0,05
Niederländische Staatsanleihe	0,00 %	15.01.2038	EUR	236.000	148.580	0,03
Niederländische Staatsanleihe	0,25 %	15.07.2025	EUR	1.405.000	1.333.112	1,55
Niederländische Staatsanleihe	0,75 %	15.07.2027	EUR	2.185.000	2.012.263	2,34
Niederländische Staatsanleihe	0,25 %	15.07.2029	EUR	701.000	599.891	0,70
Niederländische Staatsanleihe	3,75 %	15.01.2042	EUR	512.000	543.690	0,63
					4.681.850	5,44
Portugal Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	3,50 %	18.06.2038	EUR	116.000	110.184	0,13
Slowakei						
Slovakia Government Bond	0,25 %	14.05.2025	EUR	1.475.000	1.395.999	1,62
Slovakia Government Bond	3,75 %	23.02.2035	EUR	1.335.000	1.272.005	1,48
					2.668.004	3,10
Slowenische Staatsanleihe	0,49 %	20.10.2050	EUR	306.000	128.233	0,15
Spanien	0,40 /0	20.10.2000	LOIK	000.000	120.200	0,10
Spanische Staatsanleihe	0,25 %	30.07.2024	EUR	1.853.000	1.799.704	2,09
Spanische Staatsanleihe	2,75 %	31.10.2024	EUR	728.000	720.196	0,84
Spanische Staatsanleihe	1,95 %	30.04.2026	EUR	1.128.000	1.086.528	1,26
Spanische Staatsanleihe	3,55 %	31.10.2033	EUR	5.125.000	4.972.654	5,78
Spanische Staatsanleihe	0,85 %	30.07.2037	EUR	511.000	335.457	0,39
Spanische Staatsanleihe	1,20 %	31.10.2040	EUR	146.000	91.905	0,39
Spanische Staatsanleihe	3,45 %	30.07.2043	EUR	1.362.000	1.194.558	1,39
Spanische Staatsanleihe	1,90 %	31.10.2052	EUR	1.791.000	1.046.779	1,39
Spanische Staatsanleihe	1,90 %	31.10.2052	EUR	359.000	148.127	0,17
					11.395.908	13,24
Supranational						
European Union	3,38 %	04.11.2042	EUR	893.000	830.969	0,97
European Union	2,63 %	04.02.2048	EUR	236.000	193.580	0,22
European Union	2,50 %	04.10.2052	EUR	325.000	248.270	0,29
					1.272.819	1,48
ANLEIHEN GESAMT					85.849.991	99,75
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE OI ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	DER AN EINEM AND	EREN GEREGELTEN N	ARKT NOTIERTE	1	85.849.991	99,75
ANLAGEN INSGESAMT					85.849.991	99,75
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)					213.413	0,25

## Columbia Threadneedle (Lux) III - CT (Lux) Euro Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

#### DERIVATE

#### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
EURO-BTP Future	EUR	7	07.12.2023	768.110	6.627
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	(17)	07.12.2023	(2.186.880)	15.568
German Federal Republic Bond 2YR	EUR	23	07.12.2023	2.414.770	3.824
German Federal Republic Bond 30YR	EUR	(4)	07.12.2023	(489.440)	33.520
Japan Government Bond 10YR	JPY	(2)	13.12.2023	(1.835.030)	15.064
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten ins	sgesamt			(1.328.470)	74.603
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	33	07.12.2023	3.819.750	(28.330)
UK Long Gilt Future	GBP	10	27.12.2023	1.085.497	(557)
US Treasury Ultra 10YR	USD	9	19.12.2023	948.347	(28.822)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten ins	gesamt			5.853.594	(57.709)

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Euro Bond **Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen** zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Finanzdienstleistungen	10,45
Staatliche Emittenten	89,30
Anlagen insgesamt	99,75
Sonstige Aktiva / (Passiva)	0,25
Gesamtes Nettovermögen	100,00

## Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) European Growth & Income

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A EUR eine Rendite von 21,9 %. Im Vergleich dazu erzielte der FTSE All-World Developed Europe NR Index eine Rendite von 19,5 %. Alle Angaben nach Gebühren und in Euro.

Das Portfolio erzielte über den Zwölfmonatszeitraum eine Outperformance. Die Titelauswahl war der Hauptbeitragsleister zur Outperformance. Zu den größten Beitragsleistern gehörte Burford Capital, nachdem die Anleger das Ausmaß der positiven Auswirkungen der Richterspruchs zu Gunsten von Burford im Fall Petersen Anfang 2023 zu erkennen begannen. Das Luft- und Raumfahrtunternehmen Melrose zeigte sich nach der Ausgliederung des Automobilgeschäfts stark und kündigte anschließend eine Anhebung der Prognosen an. UBS entwickelte sich sehr gut, da sich die Anleger auf die Vorteile der Übernahme von Credit Suisse konzentrierten. Zu den Verlierern gehörte die Kerry Group, deren Aktien wie jene vieler anderer Lebensmittelunternehmen aufgrund der Schwäche der Verbraucher und der Besorgnis über die Auswirkungen der neuen Generation von Medikamenten gegen Fettleibigkeit eine Underperformance aufwiesen. Die Deutsche Börse war schwach, da sich die geringere Volatilität auf das Börsenvolumen auswirkte.

#### Marktrückblick

Die europäischen Aktienmärkte legten im Berichtszeitraum kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die europäischen Aktien wiesen über den Winter eine Outperformance auf, da die Wirtschaft eine Rezession weitgehend vermieden hat. Anfang 2023 wurde der Markt jedoch von fallenden Bankaktien getroffen, die aus dem Zusammenbruch zweier US-Regionalbanken und der Rettung der Credit Suisse resultierten und zur Unsicherheit bezüglich der Ausrichtung der Geldpolitik beitrugen. Obwohl das Ausbleiben einer Ansteckung durch die Finanzkrise begrüßt wurde, erhöhte die Europäische Zentralbank (EZB) die Zinsen weiter, sogar als die Wirtschaft mit einer schwachen chinesischen Importnachfrage und einer gedämpften inländischen Verbraucherbasis zu kämpfen hatte. Gegen Ende des Berichtszeitraums wurde den risikoscheuen Anlegern klar, dass die weltweiten Zinssätze wahrscheinlich noch länger höher bleiben würden, was zu dem wirtschaftlichen Pessimismus einer breiteren regionalen Konjunkturabschwächung hinzukam und die Aktien belastete. Da die Energiepreise in Europa nachgaben, sank die Inflation in der Eurozone nach vorläufigen Schätzungen im September 2023 auf 4,3 % und damit auf den niedrigsten Stand seit Oktober 2021. Unterdessen kühlte sich die Kerninflation von 5,5 % im Juli auf 5,3 % ab. Innerhalb von zwölf Monaten hob die EZB die Zinssätze acht Mal an, mit einer großen Anhebungen im Dezember, Februar, März, Mai, Juni, Juli und September 2023, wodurch der Einlagensatz auf 4,00 % stieg. Darüber hinaus begann im März die quantitative Straffung.

#### Ausblick

Zu Beginn des letzten Quartals des Jahres wird die Richtung der europäischen Aktienmärkte weiterhin von der Inflation und den Aussichten auf einen möglichen Höchststand der Zinssätze und die damit verbundenen Auswirkungen auf die Wirtschaft bestimmt. Zwar gibt es Anzeichen für eine Verlangsamung der Konjunktur, da die Einkaufsmanagerindizes deutlich schwächer ausfielen, insbesondere im Vereinigten Königreich und in Europa, doch bleibt die Inflation hartnäckig hoch, auch wenn sie einige Anzeichen einer Abschwächung aufweist. Die Kommentare der Zentralbanken deuten darauf hin, dass wir den Höhepunkt der Zinssätze erreicht haben, dass diese aber noch einige Zeit hoch bleiben werden. Wir sind der Ansicht, dass das Portfolio weiterhin gut positioniert ist, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige Unternehmen zu attraktiven Bewertungen konzentrieren, die trotz des wirtschaftlichen Umfelds eine gute Performance erzielen können.

#### **David Moss**

Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Growth & Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM AND ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	EREN GEREGELTEN MARKT NOTIERTE		
ANTEILE			
Dänemark Novo Nordisk AS 'B'	20.034	1.729.907	4,68
Frankreich			
Air Liquide SA	6.872	1.098.420	2,97
Cie de Saint-Gobain	13.581	772.487	2,09
Publicis Groupe SA	11.605	832.775	2,25
Schneider Electric SE	6.812	1.069.348	2,90
Deutschland		3.773.030	10,21
Brenntag SE	8.218	603.859	1,64
Deutsche Boerse AG	6.154	1.007.410	2,73
Deutsche Telekom AG	39.433	783.455	2,12
Infineon Technologies AG	23.427	734.553	1,99
SAP SE	12.646	1.553.182	4,20
		4.682.459	12,68
Irland	110.10	4 004 070	0.07
Bank of Ireland Group PLC Cairn Homes PLC	116.434 776.754	1.081.672	2,93
CRH PLC	5.842	854.267 305.894	2,31 0,83
CRH PLC	9.601	496.305	1,34
Kerry Group PLC	11.376	900.752	2,44
Smurfit Kappa Group PLC	25.056	790.767	2,14
		4.429.657	11,99
Italien			
Ferrari NV	1.975	552.407	1,50
Intesa Sanpaolo SpA	421.479	1.028.409	2,78
Niederlande		1.580.816	4,28
ASML Holding NV	2.620	1.464.842	3,97
Heineken NV	7.486	624.781	1,69
Just Eat Takeaway.com NV	15.686	186.076	0,50
Wolters Kluwer NV	6.208	711.747	1,93
Newsee		2.987.446	8,09
Norwegen DNB Bank ASA	48.028	919.123	2,49
Storebrand ASA	100.452	777.152	2,10
TGS ASA	76.611	996.908	2,70
		2.693.183	7,29
Spanien Neinor Homes SA	46.405	427 500	1.40
Schweden	40.400	437.599	1,19
Atlas Copco AB 'A'	46.749	598.462	1,62
Schweiz			
Cie Financiere Richemont SA	8.068	932.963	2,52
Lonza Group AG	1.301	571.688	1,55
Partners Group Holding AG	681	727.375	1,97
Roche Holding AG	4.927	1.274.043	3,45
SGS SA UBS Group AG	8.025 47.824	638.159 1.120.368	1,73 3,03
	47.024		
Vereinigtes Königreich		5.264.596	14,25
AstraZeneca PLC	11.820	1.512.797	4,10
Compass Group PLC	39.293	905.956	2,45
Diageo PLC	22.989	804.077	2,18
M&G PLC	526.033	1.196.471	3,24
Pearson PLC	62.812	628.817	1,70
Phoenix Group Holdings PLC	188.347	1.047.003	2,83
RELX PLC SSE PLC	24.415 52.990	782.501 983.517	2,12 2,66
	52.550		
		7.861.139	21,28

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Growth & Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettovermögens
USA	00.070	170.440	4.00
Burford Capital Ltd.	36.670	478.119	1,30
ANTEILE GESAMT		36.516.413	98,86
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	N MARKT NOTIERTE	36.516.413	98,86
ANLAGEN INSGESAMT		36.516.413	98,86
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		422.978	1,14
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	_	36.939.391	100,00

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Growth & Income Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen <sup>zum 30.</sup> September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Internet	0,50
Immobilien	1,19
Automobilzulieferer	1,50
Gesundheitswesen	1,55
Maschinenbau	1,62
Telekommunikation	2,12
Forstprodukte und Papier	2,14
Werbung	2,25
Wohnungsbauunternehmen	2,31
Einzelhandel	2,52
Elektrische Geräte	2,66
Öl und Gas	2,70
Elektrische Komponenten und Zubehör	2,90
Medien	3,63
Gewerbliche Dienstleistungen	3,85
Software	4,20
Baustoffe	4,26
Chemikalien	4,61
Halbleiter	5,96
Versicherungen	8,17
Nahrungsmittel und Getränke	8,76
Arzneimittel	12,23
Finanzdienstleistungen	17,23
Anlagen insgesamt	98,86
Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,14
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) European Smaller Cap

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A EUR eine Rendite von 12,2 %. Im Vergleich dazu erzielte der EMIX (die zusammengesetzte Benchmark bis zum 31. Juli 2023) Smaller European Companies Index (NR) eine Rendite von 13,6 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Das Portfolio lag leicht über den starken Kursgewinnen der europäischen Aktienmärkte in den letzten zwölf Monaten. Der größte positive Beitrag stammte von der Beteiligung an Breedon, einem auf Übernahmen ausgerichteten britischen Baustoffkonzern, der vom AIM zum Hauptmarkt wechselte. Gerresheimer, ein in Deutschland börsennotiertes Unternehmen für pharmazeutische Verpackungen, hat eine Neuausrichtung auf höherwertige Produkte mit höherem Wachstum vollzogen und gilt nun als wichtiger Lieferant von Verpackungen für den wachsenden Bereich der Adipositas-Medizin. Die Aktien stiegen nach den ermutigenden Herzdaten aus der Medikamentenstudie von Novo Nordisk, die die Erwartungen hinsichtlich der Größe des adressierbaren Marktes für Medikamente gegen Fettleibigkeit erhöhten. Unsere Beteiligungen an Halbleiterunternehmen, darunter ASM International, profitierten von den starken Ergebnissen von NVIDIA und der Überzeugung, dass die für die künstliche Intelligenz benötigte hohe Rechenleistung zu einer zusätzlichen Nachfrage im Bereich der Chipfertigung führen wird. Die Performance wurde durch eine Gewinnwarnung von flatexDEGIRO, einem in Deutschland notierten Online-Broker, beeinträchtigt. Die Senkung der Jahresprognose aufgrund von geringerer Kundenaktivität war kein Schock. Die Nachricht von einer Prüfung durch die deutsche Regulierungsbehörde (BaFin), die Maßnahmen zur Verbesserung der internen Kontrollen und des Eigenkapitals zur Folge hatte, war jedoch eine Überraschung. Die rasche Expansion des Unternehmens erfordert zwar eine stärkere aufsichtsrechtliche Kontrolle. aber die Art und Weise, wie das Management damit umgegangen ist, war äußerst enttäuschend, und wir haben unsere Position verkauft. Coor Service Management, der führende skandinavische integrierte Gebäudemanager, hat den Verlust eines seiner größten Verträge bekannt gegeben, der etwa 5 % seines Umsatzes ausmachte. Dies hat die Anlagethese in Frage gestellt, und wir überprüfen derzeit unsere Position.

### Marktrückblick

Die europäischen Small-Cap-Aktienmärkte legten im Berichtszeitraum zu, blieben aber deutlich hinter der Entwicklung der Large Caps zurück. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die europäischen Aktien wiesen über den Winter eine Outperformance auf, da die Wirtschaft eine Rezession weitgehend vermieden hat. Anfang 2023 wurde der Markt jedoch von fallenden Bankaktien getroffen, die aus dem Zusammenbruch zweier US-Regionalbanken und der Rettung der Credit Suisse resultierten und zur Unsicherheit bezüglich der Ausrichtung der Geldpolitik beitrugen. Obwohl das Ausbleiben einer Ansteckung durch die Finanzkrise begrüßt wurde, erhöhte die Europäische Zentralbank (EZB) die Zinsen weiter, sogar als die Wirtschaft mit einer schwachen chinesischen Importnachfrage und einer gedämpften inländischen Verbraucherbasis zu kämpfen hatte. Gegen Ende des Berichtszeitraums wurde den risikoscheuen Änlegern klar, dass die weltweiten Zinssätze wahrscheinlich noch länger höher bleiben würden, was zu dem wirtschaftlichen Pessimismus einer breiteren regionalen Konjunkturabschwächung hinzukam und die Aktien belastete. Da die Energiepreise in Europa nachgaben, sank die Inflation in der Eurozone nach vorläufigen Schätzungen im September 2023 auf 4,3 % und damit auf den niedrigsten Stand seit Oktober 2021. Unterdessen kühlte sich die Kerninflation von 5,5 % im Juli auf 5,3 % ab. Innerhalb von zwölf Monaten hob die EZB die Zinssätze acht Mal an, mit einer großen Anhebung um 75 Basispunkte im Oktober und kleineren Anhebungen im Dezember, Februar, März, Mai, Juni, Juli und September 2023, wodurch der Einlagensatz auf 4,00 % stieg. Darüber hinaus begann im März die quantitative Straffung.

### Ausblick

Zu Beginn des letzten Quartals des Jahres wird die Richtung der europäischen Aktienmärkte weiterhin von der Inflation und den Aussichten auf einen möglichen Höchststand der Zinssätze und die damit verbundenen Auswirkungen auf die Wirtschaft bestimmt. Zwar gibt es Anzeichen für eine Verlangsamung der Konjunktur, da die Einkaufsmanagerindizes deutlich schwächer ausfielen, insbesondere im Vereinigten Königreich und in Europa, doch bleibt die Inflation hartnäckig hoch, auch wenn sie einige Anzeichen einer Abschwächung aufweist. Die Kommentare der Zentralbanken deuten darauf hin, dass wir den Höhepunkt der Zinssätze erreicht haben, dass diese aber noch einige Zeit hoch bleiben werden. Wir sind der Ansicht, dass das Portfolio weiterhin gut positioniert ist, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige Unternehmen zu attraktiven Bewertungen konzentrieren, die trotz des wirtschaftlichen Umfelds eine gute Performance erzielen können.

### Lucy Morris / Sam Cosh

Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Smaller Cap Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN WERTPAPIERE	GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAG	BARE	
ANTEILE			
Österreich Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	1.863	103.955	1,44
Belgien Lotus Bakeries NV	16	123.040	1,70
Dänemark	4 700	0.14 500	0.00
Ringkjoebing Landbobank AS Royal Unibrew AS	1.786 1.693	244.536 123.916	3,39 1,71
Frankreich		368.452	5,10
Lectra	5.106	131.479	1,82
Remy Cointreau SA	1.101	127.331	1,76
Verallia SA	3.206	119.520	1,66
Deutschland		378.330	5,24
CTS Eventim AG & Co. KGaA	2.509	135.110	1,87
Gerresheimer AG	2.156	214.414	2,97
Rational AG	190	114.000	1,58
Symrise AG	1.860	167.995	2,32
Irland		631.519	8,74
Bank of Ireland Group PLC	13.035	121.095	1,68
Dalata Hotel Group PLC	30.005	120.470	1,67
Glanbia PLC	7.727	120.619	1,67
Italien		362.184	5,02
Azimut Holding SpA	5.753	118.972	1,65
Carel Industries SpA	4.890	111.003	1,54
Davide Campari-Milano NV	9.217	102.908	1,42
Interpump Group SpA	4.485 11.914	195.053 88.759	2,70
Technoprobe SpA	11.914	616.695	1,23 <b>8,54</b>
Niederlande		010.095	0,54
ASM International NV	348	138.330	1,92
BE Semiconductor Industries NV	850	79.050	1,09
IMCD NV	1.317	158.040 375.420	2,19 <b>5,20</b>
Norwegen		575.420	5,20
Atea ASA	9.216	109.290	1,51
Carasent ASA	26.469	36.416	0,51
Nordic Semiconductor ASA Storebrand ASA	10.037 15.247	98.936 117.959	1,37 1,63
TGS ASA	5.780	75.213	1,03
		437.814	6,06
Spanien	10.964	240,420	2.02
Fluidra SA Merlin Properties Socimi SA	10.864 9.318	210.436 74.404	2,92 1,03
Vidrala SA	1.741	143.110	1,98
Viscofan SA	2.840	164.152	2,27
Sebweden		592.102	8,20
Schweden Avanza Bank Holding AB	4.486	73.867	1,02
Coor Service Management Holding AB	24.970	96.385	1,34
Engcon AB	13.542	87.533	1,21
Hexpol AB Indutrade AB	11.783 4.953	99.520 87.283	1,38 1,21
Karnov Group AB	32.920	138.234	1,21
MIPS AB	3.045	98.161	1,36
Nordnet AB publ	6.033	75.737	1,05
Sdiptech AB 'B'	7.798	150.096	2,08
Surgical Science Sweden AB Thule Group AB	2.895 7.156	37.828 178.488	0,52 2,47
	7.150		
		1.123.132	15,55

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Smaller Cap Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Schweiz			
Kardex Holding AG.	484	100.194	1,39
Metall Zug AG	66	97.445	1,35
Siegfried Holding AG.	175	141.746	1,96
SIG Group AG	9.470	221.364	3,07
Tecan Group AG	654	208.784	2,89
V-ZUG Holding AG	818	53.377	0,74
		822.910	11,40
Vereinigtes Königreich			
AG Barr PLC	31.753	179.733	2,49
Breedon Group PLC	39.979	151.632	2,10
Britvic PLC	20.119	202.248	2,80
Cranswick PLC	5.330	218.254	3,02
Genuit Group PLC	28.095	106.720	1,48
Genus PLC	4.041	97.644	1,35
Ibstock PLC	83.568	137.283	1,90
Morgan Advanced Materials PLC	47.224	133.380	1,85
		1.226.894	16,99
ANTEILE GESAMT		7.162.447	99,18
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	NOTIERTE	7.162.447	99,18
ANLAGEN INSGESAMT		7.162.447	99,18
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		59.034	0,82
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	_	7.221.481	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Smaller Cap Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gew	inn aus Devisenterminkon	trakten			
EUR	1.364	CHF	(1.316)	31.10.2023	2
Summe des nicht real	isierten Gewinns aus Dev	senterminkontrakten			2
Nicht realisierter Verlu	ust aus Devisenterminkon	trakten			
CHF	81.687	EUR	(84.543)	31.10.2023	(50)
Summe des nicht real	isierten Verlusts aus Devi	senterminkontrakten			(50)

Die Gegenpartei für Devisenterminkontrakte war State Street Bank & Trust Company.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) European Smaller Cap Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen <sup>zum 30.</sup> September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Immobilien	1,03
Holdinggesellschaften	1,35
Landwirtschaft	1,35
Internet	1,51
Versicherungen	1,63
Hotelgewerbe	1,67
Arzneimittel	1,96
Computer	2,08
Vertrieb und Großhandel	2,19
Elektrische Geräte	2,32
Software	2,33
Chemikalien	2,32
Öl und Gas	2,48
Umweltschutz	2,92
Gewerbliche Dienstleistungen	3,25
Gesundheitswesen	3,41
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	4,44
Maschinenbau	5,30
Halbleiter	5,61
Freizeit und Tourismus	5,70
Baustoffe	7,02
Finanzdienstleistungen	8,79
Verpackungen und Container	9,68
Nahrungsmittel und Getränke	18,84
Anlagen insgesamt	99,18
Sonstige Aktiva / (Passiva)	0,82
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Global Absolute Return Bond

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse I Acc EUR eine Rendite von 1,8 %. Im Vergleich dazu erzielte die SONIA Interbank Rate GBP eine Rendite von 2,5 %. Die Performance ist die Gesamtrendite nach Abzug der Gebühren, in Pfund Sterling ausgedrückt.

Die Strategie lieferte positive negative Renditen, obwohl die Rentenmärkte im Durchschnitt Verluste verzeichneten. Das Engagement im US-Zinsrisiko schmälerte die Rendite, da die US-Anleiherenditen stiegen. Zwar trugen defensive Strategien am US-Zinsmarkt dazu bei, die Auswirkungen des Anstiegs der Renditen der US-Staatsanleihen abzumildern, doch wirkte sich das Engagement im eingebetteten Zinsrisiko der Positionen des Fonds in Unternehmensanleihen negativ auf die Performance aus. Selbst als die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads aufgrund der robusten Wirtschaft. Das Engagement in "Rising Stars" – Emittenten, die den Sprung vom Kreditrating "High Yield" zu "Investment Grade" schaffen – leistete einen weiteren positiven Beitrag zur Performance, ebenso wie die Ausrichtung auf Beta-stärkere Sektoren des Marktes für Unternehmensanleihen. Kreditabsicherungsstrategien schmälerten die Erträge. Bei den Relative-Value-Zinsstrategien kam es Anfang 2023 zu einem Rücksetzer, was vor allem auf eine Long-Position im Vereinigten Königreich und eine Short-Position in Japan zurückzuführen war, wobei die Position im Vereinigten Königreich im weiteren Verlauf des Jahres die Erwartungen erfüllte.

### Marktrückblick

Die Renditen der weltweiten Staatsanleihen stiegen im Berichtszeitraum, als Reaktion auf die steigenden Zinssätze. Im letzten Quartal 2022 kam es zu einem sprunghaften Anstieg, da Inflationsängste und das Tempo der Zinsanhebungen im Vordergrund standen. Die Renditen gingen jedoch wieder zurück, als das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 nachließ und die Anleger mit einem Höchststand der Zinssätze und sogar mit Zinssenkungen rechneten, falls sich das Wirtschaftswachstum abschwächen sollte. Die US-Notenbank (Fed) beendete ihr Programm zur quantitativen Lockerung, verringerte ihre Anleihebestände und hob die Zinssätze sechsmal an, so dass sie Ende September bei 5,50 % lagen. Dadurch übertrafen die Zinssätze die sinkenden Inflationsraten. Die Verbraucherpreisinflation ging vor dem Hintergrund sinkender Energiekosten von 7,7 % im Oktober 2022 auf 3,7 % im September 2023 zurück. Die Fed dämpfte jedoch die Erwartungen der Anleger auf eine schnelle Zinswende bei einem weiteren Rückgang der Inflation und wies darauf hin, dass die Zinssätze möglicherweise "länger höher" bleiben müssen, bis der Lohndruck nachlässt. Diese Verschiebung führte zu einer steileren Renditekurve, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit in Erwartung einer lockereren Geldpolitik stiegen, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Selbst als die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads. Dies spiegelte die relative Widerstandsfähigkeit des Wirtschaftswachstums und solide Erträge wider.

### Ausblick

Unsere Haltung in Bezug auf Staatsanleiherenditen ist nach wie vor bullisch, wenn auch mit einer Tendenz zur Versteilerung, da wir Long-Positionen am vorderen Ende der Kurven bevorzugen. Die Renditen sind sprunghaft angestiegen, mit einer starken Versteilerung, die vor allem durch das hintere Ende der US-Kurve verursacht wurde. Dies lässt sich durch eine Kombination von Themen erklären: eine Herabstufung der Kreditratings der US-Bundesbehörden, restriktive Zentralbanken, die ein längerfristig höheres Zinsniveau anführen, ein widerstandsfähigeres Wachstum als erwartet und Bedenken hinsichtlich der Emission von Schuldtiteln aufgrund einer weiterhin expansiven Finanzpolitik. Zwar sind die Bewertungen attraktiver geworden, da weniger Zinssenkungen eingepreist sind und die Laufzeitprämie gestiegen ist, doch sind wir weiterhin vorsichtig, wenn es um die Aufstockung von bullischen Anleihepositionen geht, da die Arbeitsmärkte trotz der zahlreichen Zinserhöhungen der Zentralbanken noch keine Anzeichen für eine deutliche Abschwächung erkennen lassen. Zu Beginn des letzten Quartals 2023 scheinen die Aussichten für die weltweiten Investment-Grade (IG)-Unternehmenskredite recht ausgewogen zu sein. Die wirtschaftlichen Aussichten sind schwach, aber positiv, doch die straffe Geldpolitik bleibt eine klare Bedrohung mit Blick auf eine weitere Verengung der Kreditspreads. Dagegen erwarten wir, dass die Kreditqualität, insbesondere in den USA, hoch bleibt.

#### **Global Rates Team**

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE O	DER AN EINEM AND	EREN GEREGELTE	N MARKT NOTIE	RTE ÜBERTRAGB	ARE WERTPAPIER	RE
ANLEIHEN						
Australien						
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., V/R	1,81 %	16.09.2031	GBP	300.000	296.117	0,17
Macquarie Bank Ltd.	1,13 %	15.12.2025	GBP	867.000	909.891	0,53
NBN Co. Ltd.	5,75 %	06.10.2028	USD	480.000	455.419	0,26
Westpac Banking Corp., V/R	5,88 %	11.01.2028	GBP	1.200.000	1.388.237	0,81
Bermuda					3.049.664	1,77
Hiscox Ltd.	6,00 %	22.09.2027	GBP	465.000	534.442	0,31
Kanada Bausch & Lomb Escrow Corp.	8,38 %	01.10.2028	USD	543.000	515.305	0,30
Canadian Imperial Bank of Commerce, V/R	5,77 %	13.04.2026	GBP	1.500.000	1.732.158	1,00
Hudbay Minerals, Inc.	6,13 %	01.04.2029	USD	370.000	324.074	0,19
Royal Bank of Canada	1,00 %	09.09.2026	GBP	563.000	571.014	0,19
Royal Bank of Canada, V/R	5,90 %	18.01.2028	GBP	1.250.000	1.446.269	0,33
Toronto-Dominion Bank	5,29 %	11.01.2028	GBP	1.136.000	1.279.019	0,04
	3,23 /0	11.01.2020	<b>GBI</b>	1.130.000	5.867.839	3,40
Kaimaninseln					0.000.000	,
QNB Finance Ltd.	2,63 %	12.05.2025	USD	660.000	591.016	0,34
Southern Water Services Finance Ltd.	1,63 %	30.03.2027	GBP	400.000	387.725	0,23
Transocean Titan Financing Ltd.	8,38 %	01.02.2028	USD	325.000	312.597	0,18
Chile					1.291.338	0,75
Inversiones CMPC SA	3,00 %	06.04.2031	USD	738.000	555.269	0,32
Dänemark						
Danske Bank AS, V/R	4,63 %	13.04.2027	GBP	527.000	587.587	0,34
Danske Bank AS, V/R	6,50 %	23.08.2028	GBP	761.000	890.678	0,52
Finnland					1.478.265	0,86
OP Corporate Bank PLC	3,38 %	14.01.2026	GBP	1.100.000	1.205.104	0,70
OP Corporate Bank PLC	4,00 %	13.06.2028	EUR	1.058.000	1.052.734	0,61
Teollisuuden Voima Oyj	1,13 %	09.03.2026	EUR	100.000	91.835	0,05
Teollisuuden Voima Oyj	1,38 %	23.06.2028	EUR	285.000	243.872	0,14
					2.593.545	1,50
Frankreich Altice France SA	5,88 %	01.02.2027	EUR	405.000	350.024	0,20
Altice France SA	5,50 %	15.01.2028	USD	312.000	226.505	0,20
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3,88 %	26.01.2028	EUR	1.200.000	1.171.361	0,13
BNP Paribas SA	5,75 %	13.06.2032	GBP	400.000	446.392	0,00
BNP Paribas SA, V/R	4,38 %	13.01.2029	EUR	800.000	794.869	0,46
BPCE SA	4,38 %	13.07.2028	EUR	1.100.000	1.090.313	0,63
BPCE SA, V/R	1,65 %	06.10.2026	USD	496.000	425.388	0,25
Cie de Saint-Gobain, V/R	3,86 %	18.07.2024	EUR	500.000	500.237	0,29
Credit Agricole SA	3,38 %	28.07.2027	EUR	1.200.000	1.170.547	0,68
Crown European Holdings SA	5,00 %	15.05.2028	EUR	330.000	329.208	0,19
Elis SA	1,00 %	03.04.2025	EUR	300.000	283.898	0,16
Engie SA	3,75 %	06.09.2027	EUR	600.000	597.130	0,34
Engie SA	3,63 %	11.01.2030	EUR	900.000	875.839	0,51
Faurecia SE	2,38 %	15.06.2027	EUR	390.000	343.588	0,20
Iliad Holding SASU	7,00 %	15.10.2028	USD	400.000	344.310	0,20
iliad SA	2,38 %	17.06.2026	EUR	500.000	462.236	0,27
Praemia Healthcare SACA	5,50 %	19.09.2028	EUR	100.000	99.725	0,06
Renault SA	1,25 %	24.06.2025	EUR	700.000	657.038	0,38
Societe Generale SA, V/R	6,45 %	10.01.2029	USD	1.108.000	1.035.250	0,60
Suez SACA	1,88 %	24.05.2027	EUR	500.000	461.341	0,27
Valeo	5,38 %	28.05.2027	EUR	600.000	600.848	0,35
WPP Finance SA	4,13 %	30.05.2028	EUR	1.175.000	1.166.005	0,68
Deutschland					13.432.052	7,79
Allianz SE, V/R	2,60 %	31.12.2099	EUR	200.000	130.880	0,08
Amprion GmbH	3,88 %	07.09.2028	EUR	600.000	594.750	0,34
Bayer AG, V/R	7,00 %	25.09.2083	EUR	200.000	198.221	0,11
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1,50 %	15.05.2024	EUR	4.700.000	4.640.207	2,69
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7,50 %	15.05.2030	EUR	525.000	526.899	0,31
	1,38 %	29.12.2031	EUR	500.000	417.911	0,24
Commerzbank AG, V/R	1,50 /0	29.12.2031	LUK	300.000	417.511	0,24

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Deutsche Bank AG, V/R	4,50 %	30.04.2027	EUR	200.000	142.134	0,08
Deutsche Bank AG, V/R	1,88 %	22.12.2028	GBP	400.000	377.008	0,22
Deutsche Bank AG, V/R	5,00 %	05.09.2030	EUR	400.000	385.745	0,22
E.ON SE	3,50 %	12.01.2028	EUR	1.386.000	1.364.381	0,79
Mahle GmbH	2,38 %	14.05.2028	EUR	400.000	308.506	0,18
Santander Consumer Bank AG	4,50 %	30.06.2026	EUR	700.000	701.429	0,41
Schaeffler AG	2,75 %	12.10.2025	EUR	500.000	480.103	0,28
Vonovia SE	0,00 %	01.12.2025	EUR	300.000	272.377	0,16
Vonovia SE	1,38 %	28.01.2026	EUR	900.000	837.589	0,49
ZF Finance GmbH	2,25 %	03.05.2028	EUR	600.000	509.635	0,30
Gibraltar	•	· · ·	· · ·	· · ·	12.581.874	7,30
888 Acquisitions Ltd.	7,56 %	15.07.2027	EUR	520.000	481.015	0,28
· · · ·	7,50 70	13.07.2027	LOIX	520.000	401.013	0,20
Indien Bharti Airtel Ltd.	3,25 %	03.06.2031	USD	500.000	389.894	0,23
Irland						
AIB Group PLC	1,88 %	19.11.2029	EUR	475.000	452.288	0,26
Bank of Ireland Group PLC, V/R	4,88 %	16.07.2028	EUR	746.000	751.504	0,44
Bank of Ireland Group PLC, V/R	1,38 %	11.08.2031	EUR	515.000	457.925	0,27
CRH SMW FINANCE DAC	4,00 %	11.07.2027	EUR	824.000	822.285	0,48
ESB Finance DAC	4,00 %	03.10.2028	EUR	500.000	499.776	0,29
Permanent TSB Group Holdings PLC, V/R	6,63 %	25.04.2028	EUR	1.059.000	1.072.881	0,62
Permanent TSB Group Holdings PLC, V/R	6,63 %	30.06.2029	EUR	220.000	223.165	0,13
Permanent TSB Group Holdings PLC, V/R	3,00 %	19.08.2031	EUR	200.000	178.644	0,10
Ryanair DAC	0,88 %	25.05.2026	EUR	1.046.000	963.313	0,10
Vodafone International Financing DAC	3,25 %	02.03.2029	EUR	257.000	247.337	0,30
	3,23 78	02.03.2029	LOIX	237.000	5.669.118	3,29
Italien						-,
Autostrade per l'Italia SpA	1,63 %	25.01.2028	EUR	900.000	793.785	0,46
Autostrade per l'Italia SpA	2,00 %	15.01.2030	EUR	455.000	380.803	0,22
Autostrade per l'Italia SpA	4,75 %	24.01.2031	EUR	157.000	152.816	0,09
Lottomatica SpA	9,75 %	30.09.2027	EUR	315.000	340.169	0,20
Nexi SpA	1,63 %	30.04.2026	EUR	400.000	365.754	0,21
Telecom Italia SpA	6,88 %	15.02.2028	EUR	335.000	337.862	0,20
Telecom Italia SpA	7,88 %	31.07.2028	EUR	500.000	519.111	0,30
	.,,.				2.890.300	1,68
Korea						
KT Corp.	1,38 %	21.01.2027	USD	732.000	605.332	0,35
Luxemburg	0.00.0/	~~~~~~~~			500.050	
Aroundtown SA	0,63 %	09.07.2025	EUR	600.000	533.859	0,31
Aroundtown SA	0,38 %	15.04.2027	EUR	600.000	456.762	0,27
AXA Logistics Europe Master SCA	0,38 %	15.11.2026	EUR	1.235.000	1.082.722	0,63
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	2,20 %	24.07.2025	EUR	581.000	545.742	0,32
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	1,75 %	12.03.2029	EUR	360.000	283.160	0,16
CPI Property Group SA	2,75 %	22.01.2028	GBP	636.000	521.276	0,30
Hidrovias International Finance Sarl	4,95 %	08.02.2031	USD	400.000	303.447	0,18
P3 Group Sarl	0,88 %	26.01.2026	EUR	351.000	312.729	0,18
P3 Group Sarl	0,88 %	26.01.2026	EUR	700.000	623.676	0,36
Mexiko					4.663.373	2,71
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo						
Financiero Santand	5,38 %	17.04.2025	USD	932.000	866.349	0,50
Cemex SAB de CV	3,88 %	11.07.2031	USD	300.000	237.662	0,14
Mexico Government International Bond	2,25 %	12.08.2036	EUR	400.000	281.968	0,16
Niederlande					1.385.979	0,80
ABB Finance BV	3,25 %	16.01.2027	EUR	454.000	446.109	0,26
ABN AMRO Bank NV	3,63 %	10.01.2026	EUR	300.000	297.185	0,17
ABN AMRO Bank NV	5,25 %	26.05.2026	GBP	400.000	456.184	0,27
	-, -,-	16.01.2028	EUR	900.000	884.990	0,51
	4.00 %					
ABN AMRO Bank NV	4,00 % 2.00 %			500 000	425 015	0.25
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV	2,00 %	30.01.2028	EUR	500.000	425.015	0,25
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R	2,00 % 7,00 %	30.01.2028 07.12.2043	EUR EUR	100.000	102.965	0,06
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV	2,00 % 7,00 % 3,25 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026	EUR EUR EUR	100.000 895.000	102.965 881.629	0,06 0,51
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV BMW International Investment BV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026	EUR EUR EUR GBP	100.000 895.000 700.000	102.965 881.629 807.857	0,06 0,51 0,47
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV BMW International Investment BV easyJet FinCo BV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 % 1,88 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026 03.03.2028	EUR EUR GBP EUR	100.000 895.000 700.000 942.000	102.965 881.629 807.857 827.503	0,06 0,51 0,47 0,48
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV BMW International Investment BV easyJet FinCo BV EnBW International Finance BV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 % 1,88 % 3,63 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026 03.03.2028 22.11.2026	EUR EUR GBP EUR EUR	100.000 895.000 700.000 942.000 583.000	102.965 881.629 807.857 827.503 578.186	0,06 0,51 0,47 0,48 0,34
ABN AMRO Bank NV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 % 1,88 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026 03.03.2028	EUR EUR GBP EUR	100.000 895.000 700.000 942.000	102.965 881.629 807.857 827.503	0,06 0,51 0,47 0,48
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV BMW International Investment BV easyJet FinCo BV EnBW International Finance BV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 % 1,88 % 3,63 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026 03.03.2028 22.11.2026	EUR EUR GBP EUR EUR EUR EUR EUR	100.000 895.000 700.000 942.000 583.000	102.965 881.629 807.857 827.503 578.186	0,06 0,51 0,47 0,48 0,34
ABN AMRO Bank NV Ashland Services BV ASR Nederland NV, V/R BMW Finance NV BMW International Investment BV easyJet FinCo BV EnBW International Finance BV EnBW International Finance BV	2,00 % 7,00 % 3,25 % 5,50 % 1,88 % 3,63 % 3,50 %	30.01.2028 07.12.2043 22.11.2026 06.06.2026 03.03.2028 22.11.2026 24.07.2028	EUR EUR GBP EUR EUR EUR	100.000 895.000 700.000 942.000 583.000 705.000	102.965 881.629 807.857 827.503 578.186 689.982	0,06 0,51 0,47 0,48 0,34 0,40

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Mercedes-Benz International Finance BV	3,50 %	30.05.2026	EUR	945.000	937.863	0,54
Mercedes-Benz International Finance BV	5,63 %	17.08.2026	GBP	600.000	695.601	0,40
OI European Group BV	2,88 %	15.02.2025	EUR	550.000	536.236	0,31
PPF Telecom Group BV	3,13 %	27.03.2026	EUR	590.000	565.084	0,33
Stellantis NV	4,50 %	07.07.2028	EUR	296.000	298.171	0,17
Stellantis NV	4,50 %	07.07.2028	EUR	200.000	201.467	0,12
Summer BidCo BV	9,00 %	15.11.2025	EUR	233.179	227.579	0,12
Syngenta Finance NV	3,38 %	16.04.2026	EUR	500.000	483.776	0,28
Telefonica Europe BV, V/R	6,75 %	31.12.2099	EUR	400.000	395.609	0,23
Toyota Motor Finance Netherlands BV	3,38 %	13.01.2026	EUR	200.000	196.793	0,11
Toyota Motor Finance Netherlands BV	4,63 %	08.06.2026	GBP	281.000	317.320	0,18
Toyota Motor Finance Netherlands BV	4,63 %	08.06.2026	GBP	670.000	756.600	0,44
United Group BV	4,00 %	15.11.2027	EUR	445.000	389.411	0,23
Universal Music Group NV	3,00 %	30.06.2027	EUR	666.000	645.247	0,38
Villa Dutch Bidco BV	9,00 %	03.11.2029	EUR	265.000	259.700	0,15
Volkswagen Financial Services NV	3,25 %	13.04.2027	GBP	800.000	833.175	0,48
Volkswagen International Finance NV, V/R	4,38 %	31.12.2099	EUR	200.000	162.799	0,10
					16.229.383	9,42
Neuseeland Westpac New Zealand Ltd.	4,90 %	15.02.2028	USD	1.000.000	912.050	0,53
•	4,00 70	10.02.2020	000	1.000.000	012.000	0,00
Panama						
Carnival Corp. Peru	7,00 %	15.08.2029	USD	155.000	144.493	0,08
Peruvian Government International Bond	1,25 %	11.03.2033	EUR	640.000	467.245	0,27
Portugal						
EDP - Energias de Portugal SA	3,88 %	26.06.2028	EUR	300.000	296.700	0,17
Rumänien Romanian Government International Bond	2,75 %	14.04.2041	EUR	600.000	354.138	0,21
Singapur	2,10 %		2011	0001000	0011100	0,2 .
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	4,45 %	19.05.2028	USD	410.000	373.967	0,22
Südafrika						
Republic of South Africa Government Bond	8,25 %	31.03.2032	ZAR	17.000.000	696.281	0,41
Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	20.04.2032	USD	500.000	402.278	0,23
Spanien					1.098.559	0,64
Banco Santander SA	5,29 %	18.08.2027	USD	600.000	548.319	0,32
Banco Santander SA	3,88 %	16.01.2028	EUR	700.000	690.059	0,40
Banco Santander SA, V/R	3,63 %	31.12.2099	EUR	200.000	128.254	0,40
Cellnex Finance Co. SA	1,50 %		EUR		605.712	
		08.06.2028		700.000		0,35
Cellnex Finance Co. SA	2,00 %	15.02.2033	EUR	400.000	309.313	0,18
Cellnex Telecom SA	1,88 %	26.06.2029	EUR	400.000	340.442	0,20
FCC Aqualia SA	2,63 %	08.06.2027	EUR	1.121.000	1.060.045	0,62
Grifols SA	1,63 %	15.02.2025	EUR	500.000	483.365	0,28
International Consolidated Airlines Group SA	3,75 %	25.03.2029	EUR	600.000	522.024	0,30
Santander Consumer Finance SA	0,50 %	14.01.2027	EUR	700.000	619.234	0,36
					5.306.767	3,08
Supranational	0.40.04	10.00.0005		4 407 000	4 000 0 10	0.70
Africa Finance Corp.	3,13 %	16.06.2025	USD	1.437.000	1.263.949	0,73
Asian Development Bank	4,00 %	21.11.2025	GBP	1.250.000	1.407.422	0,82
Bacardi Ltd./Bacardi-Martini BV	5,25 %	15.01.2029	USD	415.000	379.540	0,22
Caburadan					3.050.911	1,77
Schweden Skandinaviska Enskilda Banken AB	3,75 %	07.02.2028	EUR	1.245.000	1.215.931	0,71
Swedbank AB	1,30 %	17.02.2027	EUR	1.379.000	1.242.111	0,72
	,		-		2.458.042	1,43
Schweiz	4 40 04	45 40 0005	000	F40.000	504.040	
Credit Suisse AG	1,13 %	15.12.2025	GBP	512.000	531.843	0,31
Credit Suisse Group AG, V/R	6,44 %	11.08.2028	USD	463.000	437.172	0,25
UBS Group AG, V/R	0,25 %	03.11.2026	EUR	608.000	552.233	0,32
UBS Group AG, V/R	4,38 %	31.12.2099	USD	322.000	218.573	0,13
Vereinigte Arabische Emirate					1.739.821	1,01
DP World Ltd.	4,25 %	25.09.2030	GBP	100.000	101.532	0,06
DP World Ltd.	4,25 %	25.09.2030	GBP	150.000	152.298	0,09
First Abu Dhabi Bank PJSC	0,88 %	09.12.2025	GBP	397.000	407.061	0,23

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
First Abu Dhabi Bank PJSC Oztel Holdings SPC Ltd.	1,13 % 5,63 %	07.09.2026 24.10.2023	GBP USD	422.000 670.000	420.977 632.568	0,24 0,37
Vereinigtes Königreich	<del>, , ,</del>	· · · ·	· · ·		1.714.436	0,99
Argiva Financing PLC	7,21 %	30.06.2028	GBP	401.000	475.808	0,28
Barclays PLC, V/R	2,28 %	24.11.2027	USD	775.000	645.304	0,37
Barclays PLC, V/R	1,13 %	22.03.2031	EUR	249.000	220.135	0,13
Barclays PLC, V/R	8,41 %	14.11.2032	GBP	200.000	235.481	0,14
Barclays PLC, V/R	5,26 %	29.01.2034	EUR	141.000	139.171	0,08
British Telecommunications PLC	0,50 %	12.09.2025	EUR	300.000	280.419	0,16
Burberry Group PLC	1,13 %	21.09.2025	GBP	962.000	1.012.642	0,59
Cadent Finance PLC Coventry Building Society	4,25 % 1,00 %	05.07.2029 21.09.2025	EUR GBP	1.338.000 800.000	1.324.340 839.767	0,77 0,49
DS Smith PLC	4,38 %	27.07.2027	EUR	361.000	360.416	0,43
Experian Finance PLC	0,74 %	29.10.2025	GBP	500.000	524.713	0,30
HSBC Holdings PLC, V/R	1,75 %	24.07.2027	GBP	471.000	480.009	0,28
HSBC Holdings PLC, V/R	1,75 %	24.07.2027	GBP	100.000	101.913	0,06
HSBC Holdings PLC, V/R	3,00 %	22.07.2028	GBP	100.000	102.223	0,06
HSBC Holdings PLC, V/R	4,70 %	31.12.2099	USD	200.000	142.404	0,08
International Game Technology PLC	4,13 %	15.04.2026	USD	720.000	640.267	0,37
Investec PLC, V/R	2,63 %	04.01.2032	GBP	865.000	819.308	0,47
Iron Mountain U.K. PLC	3,88 %	15.11.2025	GBP	265.000	289.079	0,17
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,88 %	15.01.2028	USD	244.000	207.465	0,12
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4,50 %	15.07.2028	EUR	400.000	351.676	0,20
Kane Bidco Ltd.	6,50 %	15.02.2027	GBP	520.000	548.887	0,32
Leeds Building Society, V/R Leeds Building Society, V/R	1,50 %	16.03.2027	GBP	700.000	717.208	0,42
Leeds Building Society, V/R Legal & General Group PLC, V/R	3,75 % 4,50 %	25.04.2029 01.11.2050	GBP GBP	250.000 602.000	251.280 591.282	0,15 0,34
Lloyds Bank Corporate Markets PLC	4,13 %	30.05.2027	EUR	425.000	422.886	0,34
Lloyds Banking Group PLC	2,25 %	16.10.2024	GBP	453.000	502.630	0,24
Lloyds Banking Group PLC, V/R	4,50 %	11.01.2029	EUR	584.000	577.746	0,33
Lloyds Banking Group PLC, V/R	6,63 %	02.06.2033	GBP	398.000	446.681	0,26
Market Bidco Finco PLC	5,50 %	04.11.2027	GBP	435.000	426.775	0,25
Marks & Spencer PLC	3,75 %	19.05.2026	GBP	665.000	720.448	0,42
National Express Group PLC	2,50 %	11.11.2023	GBP	418.000	479.804	0,28
National Grid Electricity Distribution PLC	3,63 %	06.11.2023	GBP	600.000	690.055	0,40
National Grid Electricity Distribution South West PLC	5,88 %	25.03.2027	GBP	100.000	116.151	0,07
Nationwide Building Society	6,13 %	21.08.2028	GBP	404.000	471.598	0,27
Nationwide Building Society, V/R	6,18 %	07.12.2027	GBP	771.000	881.668	0,51
NatWest Group PLC, V/R	2,11 %	28.11.2031	GBP	402.000	395.393	0,23
NatWest Markets PLC NatWest Markets PLC	1,38 %	02.03.2027	EUR GBP	525.000	475.724 152.880	0,28
NatWest Markets PLC	6,38 % 4,25 %	08.11.2027 13.01.2028	EUR	131.000 502.000	499.098	0,09 0,29
Northumbrian Water Finance PLC	2,38 %	05.10.2027	GBP	300.000	301.288	0,29
Pension Insurance Corp. PLC	5,63 %	20.09.2030	GBP	523.000	536.142	0,31
Phoenix Group Holdings PLC	4,38 %	24.01.2029	EUR	493.000	451.021	0,26
Pinewood Finance Co. Ltd	3,25 %	30.09.2025	GBP	770.000	835.029	0,48
Real Finance Bonds No. 6 PLC, V/R	10,13 %	31.12.2099	GBP	565.000	637.903	0,37
Rolls-Royce PLC	5,75 %	15.10.2027	GBP	795.000	872.744	0,51
Santander U.K. Group Holdings PLC, V/R	2,92 %	08.05.2026	GBP	725.000	786.289	0,46
Severn Trent Utilities Finance PLC	3,63 %	16.01.2026	GBP	1.270.000	1.400.233	0,81
Standard Chartered PLC, V/R	3,79 %	21.05.2025	USD	965.000	894.964	0,52
Synthomer PLC	3,88 %	01.07.2025	EUR	550.000	527.399	0,31
Tesco Corporate Treasury Services PLC	2,50 %	02.05.2025	GBP	1.236.000	1.363.902	0,79
Thames Water Utilities Finance PLC	4,00 %	18.04.2027	EUR	1.316.000	1.228.465 579.994	0,71
Virgin Money U.K. PLC, V/R Virgin Money U.K. PLC, V/R	4,00 % 4,63 %	25.09.2026	GBP EUR	537.000 213.000	579.994 205.439	0,34
Virgin Money U.K. PLC, V/R Virgin Money U.K. PLC, V/R	4,63 % 2,63 %	29.10.2028 19.08.2031	GBP	311.000	205.439 307.548	0,12 0,18
Virgin Money U.K. Floancing I PLC	4,50 %	15.07.2031	GBP	515.000	466.811	0,18
Yorkshire Building Society	4,50 % 0,63 %	21.09.2025	EUR	443.000	411.823	0,27
Yorkshire Building Society	0,63 %	21.09.2025	EUR	200.000	185.925	0,24
Yorkshire Building Society, V/R	3,38 %	13.09.2028	GBP	420.000	416.468	0,24
Yorkshire Building Society, V/R	6,38 %	15.11.2028	GBP	783.000	882.488	0,51
USA					31.852.609	18,48
American Tower Corp.	0,45 %	15.01.2027	EUR	1.237.000	1.088.366	0,63
Amgen, Inc.	5,15 %	02.03.2028	USD	854.000	793.695	0,05
Amgen, Inc.	5,25 %	02.03.2020	USD	854.000	788.473	0,46
AT&T, Inc.	5,50 %	15.03.2027	GBP	1.200.000	1.361.441	0,79
Ball Corp.	4,88 %	15.03.2026	USD	460.000	419.128	0,24
Bank of America Corp.	4,13 %	12.06.2028	EUR	940.000	930.595	0,54
Booking Holdings, Inc.	1,80 %	03.03.2027	EUR	727.000	678.293	0,39
Booking Holdings, Inc.	3,63 %	12.11.2028	EUR	271.000	266.363	0,15
Broadcom, Inc.	3,19 %	15.11.2036	USD	1.028.000	697.797	0,41
Caesars Entertainment, Inc.	4,63 %	15.10.2029	USD	225.000	180.260	0,10

Crease Envalument. Inc.         7.00 %         156.2000         USD         936.00         200.00         141.44         0.03           Caralier Financia Sociations, Inc.         2.38 %         0.03.2003         ELR         21.000         177.449         0.40         0.10           Caralier Financia Sociations, Inc.         2.38 %         0.13.2003         ELR         21.000         177.449         0.40         0.00           Conters Comp.         4.25 %         151.2007         USD         930.000         453.58         0.25           Conters Comp.         4.25 %         151.2007         USD         930.000         425.447         0.16           Conters Comp.         2.07 %         2.06 2028         USD         334.000         271.447         0.40           Conters Contect Con	Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Calon Paral Solvers, Inc. 2,89 % 01.52.203 (USD 55.500 451.14 0.28 Calon Planna Solvers, Inc. 2,88 % 01.52.203 (USD 55.500 451.54.20 0.00 Calon Planna Solvers, Inc. 2,28 % 01.52.207 USD 50.000 453.58 0.35 Carters Con. 4,25 % 01.52.207 USD 50.000 453.58 0.35 Carters Con. 4,25 % 01.52.207 USD 50.000 453.58 0.35 Carters Con. 4,25 % 01.52.207 USD 50.000 255.50 (USD 55.500 255.50 0.25 Carters Con. 7,75 % 15.62.207 USD 50.000 255.50 0.25 Carters Con. 7,75 % 15.62.208 USD 71.000 84.174 0.49 Carter Paral LCCNK Good III LCCNK Fancters Control LCCNK Control III CCNK Fancters Control LCCNK Fancters III Control Control III CON CONTROL IIII CONTROL III CON CO	Caesars Entertainment, Inc.	7,00 %	15.02.2030	USD	305.000	280.607	0,16
Caterphile Financial Services Cop.         5.72         17.68.2038         GBP         647.000         72.4586         0.41           Corring Corr         4.35         15.12.207         USD         501.000         22.85.47         0.15           Corring Forent LOCDK Geball ILLOCOK Financing         6.00         15.12.207         USD         301.000         22.85.47         0.15           Contains Elver Electrotices International, Inc.         4.25         10.16.2023         USD         315.000         22.85.47         0.18           Contains Elver Electrotices International, Inc.         4.05         15.62.0238         USD         315.000         305.010         315.000         305.010         315.000         305.010         315.000         305.010         305.010         305.010         305.000         305.000         305.000         305		7,50 %	15.06.2030	USD	525.000	481.414	0,28
CC0 Helding LLCCCD Helding Capital Cap.         4.59         11.5.0.0.0.0.0.4.55.0.00         44.52.00         145.2.007         14.55           Creaters Cap.         4.0.5         11.5.2.007         USD         51.2.0.00         44.55.0.00         44.55.0.00         44.55.0.00         44.55.0.00         44.55.0.00         45.5.0.00 <t< td=""><td></td><td>2,38 %</td><td>01.03.2028</td><td></td><td>210.000</td><td>176.400</td><td>0,10</td></t<>		2,38 %	01.03.2028		210.000	176.400	0,10
Centere Cop.         4.25 %         15.12.007         USD         500.000         425.288         0.25           Centere Cop.         151.200         105         152.000         205.77         0.15           Carter Direct LCCCK Gobs II LLCCCK Financian, Inc.         2.75 %         2.40.500         105.0208         USD         336.000         275.073         0.46           Carter Chernel Outbor Heinization, Inc.         2.75 %         2.40.1204         GBP         316.000         234.840         0.18           Cart, Thermol Outbor Heinization, Inc.         5.75 %         2.40.1204         GBP         316.000         234.840         0.18           Darties fiver Locations Heinization, Inc.         5.75 %         10.60.2028         EUR         210.000         285.847         0.53           Darties fiver Locations Heinization, Inc.         5.26 %         10.64.2024         USD         240.000         285.167         0.13           Darties fiver Locations Heinization, Inc.         5.26 %         10.64.2024         USD         240.000         285.168         0.13           Darties fiver Locations Heinization, Inc.         5.26 %         10.64.2024         USD         200.000         285.47         0.55           Darties fiver Locations Heinization, Inc.         5.75 %			17.08.2026	GBP		754.906	0,44
Center Bornel LCCOR Global II LCCOR GLO	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.		15.08.2030		354.000	274.887	0,16
Central Funct LCCDK Ghoad ILLCCOK Financing         4.00 %         11.06.2023         UBB         341.000         371.64         0.2           Chaites Muel constructs International, Inc.         4.27 %         0.108.2023         UBB         340.000         371.64         0.12           Carly The Muel constructs International, Inc.         5.75 %         10.00.2028         UBB         1310.00         1449.163         0.84           Carly The Muel Constructs International, Inc.         5.75 %         10.00.2028         UBB         1310.00         1449.163         0.88           Damier Truck Finance Morth America LLC         5.46 %         10.00.2028         UBB         1410.00         1449.163         0.88           Digital Evor Finon LC         2.46 %         10.04.2024         UBB         246.000         246.87         0.65           Digital Evor Finon LC         2.46 %         10.04.2024         UBB         246.000         246.87         0.65           Digital Evor Finon LC         2.36 %         10.04.2024         UBB         271.000         163.418         0.09           Digital Evor Finon LC         2.36 %         10.04.2024         UBB         271.000         163.418         0.09           Digital Evor Finon LC         2.36 %         10.02.2025 <t< td=""><td>-</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>	-						
Co., Inc.         80.9%         1 508 2029         USD         394 000         271.54         0.22           Calgrong, Inc.         2,37 %         2,40 %         2,40 %         0.16 8.2028         USD         355.00         371.64         0.27         0.18           Conjunc, Inc.         2,37 %         2,40 %         2,40 %         0.16 %         2,40 %         0.17         0.18         0.18 %         0.14 %         0.17         0.14 %         0.17         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.12 %         0.14 %         0.03 %         0.04 %         0.03 %         0.04 %         0.04 %         0.03 % <td>•</td> <td>4,63 %</td> <td>15.12.2029</td> <td>USD</td> <td>312.000</td> <td>265.747</td> <td>0,15</td>	•	4,63 %	15.12.2029	USD	312.000	265.747	0,15
Charles New Luboratories International, Inc.         4.25         0         0.05.0208         USB         325.000         975.073         1.16           Clayron, Inc.         9.00         15.09.0208         USB         315.000         294.088         0.17           Clayr, Inc.         9.00         15.09.0208         USB         315.000         294.088         0.17           Damine Troux Finance Neth Averace LLC         5.45         V         20.0208         USB         246.000         555.88         0.32           Data Euro Finos LLC         2.33         15.04.2027         USB         246.000         246.100         246.100         0.461.17         0.15           Digite Euro Finos LLC         2.03         V         16.04.2027         USD         300.000         346.462         0.17           Disto Finos Communitations LLC         2.03         V         11.12.028         USD         300.000         344.408         0.03         0.		9 00 %	15 06 2020		204.000	271 546	0.22
Cingroup, Inc.         2,75         3 2401 2024         GBP         740.000         944.774         0.48           Corr, Inn.         5,75         15.09 2028         USD         315.000         244.868         0.17           Corv, Inn.         5,75         15.09 2028         EUR         315.000         1.488.13         0.02           Damier Trust, France North America LLC         5,25         15.04.2027         USD         520.000         266.538         0.22           Dipla Euro Franci LC         2,60         15.04.2028         EUR         1.000.000         0.096.00         0.12           Dipla Euro Franci LC         2,00         1.504.2048         USD         121.000         153.419         0.03           Discovery, Communication LLC         3,00         15.02.2048         USD         122.000         236.402         0.03           Discovery, Communication LLC         3,00         15.02.2048         USD         136.00         137.47         0.20           Discovery, Communication LLC         4,64         15.02.2028         USD         136.00         0.037.47         0.20           Discovery, Communication LLC         4,64         5.03.02.2028         USD         136.000         237.44         0.17							
Cheir Channel Outdoor Holding, Inc.         9.07         15.00.2028         LBB         315.00.00         234.688         0.17           Damier Truck Finance Nerth America LLC         5.15         15.00.2028         USD         1.510.00.00         1.488.153         0.82           Damier Truck Finance Nerth America LLC         5.43         15.00.2028         USD         2.440.00         2.261.91         0.15           Digital Euro Finoe LC         2.63         15.00.2028         USD         2.70.000         9.494.72         0.55           Discovery Communitations LLC         2.63         15.06.2040         USD         2.70.000         1.84.244         0.08           DISH BeS Corp.         5.73         10.12.2028         USD         1.80.000         1.81.2427         0.20           DISH BeS Corp.         5.75         10.12.2028         USD         1.80.000         6.87.49         0.37           Ford Mord Credit Co. LLC         4.674         0.05.62.2028         CBP         960.000         6.87.49         0.38           Ford Mord Credit Co. LLC         4.674         0.05.62.2028         CBP         960.000         2.24.49         0.24           Conternal Motes Financial Co., Inc.         2.55         1.12.0227         USD         1.96.00							
Coty, Inc.         5.75 %         15.0028         EUR         315.0000         1.48.400         1.81           Damier Truck Finance Nerth America LLC         5.45 %         1.60.12028         USD         1.24.000         2.28.105         0.13           Dimitral Ingrishems Nerth America LLC         5.45 %         1.60.12028         USD         2.46.000         2.28.105         0.13           Dipita Eiror Finos LLC         2.26 %         1.60.12028         EUR         1.000.000         0.06.67         0.55           Disovery Communications LLC         2.30 %         1.50.5049         USD         122.000         153.419         0.08           Disi Hobis Corp.         5.77 %         10.12.2028         USD         120.000         153.419         0.08           Disi Hobis Corp.         5.77 %         10.12.0228         USD         12.000         153.419         0.28           Disi Hobis Corp.         1.77 %         15.11.2027         USD         1.28.000         665.000         0.67         0.03         0.37         7.03           Ford More Crede Co. LLC         6.66 %         0.00.00.00         656.200         0.67         0.71         General Morts Financia Co. Inc.         5.46 %         0.00.2026         GBP         260.000         656.20.	5 T.						
Damier Tuck, Finance North America LLC         6,16 %         1 610.000         22.61 %         0.82           Damier Tuck, Finance North America LLC         5,46 %         1 504.2027         USD         26.000         22.81 %         1 504.2027         USD         26.000         22.81 %         1 504.2024         EUR         20.000         286.16 %         0.012           Digita Euro, Financi LC         2.83 %         1 504.2024         EUR         20.000         158.41 %         0.01           Disk DBS Corp.         5.75 %         0.15.2028         USD         1500.000         488.72 %         0.08           DISK DBS Corp.         5.75 %         0.15.2028         USD         380.000         685.73 %         0.03           DISK DBS Corp.         5.75 %         0.15.2028         USD         380.000         685.78 %         0.03           DISK DBS Corp.         5.75 %         0.15.2028         USD         380.000         22.84 %         0.03           DisK Network Corp.         5.75 %         10.02.027         EUR         397.000         12.24 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         12.02 & 60.01         1							
Daimel Trock Finance Noth America LLC         6.49 %         200.2228         UBD         246.000         228.196         0.13           Dight Eur Finot LLC         2.63 %         15.04.2024         EUR         27.000         266.187         0.15           Dight Eur Finot LLC         2.50 %         2.08.044         GBP         271.000         94.972         0.15           Discovery Communications LLC         2.50 %         2.08.0244         GBP         271.000         94.972         0.15           DISH Nexork Corp.         11.75 %         15.11.2027         USD         950.00         481.279         0.28           CM Midstram Patries LP         4.95 %         10.51.2027         USD         950.00         665.789         0.03           Ford Mord Credit Co, LLC         4.84 %         06.30.2025         GBP         600.00         665.789         0.33           Ford Mord Credit Co, LLC         4.84 %         06.30.2025         GBP         600.00         665.789         0.34         0.37           Ford Mord Credit Co, LLC         6.84 %         06.30.2025         GBP         600.00         665.789         0.15         0.26           Control Credit Co, LLC         6.84 %         0.03.2025         GBP         600.00         7.6							
Dering ingregetense, Inc.         5,25 %         15.04.2027         USD         620.000         558.538         0.21           Digital Euro Finco LLC         2,03 %         15.04.2028         EUR         1.000.000         949.672         0.55           Decovery Communications LLC         2,00 %         10.01.2028         EUR         1.000.000         949.672         0.55           Decovery Communications LLC         3,01 %         10.02.2049         USD         21.200         0.63         0.01           Decovery Communications LLC         3,01 %         10.12.2027         USD         980.000         982.402         0.18           Pord Moor Credit Co. LLC         4,64 %         060.02.202         GBP         660.00         0.33         9.77         0.33         1.02         0.20         GBP         660.00         0.67.430         0.33         1.02         0.20         GBP         660.00         0.67.430         0.33         1.02         0.20         GBP         660.00         0.38         6.02         0.000         657.430         0.33         1.02         0.20         0.000         2.22.4468         0.01         0.20         0.01         0.24.468         0.01         0.22.01         0.01         0.01         0.01         0.01							
Digital Euro Finos LLC         2,23 %         16.04.2024         EUR         270.000         266.187         0.15           Diago Euro Finos LLC         2,90 %         20.05.2024         GBP         270.000         300.360         0.17           Discovery Communications LLC         5,00 %         10.56.2049         USD         190.000         193.244         0.08           DISH DES Carp.         5,75 %         0.12.2020         153.244         0.08           DISH DES Carp.         17.75 %         0.12.2021         USD         100.000         963.749         0.28           Ford Mord Credit Co, LLC         4,64 %         06.02.2022         USR         347.400         0.34         127         0.20           Ford Mord Credit Co, LLC         4,64 %         06.02.2026         GBP         900.000         965.825         0.56           General Motors Financial Co, Inc.         5,55 %         15.11.2027         USD         12.280.000         22.988         0.13           General Motors Financial Co, Inc.         5,45 %         15.02.026         GBP         360.000         24.24665         0.04         44.655         0.04         44.655         0.05         22.02224         USD         90.000         22.784         0.15         0.05							
Descovey Communications LLC         2,50 %         20.09.2024         GBP         27.000         300.800         0.17           DISH Descovey Communications LLC         5,75 %         10.12.2028         UISD         190.000         138.244         0.08           DISH Descoves Communications LLC         4,57 %         10.12.2028         UISD         300.000         328.442         0.18           EGM Midstream Partners LP         4,57 %         10.12.2028         UISD         300.000         328.422         0.19           Ford Midror Chelic C. LLC         4,67 %         0.03.8277         UISD         12.80.000         328.422         0.19           Ford Midror Chelic C. LLC         4,67 %         0.03.8277         UISD         12.80.000         328.452         0.06           General Midrors Financial Co., Inc.         8,55 %         15.10.2028         GBP         98.000         446.855         0.24           General Midrors Financial Co., Inc.         5,15 %         10.80.2028         GBP         186.000         228.986         0.13           General Midrors Financial Co., Inc.         5,15 %         10.80.2024         UISD         198.600         326.476         0.05           General Midrors Financial Co., Inc.         7,15 %         10.80.2028         UIS				EUR			
Decovery Communications LLC         5.30 %         15.02.249         USD         12.000         153.419         0.00           DISH DBS Corp.         17.75 %         15.11.2027         USD         550.00         442.77         0.28           EdM Mictarem Patteries LP         4.50 %         15.01.2027         USD         550.00         482.749         0.28           Ford Mior Credit C, LLC         6.86 %         05.00.2025         GBP         60.000         665.783         0.37           Ford Mior Credit C, LLC         6.86 %         05.00.2025         GBP         50.000         363.127         0.20           Ford Mior Credit C, LLC         6.86 %         05.00.2027         EUR         340.000         426.56         0.66           General Miors Financial Co, Inc.         5.15 %         15.03.2028         GBP         390.000         426.55         0.02           General Miors Financial Co, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         980.000         220.957         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         960.000         27.944         0.15           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         960.000         27.942         0.14<	Digital Euro Finco LLC	2,50 %	16.01.2026	EUR	1.000.000	949.672	0,55
DSH DSK Orp.         5.75 %         01.12.2028         USD         198.000         138.244         0.08           EOM Midsteam Partners LP         4.50 %         15.01.2029         USD         350.000         328.462         0.19           Ford Mord Credit Co. LLC         6.86 %         00.60.2028         GBP         660.000         657.430         0.37           Ford Mord Credit Co. LLC         4.87 %         00.80.2028         GBP         980.000         828.425         0.21           General Mutter Francial Co., Inc.         2.35 %         10.81.2027         USD         1.284.655         0.55           General Mutter Francial Co., Inc.         2.35 %         00.82.202         GBP         980.000         986.825         0.55           General Mutter Francial Co., Inc.         5.65 %         10.81.2024         USD         990.000         986.825         0.55           General Mutter Francial Co., Inc.         6.76 %         0.02.203         USD         990.000         986.825         0.15         0.04           General Mutter Francial Co., Inc.         7.13 %         07.02.203         USD         990.478         0.58           General Mutter Francial Co.         6.00 %         10.62.203         USD         300.000         227.744 <td< td=""><td>Discovery Communications LLC</td><td>2,50 %</td><td>20.09.2024</td><td>GBP</td><td>270.000</td><td>300.960</td><td>0,17</td></td<>	Discovery Communications LLC	2,50 %	20.09.2024	GBP	270.000	300.960	0,17
DISH Network Corp.         11,75         %         15.11.2027         USD         550,000         441.278         0.28           Eord Mictor Gredit Co, LLC         4,54         %         005.32025         GBP         660,000         665.789         0.39           Ford Mitor Credit Co, LLC         4,87 %         00.89.2027         EUR         347.00         343.127         0.20           General Motors Francial Co, Inc.         2,85 %         00.2025         GBP         980.000         985.825         0.53           General Motors Francial Co, Inc.         2,85 %         00.2025         GBP         980.000         986.825         0.53           General Motors Francial Co, Inc.         2,55 %         01.09.2026         GBP         980.000         986.426         0.24           General Motors Francial Co, Inc.         3,55 %         01.09.2026         GBP         980.000         926.478         0.05           Goldman Sachs Group, Inc.         7,13 %         07.08.2025         GBP         960.000         723.82         0.42           Goldman Sachs Group, Inc.         7,13 %         07.08.2025         GBP         960.000         723.82         0.42           Goldman Sachs Group, Inc.         7,13 %         07.08.2027         USD         <	Discovery Communications LLC	5,30 %	15.05.2049	USD	212.000	153.419	0,09
EOM Midsteam Parmers LP         4,50 %         15.01.2023         USD         38.000         328.462         0.138           Ford Mord Credit Co, LLC         6,86 %         06.06.2028         GBP         660.000         685.789         0.33           Ford Mord Credit Co, LLC         4,87 %         03.0327         ELR         347.000         343.127         0.20           GE HeattCara Technologies, Inc.         2,35 %         10.12.022         GLP         900.000         695.252         0.58           General Motter Francial Co, Inc.         5,15 %         10.2024         GLP         300.000         424.665         0.74           General Motter Francial Co, Inc.         5,15 %         10.2024         USD         106.000         723.328         0.22           GL Capradit IPGL P         173 %         0.70.222         GLP         106.000         723.328         0.22           Goldman Sacte Group, Inc.         725 %         10.02.023         USD         300.000         227.744         0.17           Hidors France Co.         6.00 %         10.2023         USD         500.000         172.328         0.24           Hidors France Co.         6.00 %         10.2023         USD         500.000         177.02         0.46	DISH DBS Corp.	5,75 %	01.12.2028	USD	190.000	138.294	0,08
Ford Motor Credit Co. LLC         64.64 %         06.03.2025         GBP         560.000         665.789         0.38           Ford Motor Credit Co. LLC         6.48 %         00.308.2027         EUR         547.000         343.127         0.20           Gentral Motors Financial Co., Inc.         5.65 %         15.11.227         LUS         1.288.600         222.466         0.15           General Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2026         GBP         250.000         265.825         0.05           General Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2026         GBP         250.000         242.946         0.13         0.108.2028         USD         175.000         280.6478         0.53         Gdatman Satta Group, Inc.         7.13 %         07.06.2028         GBP         166.000         223.15 %         0.13         0.108.2028         GBP         156.000         223.12 %         0.15         0.16         0.14         0.16         0.14         0.16         0.12         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.16         0.14         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15         0.15	DISH Network Corp.	11,75 %	15.11.2027	USD	505.000	481.279	0,28
Ford More Credit Co. LLC         6.86 %         05.06.2026         GBP         560.000         637.430         0.37           GE HealthCare Technologies, Inc.         5.65 %         15.11.2027         USD         124.665         0.71           General Motors Financial Co., Inc.         2.35 %         03.02.0225         GBP         950.000         229.986         0.13           General Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.03.2026         GBP         950.000         229.986         0.13           General Motors Financial Co., Inc.         5.46 %         98.03.2024         USD         977.000         161.225         0.009           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2024         USD         987.000         230.637         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         4.26 %         2.04.2020         USD         980.000         227.794         0.17           Hidors Financia Co., Inc.         6.00 %         10.04.2030         USD         300.000         227.794         0.17           Goldman Sachs Group, Inc.         7.25 %         10.02.2031         USD         300.000         227.794         0.17           Hidors Financial Co., Inc.         7.36 %         10.12.2031         USD         300.000         277.133 <td></td> <td></td> <td>15.01.2029</td> <td></td> <td>390.000</td> <td>328.462</td> <td>0,19</td>			15.01.2029		390.000	328.462	0,19
Ford Motor Credit Co., LC         487 %         03.08.2027         EUR         93.47.00         93.41.27         0.20           General Motors Financial Co., Inc.         2.35 %         03.09.2026         GBP         900.00         9268.825         0.76           General Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2026         GBP         980.00         12.24.660         0.74           General Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2028         GBP         175.00         161.25         0.09           Gulfam Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2028         GBP         198.00         923.087         0.13           Golfama Sachs Group, Inc.         7.43 %         23.01.2026         GBP         198.00         230.637         0.13           Golfama Sachs Group, Inc.         7.45 %         24.02.2028         USD         300.00         223.74         0.15           Hilcorp Energy (LPMHicorp Finance Co.         6.00 %         15.04.2030         USD         500.00         172.13 0.42           Hulfs International Buck         7.25 %         15.04.2031         USD         576.00         172.13 0.42           International Buckinese Machines Corp.         3.38 %         0.02.2027         EUR         733.00         721.13 0.42 </td <td></td> <td></td> <td>06.03.2025</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>			06.03.2025				
GE HeakhCare Technologies, Inc.         5.65 %         11.12.02         USD         12.98.000         12.24.665         0.76           General Motors Financial Co., Inc.         0.85 %         25.02.2026         EUR         250.000         229.986         0.13           Genoral Motors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2026         GBP         380.000         444.655         0.24           Genoral Motors Financial Co., Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         960.000         72.328         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         960.000         232.926         0.14           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         960.000         232.926         0.14           Goldman Sachs Group, Inc.         7.24 %         2.40.42.028         USD         380.000         297.764         0.17           Halcorp Energy (LPHAirop Finance Co.         6.00 %         10.02.2031         USD         500.000         178.500         166.00         1.72.000         165.167         0.10           Hartsman International LLC         4.25 %         10.10.228         USD         520.000         777.00         0.22           Hartsmotore Corp.         3.38							
General Motors Financial Co., Inc.         2.38 %         03.02.2026         GBP         900.000         965.825         0.56           General Motors Financial Co., Inc.         5.16 %         15.08.2026         GBP         380.000         404.655         0.20           General Motors Financial Co., Inc.         5.16 %         15.08.2026         GBP         196.000         236.37         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         196.000         235.37         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         4.28 %         29.01.2026         GBP         196.000         237.328         0.42           Goldman Sachs Group, Inc., VIR         2.44 %         24.02.2028         USD         300.000         297.764         0.15           Hidorp Energy ILPHicorp Finance Co.         6.00 %         15.04.2030         USD         500.000         786.860         0.42           Hustrantional Ltd.         7.28 %         10.04.2025         EUR         805.000         787.702         0.46           Hiteart Gommunications, Inc.         4.76 %         10.50.2027         USD         805.000         787.328         0.51           Korta Mater Zoods Co.         4.17 %         01.06.2027         USP         800.000							
General Motors Financial Co., Inc.         0.85 %         22.02.2026         EUR         220.986         0.13           General Motors Financial Co., Inc.         5.40 %         08.02.2026         USD         97.000         906.478         0.03           General Motors Financial Co., Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         96.000         72.3928         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         66.000         72.3928         0.42           Goldman Sachs Group, Inc.         7.25 %         24.04.2028         USD         350.000         297.764         0.17           Hidorp Energy ILPHIcorp Finance Co.         6.00 %         10.42.203         USD         350.000         477.293         0.24           Hidors Energy ILPHIcorp Finance Co.         6.00 %         10.42.203         USD         550.000         376.85         0.22           International Busines Machines Corp.         3.38 %         06.02.2027         USD         800.000         376.36         0.22           International Busines Machines Corp.         3.38 %         06.02.2027         USD         800.000         376.36         0.22           International Busines Machines Corp.         3.38 %         01.02.205         USD <t< td=""><td>=</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>	=						
General Hutors Financial Co., Inc.         5.15 %         15.08.2028         GBP         380.000         404.655         0.09           General Funding LC         3.35 %         01.02.2024         USD         175.000         296.478         0.03           Gulz Capital LPGLP Financing II, Inc.         3.35 %         01.02.2024         USD         390.000         252.784         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         4.26 %         240.2028         USD         300.000         252.774         0.13           Goldman Sachs Group, Inc.         4.26 %         240.2028         USD         300.000         297.764         0.15           Hitory Energy I LPHicory Finance Co.         6.00 %         116.42.030         USD         500.000         176.500         165.167         0.10           Humsmain International Buccore         72.8 %         10.10.2027         USD         500.000         376.385         0.22           Iterrational Business Machines Corp.         3.8 %         0.60.22027         USD         400.000         359.341         0.24           Iterrational Business Machines Corp.         3.8 %         0.10.2027         USD         400.000         359.341         0.24           Iterrational Business Machines Corp.         5.0 %         0.10.82007 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
Clencore Funding LLC         5.40 %         08.05.228         USD         977.00         101.255         0.00           Goldma Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GBP         169.000         230.837         0.13           Goldman Sachs Group, Inc., V/R         2.64 %         24.02.2028         GBP         650.000         273.928         0.42           Goldman Sachs Group, Inc., V/R         2.64 %         24.02.2028         USD         350.000         297.764         0.17           Hidorp Energy ILPMitorp Finance Co.         6.00 %         16.02.4031         USD         550.000         417.233         0.24           Hildorp Energy ILPMitorp Finance Co.         6.00 %         16.02.2021         USD         550.000         786.860         0.46           HeardCommunications, Inc.         4.75 %         16.01.2023         USD         855.000         797.702         0.46           KFC Holing Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of         America LLC         4.25 %         01.06.2027         USD         400.000         399.341         0.21           Krat Heinz Foods Co.         6.50 %         01.06.2027         USD         400.000         399.341         0.21           Krat Heinz Foods Co.         5.50 %         01.06.2027 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
CLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.         3.35 %         01.08.2024         USD         987.000         906.478         0.53           Coldman Sachs Group, Inc.         4.25 %         29.01.2026         GBP         496.000         723.928         0.42           Coldman Sachs Group, Inc.         4.26 %         24.02.2028         USD         300.000         252.794         0.15           Hilcorp Energy ILP/Hiltorp Finance Co.         6.00 %         10.42.2030         USD         500.000         247.764         0.17           Hutermanional LLC         7.25 %         15.06.2030         USD         500.00         376.836         0.22           Hutermanional LLC         4.75 %         15.01.2028         USD         520.00         376.836         0.22           International Business Machines Corp.         5.30 %         16.05.2027         USD         895.000         797.702         0.46           International Business Machines Corp.         5.00 %         10.06.2027         USD         400.000         398.341         0.21           Krath Heinz Foods Co         4.75 %         01.06.2027         USD         400.00         99.066         0.66           Krath Heinz Foods Co         4.76 %         01.06.2027         USD         400.00         0							
Coldman Sachs Group, Inc.         7.13 %         07.08.2025         GPP         196.000         220.637         0.13           Goldman Sachs Group, Inc., VR         2.64 %         240.22028         USD         300.000         252.734         0.15           Hicorp Energy ILPHilotop Finance Co.         6.00 %         16.04.2030         USD         550.000         417.293         0.24           Hildorp Energy ILPHilotop Finance Co.         6.00 %         16.04.2030         USD         550.000         417.293         0.24           Hulls International LLC         7.25 %         15.06.2030         USD         570.000         156.167         0.10           Huntsman International Sumes Machines Corp.         3.33 %         0.062.2027         EUR         733.000         727.133         0.42           ICVIA, Inc.         4.75 %         15.06.2027         USD         797.702         0.40           KCC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of							
Coldman Sache Group, Inc., V/R         4.25 %         29.01.2026         GBP         650.000         723.928         0.42           Hicorp Energy ILP/Hicorp Finance Co.         6.00 %         15.04.2030         USD         330.000         292.774         0.15           Hicorp Energy ILP/Hicorp Finance Co.         6.00 %         15.04.2030         USD         550.000         417.283         0.24           Hub International LLC         4.25 %         0.104.2025         EUR         805.000         778.348         0.22           International Business Machines Corp.         3.38 %         0.602.2027         EUR         73.000         721.133         0.42           IQVIA, Inc.         5.00 %         10.62.0227         USD         985.000         797.702         0.48           KrC Hoding Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of							
Caldman Sache Group, Inc., ViR         2,44 %         24.02.2028         USD         300.000         252.794         0.15           Hilcorp Energy ILP/Hicorp Finance Co.         6,00 %         01.02.2031         USD         550.000         417.293         0.24           Hulb International LuC         4,25 %         01.04.2025         EUR         805.000         786.869         0.46           HeartCommunications, Inc.         4,75 %         15.01.2028         EUR         805.000         777.13         0.42           IdVIA Inc.         5,00 %         165.05.2027         EUR         733.000         727.133         0.42           IdVIA Inc.         4,75 %         01.06.2027         EUR         730.000         797.702         0.46           KFC Holding CJ./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of         4,75 %         01.07.2027         GBP         800.000         878.296         0.51           Kratl Heniz Foods Co.         6,88 %         26.01.4039         USD         700.000         280.841         0.16           Kratl Heniz Foods Co.         6,88 %         20.01.02265         GBP         680.000         738.016         0.43           Metrapolitan Life Global Funding I         4,13 %         0.20.2025         GBP         680.000         738.016<							
Hicorg Energy ILP/Hicorg Finance Co.         6.00 %         15.04.2000         JSD.         350.000         297.764         0.17           Hilder Energy ILP/Hicorg Finance Co.         6.00 %         01.02.2031         USD         550.000         1417.233         0.24           HUB International LLC         7.25 %         15.06.2030         USD         175.000         778.680         0.46           Hursman International LLC         4.75 %         15.01.2028         USD         520.000         376.385         0.22           International Business Machines Corp.         3.38 %         0.602.2027         USD         485.000         771.70         0.44           International Business Machines Corp.         3.38 %         0.602.2027         USD         400.000         359.341         0.21           Kraf Heirz Foods Co.         4.13 %         0.107.2027         GBP         800.000         878.296         0.51           Kraf Heirz Foods Co.         4.55 %         0.106.2027         USD         400.000         878.296         0.51           Kraf Heirz Foods Co.         4.13 %         0.107.2027         GBP         800.000         224.200         208.618         0.12           Low's Cos., Inc.         4.88 %         15.04.2029         USD							
Hicory Energy LLP/Hicory Finance Co.         6.00 %         01.02 2031         USD         500.000         417.233         0.24           Hulb International LLC         4.25 %         01.04 2025         EUR         805.000         778.690         0.46           International Business Machines Corp.         3.38 %         05.02 2027         EUR         805.000         778.680         0.42           International Business Machines Corp.         3.38 %         05.02 2027         EUR         805.000         779.702         0.46           KFC Holding Co./Pizza Hul Holdings LLC/Taco Bell of         4.75 %         01.06 2027         USD         400.000         878.286         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         4.13 %         01.07 2027         USD         800.000         878.286         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         280.12039         USD         100.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         4.80 %         01.04 2026         USD         672.000         623.072         0.36           Mertage Homes Corp.         3.88 %         15.04 2028         USD         800.000         244.00         0.314         40.44           Metropolitan Life Global Funding I         4.33 %         0.20 2025	- · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·						
HUB International LLd.         7,25 %         15.06 2030         USD         175.000         165.167         0.10           Hutarsman International LLC         4,25 %         15.01 2028         USD         520.000         376.365         0.22           International Business Machines Corp.         3,38 %         06.02.2027         USD         855.000         787.305         771.133         0.42           KFC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC         4,75 %         01.06.2027         USD         400.000         359.341         0.21           Kraft Heinz Foods Co.         4,13 %         01.07.2027         GBP         800.000         878.296         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         5,60 %         01.06.2050         USD         242.000         298.618         0.12           Lowe's Cos., Inc.         4,80 %         01.04.2029         USD         300.000         244.018         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         4,13 %         22.09.225         GBP         658.00         738.016         0.43           Morgan Stanley, ViR         4,81 %         25.10.2028         EUR         238.00         237.289         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
Huntsmain International LLC         4.25 %         01.04.2025         EUR         805.000         738.690         0.46           HeardCommunications, Inc.         3.38 %         06.02.2027         EUR         733.000         721.133         0.42           IQVIA, Inc.         5.00 %         15.05.2027         USD         895.000         797.702         0.46           KFC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of              0.42           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         26.01.2039         USD         400.000         376.326         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         26.01.2039         USD         140.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         15.04.2028         USD         672.000         623.072         0.36           Mertage Homes Corp.         3.88 %         15.04.2028         USD         30.000         244.018         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         4.03 %         12.10.2028         EUR         280.000         573.50         0.22           Morgan Stanley, ViR         2.48 %         12.10.2028         EUR         550.000         567.500         0.33							
iHearCommunications, Inc.         475 %         15.01.2028         USD         520.000         376.385         0.22           International Business Machines Corp.         5.00 %         15.05.2027         USD         895.000         721.133         0.42           IQVIA, Inc.         5.00 %         15.05.2027         USD         895.000         721.133         0.42           America LLC         4.75 %         0.10.6.2027         USD         400.000         878.296         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         4.13 %         0.10.7.027         GBP         800.000         878.296         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         2.601.2039         USD         100.000         99.660         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         5.50 %         0.104.2026         USD         672.000         623.072         0.36           Metrapolitan Life Gobal Funding I         4.13 %         0.202265         GBP         668.00         738.016         0.43           Metrapolitan Life Gobal Funding I         1.63 %         12.10.2028         USD         802.000         567.604         0.39           Morgan Stanley, ViR         4.81 %         25.10.2028         EUR         500.000         507.500         0.29 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
International Business Machines Corp.         3,38 %         06.02.2027         EUR         733.000         721.133         0.42           IQVIA, Inc.         50.0 %         15.05.2027         USD         895.000         797.702         0.46           KrC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of         4.75 %         01.06.2027         GBP         800.000         878.296         0.51           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         28.01.2039         USD         100.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         5.50 %         01.06.2050         USD         42.000         208.618         0.12           Lowe's Cos., Inc.         4.80 %         01.04.2026         USD         672.000         623.072         0.36           Metragolitan Life Global Funding I         4.13 %         02.092.025         GBP         658.000         738.016         0.43           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.102.028         EUR         238.000         237.289         0.14           Morgan Stanley, V/R         2.48 %         21.01.2028         EUR         50.000         557.50         0.29           Morgan Stanley, V/R         5.79 %         18.11.2033         GBP         10.000         11.1227 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
IQVA, Inc.         5,00 %         15.05 2027         USD         895.000         797.702         0.46           KFC Holding CL/Rizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC         4,75 %         01.06.2027         USD         400.000         359.341         0.21           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         26.01.2039         USD         100.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         6.88 %         26.01.2039         USD         100.000         224.000         228.618         0.12           Lowe's Cos., Inc.         4.80 %         01.04.2026         USD         672.000         623.072         0.36           Metropolitan Life Global Funding I         4.13 %         02.09.205         GBP         656.000         738.016         0.43           Metropolitan Life Global Funding I         4.03 %         05.04.2028         EUR         238.000         237.289         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028         USD         802.000         676.004         0.39           Morgan Stanley, V/R         2.48 %         2.10.12028         USD         802.000         507.500         0.29           Morgan Stanley, V/R         5.50 %         10.14.2029         USD							
KFC Holding Cu/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC         4,75 %         01.06.2027         USD         400.000         359.341         0,21           Kraft Heinz Foods Co.         6,88 %         26.01.2039         USD         100.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         5,50 %         01.06.2050         USD         242.000         208.618         0.12           Lowe's Cos., Inc.         4,80 %         01.04.2026         USD         672.000         623.072         0.36           Mertage Homes Corp.         3.88 %         15.04.2029         USD         600.000         244.018         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         4.13 %         02.09.2025         GBP         655.000         738.016         0.43           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028         EUR         238.000         237.289         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028         EUR         50.000         556.98         0.33           Morgan Stanley, V/R         4.81 %         25.10.2028         EUR         50.000         367.371         0.21           Nery Anstanes Scorov Corp.         5.0 %         0.10.42029         USD         400.000							
America LLĈ         4,75 %         01.06.2027         USD         400.000         359.341         0.21           Kraft Heinz Foods Co.         6,88 %         26.01.2039         USD         100.000         99.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         6,88 %         26.01.2039         USD         140.000         29.060         0.06           Kraft Heinz Foods Co.         4,80 %         01.04.2026         USD         672.000         208.618         0.12           Lowe's Cos., Inc.         4,80 %         01.04.2026         USD         300.000         244.018         0.44           Metropolitan Life Global Funding I         4,13 %         02.09.2025         GBP         658.000         738.016         0.43           Metropolitan Life Global Funding I         4,03 %         02.04.2028         EUR         238.000         237.289         0.14           Morgan Stanley, V/R         2,48 %         21.01.2028         USD         800.000         676.504         0.39           Morgan Stanley, V/R         2,69 %         10.04.2029         USD         400.000         367.371         0.21           New York Life Global Funding         1,50 %         15.07.2027         GBP         1.049.000         165.4987         0.65 <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
Kraft Heinz Foods Co.6.88 % 5.50 %26.01.203USD100.00099.0600,06Kraft Heinz Foods Co.5.50 %01.06.2050USD242.000208.6180,12Lowe's Cos., Inc.4.80 %01.04.2028USD300.000244.0180,13Metropolitan Life Global Funding I4.13 %02.09.2025GBP658.000738.0160.43Metropolitan Life Global Funding I1.63 %12.10.2028EUR238.000237.2890,14Morgan Stanley, V/R2.48 %21.01.2028USD800.000517.5000.29Morgan Stanley, V/R4.81 %25.10.2028EUR500.000507.5000.29Norgan Stanley, V/R5.79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Atlees Escrow Corp.9.50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding3.63 %01.0231USD77.0097.260,55New York Life Global Funding3.63 %15.07.2027GBP1.04.000370.4880,22NFP Corp.8.50 %01.04.2028USD670.000597.6790,35New York Life Global Funding3.63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9.63 %15.02.2031USD249.000374.2550,22NRG Energy, Inc.3.63 %15.01.2028USD439.000354.150,23OneMain Finance Corp.9.06 %		4,75 %	01.06.2027	USD	400.000	359.341	0,21
Kraft Heinz Foods Co.5,50 %01.06.2050USD242.000208.6180,12Lowe's Cos., Inc.4,80 %01.04.2028USD672.000623.0720,38Meritage Homes Corp.3,88 %15.04.2029USD300.000244.0180,14Metropolitan Life Global Funding I4,13 %02.09.2025GBP658.000738.0160.43Metropolitan Life Global Funding I1,63 %12.10.2028GBP550.000526.9960,31Morgan Stanley, V/R2,48 %21.01.2028USD802.000676.0040,39Morgan Stanley, V/R4,81 %25.10.2028EUR500.000507.5000,22Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Alleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,63 %15.07.2027GBP1.040.000367.3710,21New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,3350,22OneMain Finance Corp.9,60 %15.01.2029USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.9,60 %15.01.2029USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.4,50 %0.022USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.4,50 % <td>Kraft Heinz Foods Co.</td> <td>4,13 %</td> <td>01.07.2027</td> <td>GBP</td> <td>800.000</td> <td>878.296</td> <td>0,51</td>	Kraft Heinz Foods Co.	4,13 %	01.07.2027	GBP	800.000	878.296	0,51
Lowe's Cos., Inc.4,80 %01.04.2026USD672.000623.0720,36Meritage Homes Corp.3,88 %15.04.2029USD300.000244.0180,14Metropolitan Life Global Funding I4,00 %05.04.2028EUR238.000237.2890,14Metropolitan Life Global Funding I1,63 %12.10.2028USD802.000576.0040,33Morgan Stanley, V/R2,48 %21.01.2028USD802.000507.5000.29Morgan Stanley, V/R4,81 %25.10.2028EUR500.000507.5000.29Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000367.3710,07NCR Alteos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2031USD359.000339.9530,20NFP Corp.8,50 %01.04.2029USD440.000437.1350,22New York Life Global Funding I5,00 %15.02.2031USD359.000339.9530,20NFG Corp.4,50 %01.04.2029USD449.000423.1350,22Orget Corp.4,50 %0.65.2028USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.4,50 %01.02.2031USD449.000374.2550,22Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028 <t< td=""><td>Kraft Heinz Foods Co.</td><td>6,88 %</td><td>26.01.2039</td><td>USD</td><td>100.000</td><td>99.060</td><td>0,06</td></t<>	Kraft Heinz Foods Co.	6,88 %	26.01.2039	USD	100.000	99.060	0,06
Meritage Homes Corp.         3.88 %         15.04 / 2029         USD         300.000         244.018         0.14           Metropolitan Life Global Funding I         4.13 %         02.09.2025         GBP         658.000         738.016         0.43           Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028         GBP         550.000         526.986         0.31           Morgan Stanley, V/R         2.48 %         21.01.2028         EUR         500.000         507.500         0.29           Morgan Stanley, V/R         4.81 %         25.10.2028         EUR         500.000         507.500         0.29           Morgan Stanley, V/R         5.79 %         18.11.2033         GBP         10.0.000         111.927         0.07           NCR Atlees Escrow Corp.         9.50 %         01.04.2029         USD         400.000         367.371         0.21           New York Life Global Funding         1.50 %         15.07.2027         GBP         1.049.000         1.054.987         0.61           New York Life Global Funding         3.63 %         09.01.42020         USD         670.000         597.679         0.35           NFP Corp.         8.50 %         01.10.2031         USD         350.000         339.953         0.2	Kraft Heinz Foods Co.	5,50 %	01.06.2050	USD	242.000	208.618	0,12
Metropolitan Life Global Funding I         4,13 %         02.09.2025         GBP         658.000         738.016         0,43           Metropolitan Life Global Funding I         4,00 %         05.04.2028         EUR         238.000         237.289         0,14           Metropolitan Life Global Funding I         16,33 %         12.10.2028         GBP         550.000         526.986         0,33           Morgan Stanley, V/R         2,48 %         21.01.2028         EUR         500.000         507.500         0,29           Morgan Stanley, V/R         4,81 %         25.10.2028         EUR         500.000         507.500         0,29           Morgan Stanley, V/R         9,50 %         01.04.2029         USD         400.000         367.371         0,21           New York Life Global Funding         1,50 %         15.07.2027         GBP         1.049.000         367.371         0,21           New York Life Global Funding         1,60 %         10.42.026         USD         670.000         597.679         0,35           NFP Corp.         8,50 %         01.10.2031         USD         359.000         339.953         0,22           OneMain Finance Corp.         9,63 %         15.01.2029         USD         449.000         423.135         <							
Metropolitan Life Global Funding I4,00 %05.04.2028EUR238.000237.2890,14Metropolitan Life Global Funding I1,63 %12.10.2028GBP550.000526.9860,31Morgan Stanley, V/R2,48 %21.01.2028USD802.000676.0040,39Morgan Stanley, V/R4,81 %25.10.2028EUR500.000507.5000,29Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Atleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.11.030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,33NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD210.000150.7140,90Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.01.2029USD449.000423.1350,22Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,22Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2029USD440.000347.2550,22Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2029USD460.00441.530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %0.10.2030USD17.00059.860,03Spectrum Brands, Inc.3,88 % <td>5</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>	5						
Metropolitan Life Global Funding I         1.63 %         12.10.2028         GBP         550.000         526.986         0,31           Morgan Stanley, V/R         2,48 %         21.01.2028         USD         802.000         676.004         0,39           Morgan Stanley, V/R         4,81 %         25.10.2028         USD         802.000         677.500         0,29           Morgan Stanley, V/R         5,79 %         18.11.2033         GBP         100.000         111.927         0,07           NCR Atleos Escrow Corp.         9,50 %         01.04.2029         USD         400.000         367.371         0,21           New York Life Global Funding         1,60 %         15.07.2027         GBP         1.049.000         1.054.987         0,61           New York Life Global Funding         3,63 %         09.01.2030         EUR         971.000         947.266         0,55           NRG Energy, Inc.         3,63 %         15.02.2031         USD         359.090         339.953         0,22           OneMain Finance Corp.         9,63 %         15.11.2028         EUR         370.000         370.458         0,22           Oracle Corp.         9,00 %         16.01.2029         USD         449.000         423.135         0,23							
Morgan Stanley, V/R2,48 %21.01.2028USD802.000676.0040,39Morgan Stanley, V/R4,81 %25.10.2028EUR500.000507.5000.29Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Atleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20NRG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,99Olympus Water U.S. Holding Corp.9,60 %15.01.2029USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Pacific Life Global Funding ILC7,86 %15.01.2029USD440.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.01.2029USD740.00059.8670,03Spectrum Brands, Inc.9,00 %15.01.2029USD740.00059.8690,13Spectrum Brands, Inc.9,00 %01.10.2031USD315.000241.7130,14Stellantis Finance U.S., Inc.9,00 % <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></td<>							
Morgan Stanley, V/R4,81 %25.10.2028EUR500.000507.5000,29Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Atleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.11.2028EUR370.000370.4580,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC5,88 %01.07.2029USD420.000374.2550,22Permian Resources Operating LLC5,00 %01.10.2032USD460.0044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2032USD135.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %01.10.2032USD70.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2032USD135.000241.7130,14T-Mobile USA, Inc.5,00 %							
Morgan Stanley, V/R5,79 %18.11.2033GBP100.000111.9270,07NCR Atleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,99Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.01.2029USD449.000423.1350,25Oracle Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000374.580,25Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000374.550,23Permian Resources Operating LLC5,88 %01.07.2029USD440.000443.1330,03Spectrum Brands, Inc.7,70 %15.03.2031USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.7,00 %01.10.2031USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2031USD114.0001.286.3830,75Star Parent, Inc.5,00 %01.10.2031USD135.000241.7130,14Star Parent, Inc.5,00 %01.10.2030USD135.00070.14960,41Star Parent, Inc.5,63 %12.01.2028USD750.00							
NCR Atleos Escrow Corp.9,50 %01.04.2029USD400.000367.3710,21New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20NRG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.11.2028EUR370.000370.4580,22Oracle Corp.9,63 %15.01.2029USD449.000423.1350,23Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC7,75 %15.03.2031USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2029USD70.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.5,63 %12.01.2028USD137.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.5,63 %12.01.2028USD137.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.5,63 %12.01.2028USD1385.000241.7130,14T-Mobile USA, Inc.5,63 %12.01.2028USD <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
New York Life Global Funding1,50 %15.07.2027GBP1.049.0001.054.9870,61New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20NRG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.11.2028EUR370.000370.4580,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,25Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2032USD420.000374.2550,22Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2032USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2029USD315.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %01.10.2030USD197.000188.2410,11Stellantis Finance U.S., Inc.5,63 %12.01.2028USD750.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.5,63 %12.01.2028USD1.385.0001.270.4940,74United Rentals North America, Inc.							
New York Life Global Funding3,63 %09.01.2030EUR971.000947.2660,55Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20Olympus Water U.S. Holding Corp.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,25Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2032USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.7,75 %15.03.2031USD315.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %01.10.2029USD135.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.5,63 %12.01.2028USD750.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.5,63 %12.01.2028USD1.385.0001.270.4940,74United Rentals North America, Inc.4,95 %15.03.2027USD455.000418.2390,24United Health Group, Inc.4,25 %15.01.2029USD1.311.0001.179.5100,85	•						
Newell Brands, Inc.4,70 %01.04.2026USD670.000597.6790,35NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20NRG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.01.2029USD449.000423.1350,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,25Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC5,88 %01.07.2029USD420.000374.2550,22Permian Resources Operating LLC7,75 %15.03.2031USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.7,75 %15.03.2031USD315.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %10.10.2030USD197.000188.2410,11Stellantis Finance U.S., Inc.5,63 %12.01.2028USD750.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.4,95 %15.03.2027USD482.00077.5050,50United Rentals North America, Inc.4,95 %15.03.2027USD455.000418.2390,24United Health Group, Inc.4,25 %15.01.2029USD455.000418.2390,24	5						
NFP Corp.8,50 %01.10.2031USD359.000339.9530,20NRG Energy, Inc.3,63 %15.02.2031USD210.000150.7140,09Olympus Water U.S. Holding Corp.9,63 %15.11.2028EUR370.000370.4580,22OneMain Finance Corp.9,00 %15.01.2029USD449.000423.1350,25Oracle Corp.4,50 %06.05.2028USD439.000395.4150,23Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC5,88 %01.07.2029USD460.00243.1350,22Ritchie Bros Holdings, Inc.7,75 %15.03.2031USD268.000250.2900,15Ritchie Bros Holdings, Inc.5,00 %01.10.2029USD70.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.3,88 %15.03.2031USD315.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %01.10.2028USD175.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.5,63 %12.01.2028USD1.385.0001.270.4940,74Transocean Aquila Ltd.8,00 %30.09.2028USD450.00077.5050,05United Renals North America, Inc.5,50 %15.05.2027USD455.00071.4960,24UnitedHealth Group, Inc.4,25 %15.01.2029USD1.311.0001.179.5100,68							
NRG Energy, Inc.         3,63 %         15.02.2031         USD         210.000         150.714         0,09           Olympus Water U.S. Holding Corp.         9,63 %         15.11.2028         EUR         370.000         370.458         0,22           OneMain Finance Corp.         9,00 %         15.01.2029         USD         449.000         423.135         0,23           Oracle Corp.         4,50 %         06.05.2028         USD         439.000         395.415         0,23           Pacific Life Global Funding II         5,00 %         12.01.2028         GBP         1.144.000         1.286.333         0,75           Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         460.00         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         750.000         701.496         0,41           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         750.000         701.496         0,41							
Olympus Water U.S. Holding Corp.         9,63 %         15.11.2028         EUR         370.000         370.458         0,22           OneMain Finance Corp.         9,00 %         15.01.2029         USD         449.000         423.135         0,25           Oracle Corp.         4,50 %         06.05.2028         USD         439.000         395.415         0,23           Pacific Life Global Funding II         5,00 %         12.01.2028         GBP         1.144.000         1.286.383         0,75           Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         420.000         374.255         0,22           Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         710.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
OneMain Finance Corp.         9,00 %         15.01.2029         USD         449.000         423.135         0,25           Oracle Corp.         4,50 %         06.05.2028         USD         439.000         395.415         0,23           Pacific Life Global Funding II         5,00 %         12.01.2028         GBP         1.144.000         1.286.383         0,75           Permian Resources Operating LLC         5,88 %         01.07.2029         USD         420.000         374.255         0,22           Permian Resources Operating LLC         7,88 %         01.07.2032         USD         268.000         250.290         0,15           Ritchie Bros Holdings, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Ster Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,7							
Oracle Corp.         4,50 %         06.05.2028         USD         439.000         395.415         0,23           Pacific Life Global Funding II         5,00 %         12.01.2028         GBP         1.144.000         1.286.383         0,75           Permian Resources Operating LLC         5,88 %         01.07.2029         USD         420.000         374.255         0,22           Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         268.000         250.290         0,15           Ritchie Bros Holdings, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2028         USD         750.000         701.496         0,411           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,411           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         382.000         77.555         0,55 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>							
Pacific Life Global Funding II5,00 %12.01.2028GBP1.144.0001.286.3830,75Permian Resources Operating LLC5,88 %01.07.2029USD420.000374.2550,22Permian Resources Operating LLC7,00 %15.01.2032USD268.000250.2900,15Ritchie Bros Holdings, Inc.7,75 %15.03.2031USD46.00044.1530,03Spectrum Brands, Inc.5,00 %01.10.2029USD70.00059.9860,03Spectrum Brands, Inc.3,88 %15.03.2031USD315.000241.7130,14Star Parent, Inc.9,00 %01.10.2030USD197.000188.2410,11Stellantis Finance U.S., Inc.5,63 %12.01.2028USD750.000701.4960,41T-Mobile USA, Inc.4,95 %15.03.2028USD1.280.00077.5050,05United Rentals North America, Inc.5,50 %15.05.2027USD455.000418.2390,24United Health Group, Inc.4,25 %15.01.2029USD1.311.0001.179.5100,68	•						
Permian Resources Operating LLC         5,88 %         01.07.2029         USD         420.000         374.255         0,22           Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         268.000         250.290         0,15           Ritchie Bros Holdings, Inc.         7,75 %         15.01.2032         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2029         USD         750.000         701.496         0,41           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         750.000         701.496         0,41           Star Parent, Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05							
Permian Resources Operating LLC         7,00 %         15.01.2032         USD         268.000         250.290         0,15           Ritchie Bros Holdings, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           UnitedHealth Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></t<>							
Ritchie Bros Holdings, Inc.         7,75 %         15.03.2031         USD         46.000         44.153         0,03           Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2028         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         82.000         77.505         0,05           United Health Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
Spectrum Brands, Inc.         5,00 %         01.10.2029         USD         70.000         59.986         0,03           Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Ster Iantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           UnitedHealth Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
Spectrum Brands, Inc.         3,88 %         15.03.2031         USD         315.000         241.713         0,14           Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           UnitedHealth Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68	6						
Star Parent, Inc.         9,00 %         01.10.2030         USD         197.000         188.241         0,11           Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           UnitedHealth Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
Stellantis Finance U.S., Inc.         5,63 %         12.01.2028         USD         750.000         701.496         0,41           T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,55           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           UnitedHealth Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
T-Mobile USA, Inc.         4,95 %         15.03.2028         USD         1.385.000         1.270.494         0,74           Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           United Health Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
Transocean Aquila Ltd.         8,00 %         30.09.2028         USD         82.000         77.505         0,05           United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           United Health Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
United Rentals North America, Inc.         5,50 %         15.05.2027         USD         455.000         418.239         0,24           United Health Group, Inc.         4,25 %         15.01.2029         USD         1.311.000         1.179.510         0,68							
UnitedHealth Group, Inc. 4,25 % 15.01.2029 USD 1.311.000 1.179.510 0,68							
	Venture Global Calcasieu Pass LLC	3,88 %	15.08.2029	USD	335.000	266.575	0,15

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Venture Global Calcasieu Pass LLC	6,25 %	15.01.2030	USD	175.000	157.819	0,09
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4,13 %	15.08.2031	USD	135.000	104.774	0,06
Venture Global LNG, Inc.	8,38 %	01.06.2031	USD	285.000	264.854	0,15
Warnermedia Holdings, Inc.	3,76 %	15.03.2027	USD	406.000	354.225	0,21
ZF North America Capital, Inc.	6,88 %	14.04.2028	USD	596.000	551.317	0,32
					44.760.837	25,97
ANLEIHEN GESAMT					168.229.257	97,61
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT Sonstige übertragbare Wertpapiere	AN EINEM AND	EREN GEREGELTE	N MARKT NOTIER	RTE	168.229.257	97,61
ANLEIHEN						
Deutschland Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7,50 %	15.05.2023	EUR	100.000	100.362	0,06
ANLEIHEN GESAMT					100.362	0,06
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE GESAMT					100.362	0,06
ANLAGEN INSGESAMT					168.329.619	97,67
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)					4.004.804	2,33
GESAMTES NETTOVERMÖGEN				_	172.334.423	100,00

### DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Ge	winn aus Devisenterminkor	trakten			
EUR	54.460.404	GBP	(46.911.266)	24.10.2023	419.720
EUR	728.195	GBP	(631.510)	31.10.2023	889
EUR	285.025	GBP	(247.181)	31.10.2023	348
EUR	864.208	USD	(912.047)	24.10.2023	3.513
USD	812.592	EUR	(760.895)	24.10.2023	5.946
ZAR	340.180	EUR	(16.952)	24.10.2023	57
ZAR	342.890	EUR	(17.090)	24.10.2023	54
Nicht realisierter Ve	rlust aus Devisenterminkon	trakten			
EUR	13.932.570	USD	(15.213.781)	24.10.2023	(424.630)
EUR	654.925	USD	(715.327)	24.10.2023	(124.000) (20.127)
EUR	11.593.477	USD	(12.678.151)	24.10.2023	(370.857)
EUR	11.103.375	USD	(12.150.835)	24.10.2023	(363.332)
EUR	742.961	ZAR	(15.136.875)	24.10.2023	(13.887)
GBP	106.977.646	EUR	(123.411.063)	31.10.2023	(205.537)
GBP	42.190.021	EUR	(48.671.060)	31.10.2023	(81.060)
JPY	949.296	EUR	(6.065)	31.10.2023	(36)
JPY	5.081	EUR	(32)	31.10.2023	(0)
USD	10.564	EUR	(10.053)	31.10.2023	(86)
USD	370	EUR	(351)	31.10.2023	(3)
Summe des nicht re	alisierten Verlusts aus Devi	senterminkontrakten	l		(1.479.555)

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
Australia Treasury Note 10YR	AUD	(90)	15.12.2023	(6.143.140)	164.545
EURO-BOBL Future Dec23	EUR	(33)	07.12.2023	(3.819.750)	36.960
EURO-BTP Future	EUR	(13)	07.12.2023	(1.426.490)	53.170
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	(64)	07.12.2023	(8.232.960)	28.011
German Federal Republic Bond 2YR	EUR	70	07.12.2023	7.349.300	11.638
German Federal Republic Bond 30YR	EUR	(9)	07.12.2023	(1.101.240)	75.420
Japan Government Bond 10YR	JPY	(38)	13.12.2023	(34.865.568)	287.093
US Treasury Note 2YR	USD	(80)	29.12.2023	(15.317.001)	42.495
US Treasury Ultra 30YR	USD	(32)	19.12.2023	(3.587.249)	263.991
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten insgesamt				(67.144.098)	963.323
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
Australia Treasury Note 3YR	AUD	278	15.12.2023	17.851.664	(134.649)
EURO-BOBL Future Dec23	EUR	49	07.12.2023	5.671.750	(55.370)
UK Long Gilt Future	GBP	(45)	27.12.2023	(4.884.735)	(33.780)
US Treasury Note 10YR	USD	120	19.12.2023	12.247.933	(260.562)
US Treasury Ultra 10YR	USD	42	19.12.2023	4.425.620	(134.504)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten insgesamt				35.312.232	(618.865)

### SWAPKONTRAKTE

Währung	Nennbetrag	Zahlung/Einnahme	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Credit Defa	ult Swaps	-			
EUR	4.400.000	1,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Index	20.12.2027	(59.315)	(81.579)
EUR	18.000.000	1,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Index	20.12.2027	(242.652)	(39.556)
EUR	1.973.332	5,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Crossover Index	20.12.2027	(117.685)	(151.939)
EUR	888.000	5,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Crossover Index	20.12.2027	(52.958)	(30.092)
EUR	4.242.667	5,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Crossover Index	20.06.2028	(222.592)	(86.787)
USD	13.300.000	1,000 % / Markit Markit CDX IG Index	20.12.2027	(173.009)	21.647
USD	11.695.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.06.2027	(336.664)	198.167
USD	1.000.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.12.2027	(23.447)	(1.389)
USD	3.600.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.12.2027	(84.409)	57.630
USD	4.400.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.06.2028	(88.782)	(45.035)
USD	4.900.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.06.2028	(98.871)	28.152
Credit Defa	ult Swaps insge	esamt		(1.500.384)	(130.781)
Inflationssv	vaps				
GBP	2.900.000	4,122 % / UK Retail Prices Index	15.08.2028	(318)	(318)
GBP	2.900.000	UK Retail Prices Index / 3,909 %	15.08.2033	10.704	10.705

USD 3.34 Summe Inflationss AUD 5.00 AUD 13.33 AUD 18.34 EUR 2.85 EUR 2.85 EUR 2.55 EUR 2.55 EUR 6.00 GBP 11.00 GBP 11.00 GBP 4.66 GBP 5.10	.300.000 .300.000 sswaps .000.000 .300.000 .300.000 .820.000 .820.000	2,360 % / US CPI Urban Consumers NSA Index US CPI Urban Consumers NSA Index / 2,360 % 3,683 % / BBSW 6M 3,683 % / BBSW 6M	01.05.2028 01.05.2028 13.05.2032	277.037 (322.166) (34.743)	277.037 (325.781) <b>(38.357)</b>
Summe Inflationsst           Zinsswaps           AUD         5.00           AUD         13.31           AUD         18.33           EUR         2.82           EUR         2.83           EUR         2.83           EUR         2.66           EUR         2.56           EUR         2.57           EUR         6.00           GBP         1.03           GBP         1.04           GBP         1.04           GBP         5.10	5.000.000 5.300.000 5.300.000 5.300.000 5.820.000	3,683 % / BBSW 6M 3,683 % / BBSW 6M		( )	, ,
Zinsswaps AUD 5.0( AUD 13.3( AUD 18.30) EUR 2.80 EUR 2.80 EUR 2.80 EUR 2.80 EUR 2.80 EUR 2.50 EUR 6.00 GBP 1.00 GBP 11.00 GBP 11.00 GBP 4.60 GBP 5.10	.000.000 .300.000 .300.000 .820.000	3,683 % / BBSW 6M	13.05.2032	(34.743)	(38.357)
AUD         5.00           AUD         13.30           AUD         18.31           EUR         2.83           EUR         2.83           EUR         2.63           EUR         2.66           EUR         2.60           EUR         2.50           EUR         6.00           GBP         1.00           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.300.000 .300.000 .820.000	3,683 % / BBSW 6M	13.05.2032		
AUD         13.30           AUD         18.30           EUR         2.83           EUR         2.83           EUR         2.83           EUR         2.61           EUR         2.56           EUR         2.56           EUR         2.50           GBP         1.03           GBP         1.04           GBP         1.04           GBP         5.10           GBP         5.10	.300.000 .300.000 .820.000	3,683 % / BBSW 6M	13.05.2032		
AUD         18.30           EUR         2.83           EUR         2.83           EUR         2.63           EUR         2.63           EUR         2.50           EUR         2.50           EUR         6.00           GBP         1.00           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.300.000 .820.000			217.424	98.203
EUR         2.8           EUR         2.8           EUR         2.6           EUR         2.5           EUR         2.5           EUR         6.00           GBP         1.00           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.820.000	DDOW/ ON / O OOD O/	13.05.2032	578.349	113.413
EUR         2.8           EUR         6.60           EUR         2.50           EUR         6.00           GBP         1.00           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10		BBSW 6M / 3,683 %	13.05.2032	(795.773)	(795.773)
EUR         6.60           EUR         2.50           EUR         2.51           EUR         6.00           GBP         1.00           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.820.000	1,450 % / EURIBOR 6M	09.07.2048	845.503	845.503
EUR 2.50 EUR 2.50 EUR 6.00 GBP 1.00 GBP 11.00 GBP 4.60 GBP 5.10		EURIBOR 3M / 1,408 %	09.07.2048	(898.824)	(898.824)
EUR         2.50           EUR         6.00           GBP         1.03           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.600.000	EURIBOR 6M / 3,052 %	15.08.2032	(156.116)	(156.116)
EUR         6.00           GBP         1.03           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.500.000	EURIBOR 6M / 3,220 %	20.09.2028	(20.386)	(24.474)
GBP         1.03           GBP         11.00           GBP         4.60           GBP         5.10	.500.000	EURIBOR 6M / 3,220 %	20.09.2028	(20.386)	(19.228)
GBP 11.00 GBP 4.60 GBP 5.10	.000.000	EURIBOR 6M / 3,242 %	15.08.2032	(42.785)	(42.785)
GBP 4.60 GBP 5.10	.050.000	3,790 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	03.11.2032	53.670	56.837
GBP 5.10	.000.000	4,300 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	22.03.2025	210.879	(1.194)
	.600.000	4,420 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	03.11.2024	47.040	371
	.100.000	5,441 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	20.07.2025	(25.625)	(45.125)
GBP 1.0	.050.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 3,790 %	03.11.2032	(53.670)	(12.362)
GBP 21.90	.900.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 4,300 %	22.03.2025	(419.841)	(428.702)
GBP 4.60	.600.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 4,420 %	03.11.2024	(47.040)	(46.986)
GBP 13.50	.500.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 5,600 %	20.07.2025	114.180	111.756
ILS 5.30	.300.000	3,136 % / TELBOR 3M	15.03.2028	42.969	(24.735)
ILS 12.00	.000.000	3,656 % / TELBOR 3M	20.09.2028	87.749	109.272
	.100.000	3,748 % / TELBOR 3M	15.03.2028	9.004	3.131
ILS 17.10	.100.000	TELBOR 3M / 3,136 %	15.03.2028	(138.634)	(138.634)
	.000.000	TELBOR 3M / 3,656 %	20.09.2028	(146.248)	(146.248)
	.000.000	TELBOR 3M / 3,656 %	20.09.2028	(146.248)	(110.144
	.000.000	Mexiko - 28-Tages-Interbankenzinssatz / 8,351 %	13.09.2028	(225.987)	(225.987
	.000.000	4,533 % / WIBOR 6M	20.09.2028	(2.731)	(2.731
	.000.000	4,533 % / WIBOR 6M	20.09.2028	(2.731)	(17.938
	.600.000	8,070 % / LIBOR 3M	15.03.2028	70.739	70.739
	.000.000	8,210 % / LIBOR 3M	21.06.2028	57.494	(18.127)
	.500.000	8,210 % / LIBOR 3M	21.06.2028	86.242	53.613
	.500.000	LIBOR 3M / 8,210 %	21.06.2028	(143.736)	(128.379)
	.600.000	LIBOR 3M / 8,520 %	15.03.2028	(24.150)	(132.390)
Summe Zinsswaps	ps			(889.669)	(1.954.044)

### Nicht realisierter Verlust aus Swaps

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, BNP Paribas S.A., Canadian Imperial Bank of Commerce, HSBC Bank Plc., JP Morgan Securities Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Kontrahenten bei Swaps waren JP Morgan Securities Plc., Merrill Lynch International. und Morgan Stanley & Co. International Plc.

(4.179.358)

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Absolute Return Bond Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen <sup>zum 30.</sup> September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Vertrieb und Großhandel	0,03
Wohnungsbauunternehmen	0,14
Metalle und Bergbau	0,28
Forstprodukte und Papier	0,32
Landwirtschaft	0,32
Halbleiter	0,41
Maschinenbau	0,44
Software	0,45
Transport und Verkehr	0,46
Luftfahrt und Verteidigung	0,51
Haushaltswaren	0,52
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	0,59
Computer	0,63
Pipelines	0,63
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	0,84
Werbung	0,85
Baustoffe	0,83
Biotechnologie	0,92 0,95
Verpackungen und Container	
Arzneimittel	0,98
Bau- und Ingenieurswesen	0,99
Einzelhandel	0,99
Internet	1,04
Fluggesellschaften	1,34
Medien	1,41
Chemikalien	1,52
Supranational	1,55
Nahrungsmittel und Getränke	1,95
Gewerbliche Dienstleistungen	1,98
Öl und Gas	2,06
Freizeit und Tourismus	2,26
Wasserwirtschaft	2,81
Gesundheitswesen	2,92
Elektrische Geräte	3,93
Staatliche Emittenten	3,97
Versicherungen	4,62
Telekommunikation	4,90
Immobilien	5,27
Automobilzulieferer	9,10
Finanzdienstleistungen	32,68
Anlagen insgesamt	98,34
Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,66
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Global Convertible Bond

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erzielte die Anteilsklasse A - EUR eine Rendite von 0,6 %, während die Rendite des Thomson Reuters Global Focus Customised TR Index 3,1 % betrug. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Das Portfolio blieb hinter der Benchmark zurück. Die Underperformance war weitgehend auf die starke Performance der aus dem Portfolio ausgeschlossenen Wandelanleihen (Safran, Posco) zurückzuführen. Zu den Verlustbringern zählten untergewichtete Positionen in Wayfair und Rivian (Cash-Burning/Verluste, Finanzierungsbedarf in einem Umfeld höherer Renditen), die aus dem ausgewogenen Index auf hohem Niveau ausgeschlossen wurden, dann aber aufgrund von Bedenken hinsichtlich der Aussichten in einem Umfeld längerfristig höherer Zinsen einbrachen. Das Fehlen des Infrastruktursoftware-Anbieters MongoDB und von Royal Caribbean Cruiselines wirkte sich negativ aus, während die Beteiligung an dem in Schwierigkeiten geratenen Pflegeheimbetreiber Orpea ebenfalls abträglich war. Diese Verluste wurden jedoch durch die Auswahl anderer Wandelanleihen innerhalb des Sektors ausgeglichen. Die Positionierung im Kommunikationsdienstleistungssektor beeinträchtigte die relative Performance am stärksten. was auf Cellnex (Rückkauf von Wandelanleihen, Zeitpunkt der Löschung aus dem Index) und die Untergewichtung von Ubisoft (Bedenken hinsichtlich der Unternehmensführung) zurückzuführen war. Die Positionierung im IT-Bereich, in dem BE Semiconductor einen starken Beitrag zur Performance leistete, und im Finanzsektor waren die positivsten Faktoren für die relative Rendite. Unsere Anlagestrategie war weiterhin vorsichtig, da eine Phase "längerfristig höherer" Zinssätze immer wahrscheinlicher wurde. Tief im Geld befindliche Wandelanleihen von Siemens, Booking, BE Semiconductor, On Semiconductor, Insulet, EDF und Sika wurden unter anderem reduziert. Darüber hinaus wurden höher verzinste Wandelanleihen, die ein unattraktives Risiko-Ertrags-Verhältnis (nach Absicherungskosten) aufwiesen, in höherwertige Alternativen umgeschichtet, die ein attraktiveres Gleichgewicht zwischen Rendite und Wandelprämie boten. Angesichts unsicherer Wirtschaftsaussichten werden wir unsere qualitätsorientierte Anlagestrategie beibehalten.

#### Marktrückblick

Wandelanleihen erhielten Unterstützung durch eine Erholung der Aktienmärkte und der Kreditspreads von Unternehmensanleihen, selbst wenn die Zinsen weiter stiegen, da sich das Vertrauen in die Aussichten von einem sehr niedrigen Niveau ausgehend in der zweiten Hälfte des Jahres 2022 verbesserte. Dennoch belasteten die Bedenken hinsichtlich einer weiteren Straffung der Geldpolitik aufgrund der anhaltend hohen Inflation und der robusten US-Wirtschaft die Märkte im gesamten Berichtszeitraum. Die US-Notenbank (Fed) beendete ihr Programm zur quantitativen Lockerung, verringerte ihre Anleihebestände und hob die Zinssätze sechsmal an, so dass sie Ende September 2023 bei 5,50 % lagen. Dadurch übertrafen die Zinssätze die sinkenden Inflationsraten. Die Verbraucherpreisinflation in den USA ging vor dem Hintergrund sinkender Energiekosten von 7,7 % im Oktober 2022 auf 3,7 % im September 2023 zurück. Die Fed dämpfte jedoch die Erwartungen der Anleger auf eine schnelle Zinswende bei einem weiteren Rückgang der Inflation und wies darauf hin, dass die Zinssätze möglicherweise "länger höher" bleiben müssen, bis der Lohndruck nachlässt. Diese Verschiebung führte zu einer steileren Renditekurve, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit in Erwartung einer lockereren Geldpolitik stiegen, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Selbst als die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads. Dies spiegelte die relative Widerstandsfähigkeit des Wirtschaftswachstums und solide Erträge wider. Bis Ende September belief sich die Emission von Wandelanleihen im Jahr 2023 auf 67 Mrd. USD und lag damit geringfügig unter dem durchschnittlichen Niveau vor dem Anstieg in den Jahren 2020 und 2021.

#### Ausblick

Wir bleiben bei unserem vorsichtigen Ausblick. Obwohl die Inflation tendenziell gesunken ist, dürften die Zinssätze noch länger höher bleiben, da die US-Notenbank ihre Aussichten für das Wirtschaftswachstum angehoben und ihre Erwartungen für die Arbeitslosenquote angesichts einer robusten Wirtschaft gesenkt hat. Die Aussichten für die Eurozone haben sich eingetrübt, da die Wirtschaftsindikatoren auf eine Schrumpfung hindeuten. Unterstützung wird jedoch von einem Anstieg der verfügbaren Einkommen aufgrund der sinkenden Inflation und einer Umkehrung der Korrektur der Lagerbestände im verarbeitenden Gewerbe Anfang nächsten Jahres kommen. Trotz der anhaltenden Krise auf dem chinesischen Immobilienmarkt hat die chinesische Wirtschaft positiv auf die staatlichen Konjunkturmaßnahmen reagiert. Vor dem Hintergrund der Ungewissheit bezüglich die Auswirkungen der Geldpolitik und der geopolitischen Risiken verfolgen wir weiterhin eine vorsichtige Strategie, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige, ausgewogene Wandelanleihen konzentrieren und versuchen, von der günstigen Risiko-Ertrags-Dynamik zu profitieren, die diese Anlageklasse in volatilen Märkten bietet.

#### Anna Eijking

Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Convertible Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE O WERTPAPIERE	DDER AN EINEM AND	EREN GEREGELTE				
			IN MARKT NOTE	RTE UBERTRAGBA	RE	
ANLEIHEN						
Australien	/					
Flight Centre Travel Group Ltd.	2,50 %	17.11.2027	AUD	200.000	136.162	0,46
Belgien						
Groupe Bruxelles Lambert NV	2,13 %	29.11.2025	EUR	100.000	96.064	0,33
Bermuda						
Jazz Investments I Ltd.	2,00 %	15.06.2026	USD	450.000	434.431	1,47
NCL Corp. Ltd	1,13 %	15.02.2027	USD	250.000	195.995	0,67
Deltie des lauresternies de					630.426	2,14
Britische Jungferninseln ANLLIAN Capital Ltd.	0,00 %	05.02.2025	EUR	200.000	213.142	0,72
	0,00 %	00.02.2020	Lon	200.000	210.142	0,72
Kaimaninseln Bosideng International Holdings Ltd.	1,00 %	17.12.2024	USD	200.000	187.835	0,63
Cathay Pacific Finance III Ltd.	2,75 %	05.02.2024	HKD	2.000.000	247.483	0,84
CIMC Enric Holdings Ltd.	0,00 %	30.11.2026	HKD	2.000.000	229.948	0,78
Kingsoft Corp. Ltd	0,63 %	29.04.2025	HKD	2.000.000	252.762	0,86
Trip.com Group Ltd.	1,50 %	01.07.2027	USD	200.000	213.166	0,72
					1.131.194	3,83
Frankreich						
Accor SA	0,70 %	07.12.2027	EUR	317.592	302.138	1,02
Atos SE	0,00 %	06.11.2024	EUR	100.000	84.089	0,28
BNP Paribas SA	0,00 %	13.05.2025	EUR	400.000	472.428	1,60
Carrefour SA	0,00 %	27.03.2024	USD	200.000	183.617	0,62
Edenred	0,00 %	14.06.2028	EUR	375.782	384.914	1,31
Elis SA	2,25 %	22.09.2029	EUR	300.000	354.462	1,20
Neoen SA Neoen SA	2,00 % 2,88 %	02.06.2025 14.09.2027	EUR EUR	87.780 100.000	84.594 91.404	0,29 0,31
Nexity SA	0,88 %	19.04.2028	EUR	95.696	61.643	0,31
Orpar SA	0,00 %	20.06.2024	EUR	100.000	100.411	0,34
Schneider Electric SE	0,00 %	15.06.2026	EUR	476.388	486.151	1,65
Selena Sarl	0,00 %	25.06.2025	EUR	200.000	187.786	0,64
SOITEC	0,00 %	01.10.2025	EUR	305.095	329.594	1,12
SPIE SA	2,00 %	17.01.2028	EUR	400.000	408.100	1,38
Wendel SE	2,63 %	27.03.2026	EUR	100.000	96.813	0,33
					3.628.144	12,30
Deutschland	1 00 0/	~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~	5115	500.000	000.050	4.00
Delivery Hero SE	1,00 %	23.01.2027	EUR	500.000	388.950	1,32
Delivery Hero SE Deutsche Lufthansa AG	3,25 %	21.02.2030	EUR EUR	400.000	354.296	1,20
Deutsche Post AG	2,00 % 0,05 %	17.11.2025 30.06.2025	EUR	300.000 400.000	307.587 376.836	1,04 1,28
Duerr AG	0,75 %	15.01.2026	EUR	100.000	98.063	0,33
LEG Immobilien SE	0,88 %	01.09.2025	EUR	200.000	185.866	0,63
LEG Immobilien SE	0,40 %	30.06.2028	EUR	200.000	158.362	0,54
RAG-Stiftung	0,00 %	17.06.2026	EUR	500.000	455.715	1,54
RAG-Stiftung	1,88 %	16.11.2029	EUR	500.000	501.085	1,70
Rheinmetall AG	1,88 %	07.02.2028	EUR	500.000	507.670	1,72
Rheinmetall AG	2,25 %	07.02.2030	EUR	200.000	205.394	0,70
Israel					3.539.824	12,00
CyberArk Software Ltd.	0,00 %	15.11.2024	USD	110.000	119.981	0,41
Italien						
DiaSorin SpA	0,00 %	05.05.2028	EUR	300.000	232.422	0,79
Eni SpA, V/R	0,00 %	14.09.2030	EUR	300.000	303.186	1,03
Nexi SpA	1,75 %	24.04.2027	EUR	300.000	259.056	0,88
Pirelli & C SpA	0,00 %	22.12.2025	EUR	300.000	286.971	0,97
Prysmian SpA	0,00 %	02.02.2026	EUR	400.000	426.540	1,45
Saipem SpA	2,88 %	11.09.2029	EUR	200.000	204.746	0,69
					1.712.921	5,81
Japan	0.00.0/	10 10 0001	IDV/	20,000,000	047 400	A 7 4
ANA Holdings, Inc.	0,00 %	10.12.2031	JPY	30.000.000	217.130	0,74
CyberAgent, Inc.	0,00 % 0,00 %	16.11.2029 16.07.2024	JPY JPY	20.000.000 20.000.000	121.216 138.651	0,41 0,47
DMG Mori Co. Ltd	0,00 %	10.07.2024	JET	20.000.000	100.001	0,47
DMG Mori Co. Ltd Kvoritsu Maintenance Co. Ltd	0.00 %	29.01.2026	IPY	10 000 000	86 149	0.20
DMG Mori Co. Ltd Kyoritsu Maintenance Co. Ltd Nippon Steel Corp.	0,00 % 0,00 %	29.01.2026 05.10.2026	JPY JPY	10.000.000 30.000.000	86.149 270.530	0,29 0,92

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Rohm Co. Ltd	0,00 %	05.12.2024	JPY	20.000.000	131.098	0,44
SBI Holdings, Inc.	0,00 %	25.07.2025	JPY	30.000.000	222.458	0,75
SCREEN Holdings Co. Ltd.	0,00 %	11.06.2025	JPY	20.000.000	160.974	0,55
Yaoko Co. Ltd	0,00 %	20.06.2024	JPY	10.000.000	81.121	0,27
					1.493.142	5,06
Jersey PHP Finance Jersey No. 2 Ltd.	2,88 %	15.07.2025	GBP	130.000	138.002	0,47
Korea				·		<u>.</u>
LG Chem Ltd.	1,25 %	18.07.2028	USD	200.000	184.948	0,63
LG Chem Ltd.	1,60 %	18.07.2030	USD	200.000	181.977	0,61
SK Hynix, Inc.	1,75 %	11.04.2030	USD	200.000	229.186	0,78
Luxemburg					596.111	2,02
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg SCA	0,00 %	15.03.2028	EUR	200.000	203.428	0,69
Lagfin SCA	3,50 %	08.06.2028	EUR	300.000	290.868	0,99
Mexiko					494.296	1,68
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	2,63 %	24.02.2026	EUR	400.000	395.928	1,34
Niederlande						
America Movil BV	0,00 %	02.03.2024	EUR	800.000	816.360	2,77
Basic-Fit NV	1,50 %	17.06.2028	EUR	200.000	174.736	0,59
BE Semiconductor Industries NV	1,88 %	06.04.2029	EUR	200.000	221.936	0,75
ELM BV for Swiss Re Ltd.	3,25 %	13.06.2024	USD	400.000	422.468	1,43
Merrill Lynch BV	0,00 %	30.01.2026	EUR	300.000	306.342	1,04
QIAGEN NV	1,00 %	13.11.2024	USD	600.000	572.707	1,94
STMicroelectronics NV	0,00 %	04.08.2027	USD	1.000.000	1.049.285	3,56
Neuropaland					3.563.834	12,08
Neuseeland Xero Investments Ltd.	0,00 %	02.12.2025	USD	250.000	207.185	0,70
Panama						
Carnival Corp.	5,75 %	01.12.2027	USD	100.000	126.267	0,43
Singapur Singapore Airlines Ltd.	1,63 %	03.12.2025	SGD	250.000	214.387	0,73
Spanien						
Cellnex Telecom SA	0,50 %	05.07.2028	EUR	900.000	892.917	3,03
Iberdrola Finanzas SA	0,80 %	07.12.2027	EUR	400.000	383.352	1,30
International Consolidated Airlines Group SA	1,13 %	18.05.2028	EUR	500.000	413.985	1,40
Schweden					1.690.254	5,73
Geely Sweden Financials Holding AB	0,00 %	19.06.2024	EUR	100.000	143.887	0,49
Taiwan Hon Hai Precision Industry Co. Ltd	0,00 %	05.08.2026	USD	300.000	237.640	0,81
Vereinigtes Königreich	0,00 %	05.08.2028	03D	300.000	237.040	0,61
Barclays Bank PLC	0.00 %	24.01.2025	EUR	200.000	200.088	0,68
Capital & Counties Properties PLC	2,00 %	30.03.2026	GBP	100.000	101.441	0,35
JET2 PLC	1,63 %	10.06.2026	GBP	300.000	313.406	1,06
WH Smith PLC	1,63 %	07.05.2026	GBP	200.000	201.470	0,68
					816.405	2,77
USA	0.40.0/	01 05 2025		215 000	254 004	4 4 0
Akamai Technologies, Inc.	0,13 %	01.05.2025	USD	315.000	351.884	1,19
Akamai Technologies, Inc.	0,38 %	01.09.2027	USD	130.000	128.136	0,43
American Water Capital Corp. Axon Enterprise, Inc.	3,63 % 0,50 %	15.06.2026 15.12.2027	USD USD	100.000 135.000	91.291 136.370	0,31 0,46
Axon Enterprise, Inc. Bentley Systems, Inc.	0,50 % 0,13 %	15.01.2027	USD	135.000	105.659	0,46
Biomarin Pharmaceutical, Inc.	1,25 %	15.05.2027	USD	110.000	103.289	0,36
Bloom Energy Corp.	3,00 %	01.06.2028	USD	160.000	151.738	0,55
Cable One, Inc.	0,00 %	15.03.2026	USD	125.000	96.901	0,31
Chefs' Warehouse, Inc.	2,38 %	15.12.2028	USD	140.000	107.406	0,33
Citigroup Global Markets Holdings, Inc.	0,00 %	26.02.2026	HKD	2.000.000	219.436	0,30
Datadog, Inc.	0,00 %	15.06.2025	USD	135.000	150.286	0,74
Dexcom, Inc.	0,13 %	15.11.2025	USD	205.000	182.787	0,51
Dexcom, Inc.	0,23 %	15.05.2028	USD	2205.000	184.333	0,62
Dropbox, Inc.	0,38 %	01.03.2028	USD	145.000	129.187	0,63
Enphase Energy, Inc.	0,00 %	01.03.2028	USD	165.000	129.187	0,44
Etsy, Inc.	0,13 %	01.09.2027	USD	175.000	132.508	0,44
Licy, inc.	0,13 %	01.03.2027	030	173.000	132.300	0,40

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Exact Sciences Corp.	0,38 %	15.03.2027	USD	290.000	248.651	0,84
Fisker, Inc.	2,50 %	15.09.2026	USD	190.000	91.530	0,31
Ford Motor Co.	0,00 %	15.03.2026	USD	230.000	213.023	0,72
Guess?, Inc.	2,00 %	15.04.2024	USD	155.000	150.197	0,51
Insulet Corp.	0,38 %	01.09.2026	USD	110.000	101.950	0,35
Integra LifeSciences Holdings Corp.	0,50 %	15.08.2025	USD	145.000	124.980	0,42
Ionis Pharmaceuticals, Inc.	0,00 %	01.04.2026	USD	100.000	92.605	0,31
Itron, Inc.	0,00 %	15.03.2026	USD	150.000	122.156	0,41
JPMorgan Chase Bank NA	0,00 % 0.00 %	18.02.2024	EUR EUR	200.000	200.576	0,68
JPMorgan Chase Bank NA JPMorgan Chase Financial Co. LLC	0,00 %	10.06.2024 14.01.2025	EUR	200.000 300.000	205.460 321.183	0,70 1,09
JPMorgan Chase Financial Co. LLC	0,00 %	29.04.2025	EUR	600.000	630.240	2,14
LCI Industries	1,13 %	15.05.2026	USD	145.000	128.212	0,44
Liberty Broadband Corp.	3,13 %	31.03.2053	USD	190.000	186.869	0,63
Lumentum Holdings, Inc.	0,50 %	15.12.2026	USD	160.000	127.595	0,43
Marriott Vacations Worldwide Corp.	0,00 %	15.01.2026	USD	170.000	141.679	0,48
Marriott Vacations Worldwide Corp.	3,25 %	15.12.2027	USD	35.000	28.875	0,10
Microchip Technology, Inc.	0,13 %	15.11.2024	USD	115.000	114.581	0,39
NextEra Energy Partners LP	0,00 %	15.11.2025	USD	200.000	158.481	0,54
ON Semiconductor Corp.	0,50 %	01.03.2029	USD	330.000	343.655	1,17
Post Holdings, Inc.	2,50 %	15.08.2027	USD	85.000	79.836	0,27
Shift4 Payments, Inc.	0,00 %	15.12.2025	USD	185.000	172.947	0,59
SmileDirectClub, Inc.	0,00 %	01.02.2026	USD	160.000	5.208	0,02
SolarEdge Technologies, Inc.	0,00 %	15.09.2025	USD	100.000	86.305	0,29
Splunk, Inc.	1,13 %	15.09.2025	USD	130.000	132.106	0,45
Summit Hotel Properties, Inc.	1,50 %	15.02.2026	USD	140.000	111.492	0,38
Sunnova Energy International, Inc.	0,25 %	01.12.2026	USD	100.000	61.039	0,21
Tetra Tech, Inc.	2,25 %	15.08.2028	USD	115.000	107.113	0,36
Tyler Technologies, Inc.	0,25 %	15.03.2026	USD	190.000	174.403	0,59
Vail Resorts, Inc.	0,00 %	01.01.2026	USD	155.000	129.721	0,44
Wolfspeed, Inc.	1,88 %	01.12.2029	USD	275.000	169.800	0,58
Ziff Davis, Inc.	1,75 %	01.11.2026	USD	140.000	122.159	0,41
Zillow Group, Inc.	1,38 %	01.09.2026	USD	115.000	129.482	0,44
Zscaler, Inc.	0,13 %	01.07.2025	USD	140.000	159.111	0,54
Vietnam					7.773.716	26,36
Vinpearl JSC	3,25 %	21.09.2026	USD	200.000	160.933	0,54
ANLEIHEN GESAMT					29.259.845	99,21
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODEI ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	R AN EINEM AND	EREN GEREGELTE	EN MARKT NOTIE	RTE	29.259.845	99,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere						
ANLEIHEN						
Japan						
Aica Kogyo Co. Ltd.	0,00 %	22.04.2027	JPY	20.000.000	137.967	0,47
USA MP Materials Corp.	0,25 %	01.04.2026	USD	150.000	121.584	0,41
ANLEIHEN GESAMT					259.551	0,88
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE GESAMT					259.551	0,88
ANLAGEN INSGESAMT					29.519.396	100,09
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)					(28.130)	(0,09)
GESAMTES NETTOVERMÖGEN					29.491.266	100,00

### DERIVATE

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
icht realisierter Gew	inn aus Devisenterminkon	trakten		·	
AUD	3.000	EUR	(1.813)	06.10.2023	16
EUR	138	CHF	(134)	31.10.2023	C
EUR	2.865	CHF	(2.764)	31.10.2023	Ę
EUR	22.784	CHF	(21.985)	31.10.2023	44
EUR	179.082	GBP	(154.000)	06.10.2023	1.566
EUR	387.988	JPY	(61.000.000)	06.10.2023	1.755
GBP	9.000	EUR	(10.343)	06.10.2023	31
HKD	150.000	EUR	(18.046)	06.10.2023	43
SGD	7.000	EUR	(4.822)	06.10.2023	23
USD	30.000	EUR	(27.921)	06.10.2023	410
USD	20.000	EUR	(18.730)	06.10.2023	158
USD	25.000	EUR	(23.430)	06.10.2023	180
USD	25.000	EUR	(23.457)	06.10.2023	153
USD	230.000	EUR	(216.351)	06.10.2023	860
USD	70.000	EUR	(66.013)	06.10.2023	95
umme des nicht real	isierten Gewinns aus Devi	senterminkontrakten			5.339
icht realisierter Verlu	ust aus Devisenterminkont	rakten			
CHF	8.396	EUR	(8.689)	31.10.2023	(5
CHF	173.811	EUR	(179.888)	31.10.2023	(107
CHF	1.382.479	EUR	(1.430.814)	31.10.2023	(849
EUR	31.724	AUD	(53.000)	06.10.2023	(584
EUR	224.028	HKD	(1.880.000)	06.10.2023	(2.687
EUR	52.036	SGD	(76.000)	06.10.2023	(557
EUR	2.783.399	USD	(2.985.000)	06.10.2023	(35.623
JPY	4.000.000	EUR	(25.338)	06.10.2023	(11
USD	702.478	EUR	(668.471)	31.10.2023	(5.736
USD	24.968	EUR	(23.721)	31.10.2023	(166
umme des nicht real	isierten Verlusts aus Devi	senterminkontrakten	·		(46.325

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, Canadian Imperial Bank of Commerce, HSBC Bank Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Convertible Bond Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Wasserwirtschaft	0,31
Umweltschutz	0,36
Wohnungsbauunternehmen	0,44
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	0,46
Biotechnologie	0,66
Medien	0,96
Transport und Verkehr	1,28
Elektrische Geräte	1,30
Maschinenbau	1,31
Metalle und Bergbau	1,33
Versicherungen	1,43
Computer	1,66
Chemikalien	1,71
Hotelgewerbe	1,85
Energie	2,08
Luftfahrt und Verteidigung	2,42
Automobilzulieferer	2,49
Öl und Gas	2,50
Einzelhandel	2,54
Immobilien	2,58
Arzneimittel	2,72
Telekommunikation	2,77
Nahrungsmittel und Getränke	2,86
Elektrische Komponenten und Zubehör	3,10
Freizeit und Tourismus	3,17
Kohle	3,24
Gewerbliche Dienstleistungen	4,20
Gesundheitswesen	4,36
Bau- und Ingenieurswesen	4,41
Internet	4,95
Software	5,53
Fluggesellschaften	5,81
Halbleiter	10,56
Finanzdienstleistungen	12,74
Anlagen insgesamt	100,09
Sonstige Aktiva / (Passiva)	(0,09)
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Global Smaller Cap Equity

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A USD eine Rendite von 16,9 %. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI World Small Cap NR Index eine Rendite von 14,0 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in US-Dollar ausgedrückt.

Das Portfolio erzielte im Berichtszeitraum eine deutliche Outperformance. Centrica leistete einen starken Beitrag, da das Unternehmen weiterhin von strukturellen Veränderungen auf dem britischen Strommarkt profitiert und einen Ausbau der Gasspeicher angekündigt hat. Melrose Industries (eine britische Holdinggesellschaft, die sich der Rettung von Industrieunternehmen verschrieben hat) profitierte von der Ausgliederung ihres Automobilgeschäfts. Focus Financial Partners, ein US-amerikanisches Vermögensverwaltungsunternehmen, hat ein Übernahmeangebot aus dem Private-Equity-Bereich erhalten. Ein Highlight war die gute Titelauswahl bei US-Banken angesichts der Mini-Bankenkrise, die auf den Zusammenbruch der SVB folgte. Der größte Verlustbringer war Direct Marketing MiX, das im ersten Quartal einen Umsatz- und Gewinnrückgang im Vergleich zum Vorjahr verzeichnete, der auf einen Rückgang der Aufträge im Zusammenhang mit Impfstoffen und eine gewisse Schwäche auf dem Telekommunikationsmarkt zurückzuführen war. Das Inkassounternehmen PRA musste seine Schätzung der verbleibenden Beitreibungen nach unten korrigieren, da es bei den Forderungen aus dem Jahr 2021 zu einem Negativauslese-Problem kam und die Steuererstattungen geringer ausfielen. Viavi Solutions, ein Anbieter von Test- und Überwachungsgeräten und -dienstleistungen für Kommunikationsnetze, meldete enttäuschende Gewinne, da die Kunden ihre Investitionsabsichten reduzierten.

#### Marktrückblick

Die globalen Small-Cap-Aktienmärkte legten im Berichtszeitraum zu, blieben jedoch hinter der Entwicklung der Large Caps zurück, insbesondere an den US-amerikanischen und kontinentaleuropäischen Aktienmärkten. Die Aktien starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die Besorgnis über Inflation und Rezession blieb jedoch bestehen, auch wenn sie abnahm. Das Jahr 2023 begann mit einer Reihe von Börsenrallys, unterstützt durch die Aufhebung der Covid-Beschränkungen in China, einen warmen Winter, der eine Energiekrise in Europa verhinderte, und eine erwartete Abschwächung der Zinsanhebungen. Dennoch hielt die US-Notenbank (Fed) angesichts der robusten US-Wirtschaft an ihrer restriktiven Zinspolitik fest, was zu Marktvolatilität führte. Darüber hinaus sorgten der Zusammenbruch zweier regionaler Kreditinstitute in den USA und die Rettung der Credit Suisse durch die UBS im Frühjahr für eine kurzzeitige Angst vor einer Sinanzkrise. Die Konjunkturerholung in Chinas nach der Aufhebung der Covid-Beschränkungen enttäuschte angesichts des angeschlagenen chinesischen Immobilienmarktes trotz bescheidener Konjunkturmaßnahmen, was sowohl den Binnenmarkt als auch die auf China ausgerichteten Aktien belastete. Darüber hinaus haben die Anleger gegen Ende des Berichtszeitraums die Aktienbewertungen neu kalibriert, als sie feststellten, dass die höheren Zinssätze anhalten und die Kreditkosten steigen würden.

#### Ausblick

Die globalen Aktienmärkte leiden zu Beginn des vierten Quartals unter einer vorsichtigeren Stimmung, obwohl sich die Inflation in den USA und in Europa verbessert. Die Bedenken drehen sich um eine steilere Kurve an den Treasury-Märkten, einen gewissen Verlust an wirtschaftlicher Wachstumsdynamik und einen weltweit zunehmenden Gegenwind bei den Verbrauchern. Angesichts der bevorstehenden Berichtssaison für das dritte Quartal hoffen die Anleger jedoch auf die Bestätigung, dass die Bilanzen der Verbraucher und Unternehmen weiterhin solide sind. Die Entwicklungen an den Rentenmärkten haben potenzielle Risiken für die Finanzstabilität aufgezeigt, die mit dem Narrativ "länger höher" verbunden sind. Daher werden die Maßnahmen der Zentralbanken bis Ende 2023 und möglicherweise darüber hinaus einen großen Einfluss haben, bis sich das Gleichgewicht zugunsten der Ansicht verschiebt, dass potenzielle Zinssenkungen zur Ankurbelung der globalen Wirtschaftstätigkeit anstehen werden.

#### **Catherine Stanley**

Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Smaller Cap Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

RS Global, Inc.77748/244172718/2412/2Wheason Precious Metals Corp.2.06683.7762.10Wheason Precious Metals Corp.2.06683.7762.10Wheason Precious Metals Corp.2.0661.008<	Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens	
Kanda         7.500         6.51.52         7.40.42.42         7.500         6.51.52         7.40.24.24         7.500         6.51.52         7.500         6.51.52         7.500         6.51.52         7.500         6.51.52         7.500         6.51.52         7.500         6.51.52         7.500         7.500         6.51.52         7.500          7.500         7.500	ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDERE	EN GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBA	RE WERTPAPIERE		
Lundin Ming Corp.790095.1%94.2441/2SSR Ming, Inc.36.794.2441/2SSR Ming, Inc.36.794.2441/2SSR Ming, Inc.36.794.2441/2Misearo Precisors Matals Corp.2.0668.7762.00Stress Ming Corp.1.0014.5123.66Pransech1.0014.5123.66Pransech1.0014.5123.66Pransech1.001.01.523.60Stress Ming AG2.002.009.00Stress Ming AG2.002.009.00Stress Ming AG2.002.009.00Stress Ming AG2.002.009.00Stress Ming AG2.009.009.00Stress Ming AG2.009.009.00Stress Ming AG1.009.001.00Stress	ANTEILE				
B Giskning. Inc. 3.77 47.24 4.24 1.27 4.25 4.25 4.25 4.25 4.25 4.25 4.25 4.25	Kanada				
SSR Many, ho.3.5794.7.784.7.28WSP Okola, ho.0/40.5082.3.0Denaria2.004.7.284.7.28Ringbachen Landbahr, A.S.1.801.412.3.68Frankreih1.801.413.0.8Exterina1.801.413.0.8Frankreih9.903.0.9.03.0.9.0Denaria0.904.0.9.00.0.9.0Sins Rong Grap, SS0.904.0.9.00.0.9.0Sins Rong Grap, SS0.904.0.9.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.1.5.24.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.1.5.24.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.1.5.24.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.1.5.24.0.0.00.0.0Caphe Landon1.1.5.24.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.3.375.5.151.3.30Grapha Extern Landon1.5.144.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, SS1.3.375.5.151.3.30Grapha Extern Landon1.5.144.0.0.00.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, SS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS1.0.01.0.01.0.0Sins Rong Grap, CS	Lundin Mining Corp.			1,48	
Weater Previous Metalls Corp.         2.068         8.776         2.07           Wiss Global, Inc.         94383         4.88           Ring/soutig Landschank AS         1.058         1.61.22         3.88           Frankraich         1.057         3.72.08         0.033           Gerrachmer AG         4.04         4.00.01         2.5           Frankraich         7.87.208         0.033         0.033           Churs Grup SE         0.05         2.137         0.63.00         0.038           Frankraich         6.05         2.137         0.63.00         0.038           Frankraich         2.137         0.63.07         1.63.00         0.03.00           Sins Real Estatis Li         0.057.77         1.63.00         0.03.00 <td></td> <td></td> <td></td> <td>1,21</td>				1,21	
W3P Gobal, Inc.         97.4         95.556         23.833           Diseasci Resployebing Lundobark AS         1005         146.122         35.83           Findrach         1.307         37.208         0.303           Earth A         47.4         49.509         1.502           Destabilition         47.4         49.509         1.502           Outsething         47.4         49.509         1.502           Symite Asel Easte Lul.         2.210         0.83.200         0.83.200           Symite Asel Easte Lul.         2.210         0.83.200         0.83.200           Oping Enterprise PLC         2.213         0.403.200         1.53.2         0.403.200           Symite Asel Easte Lul.         0.500         1.53.2         0.403.200         1.53.2         0.403.200           Origin Enterprise PLC         2.81.000         1.53.2         0.403.200         1.53.0         0.51.0           Origin Enterprise PLC         3.337         0.86.50         1.53.0         0.53.0         1.53.0         0.53.0         1.53.0           Origin Enterprise PLC         3.337         0.86.50         1.53.0         0.53.0         1.53.0         0.53.0         1.53.0           Origin Enterprise PLC         3.337					
Base and Section 1999         34333         4,84           Ringkogenig Landtohenk AS         1.006         146,122         3,66           Frankraich					
Damma Margophenia pursubset ASA         1.008         1.046.12         3.068           Frenkrich	WSP Global, Inc.	674			
Ringkong Landbokank AS         10.08         146.122         3.68           Frankreich	Dänemark		334.533	8,38	
Lectin13677.7.2680.9.35Doutschland		1.008	146.122	3,66	
Deutschland         474         40.000         1.25           Garrashinar AG         474         40.000         1.25           Garrashinar AG         2.110         39.200         0.38           Norms Group SE         2.110         39.200         0.38           Symine AG         2.211         35.737         1.85           Symine AG         49         4.23.83         1.08           Datal Hold Group PLC         11.5.32         49.021         1.25           Garba Hold Group PLC         3.37         55.151         1.38           Origin Enterprises PLC         3.800         42.328         1.06           Cogrupte Software Lut.         8.800         42.328         1.00           Spann         3.136         39.843         1.00           Japan         3.300         55.398         1.30           Meruspan         3.300         55.398         1.30           Nervegan         3.300         55.398         1.30           Nervegan         3.140         8.200         8.228           Sparter         3.300         55.398         1.30           Sparter Marken Mix, Inc.         3.300         55.398         1.30           Merine	Frankreich				
Garrabalmar AG4444.00014.2300.000Norms Group SE2.11033.0260.080Symise AG62.51765.7371.080Symise AG62.51765.7371.080Symise AG44942.9381.080Irlad2.12324.00211.332Combas PLC1.0324.00211.333Ginhab PLC3.33765.1511.380Origin Enerprises PLC1.63.074.23.281.060Compro Software Lud.6.0004.23.281.060Tation1.0004.23.281.060Tation1.0004.3.391.000Tation1.0004.3.301.000Corpur Software Lud.3.0001.9.1717.440MARR Sp.A3.0001.9.1717.400Software Lud.3.0001.9.1810.3.00Software Lud.3.0001.9.1210.000Software Lud. <td>Lectra</td> <td>1.367</td> <td>37.268</td> <td>0,93</td>	Lectra	1.367	37.268	0,93	
Heiders SE80624 130.00Norma Group SE21103.0260.08Symme AG24.23766.7371.68Symme AG44042.2381.08Symme AG11.53244.0211.23Itand11.53244.0211.23Glanda FLC3.3756.1511.8Solgin Energines PLC3.53756.1511.8Conyne Software Ld.8.091.333.98.431.00Tand3.1383.98.431.003.980.70Amen Corp.1.8174.003.980.70CRU SO Corp.2.2003.0380.700.93CRU SO Corp.2.3003.1380.930.70CRU SO Corp.2.3003.1380.700.74430.93CRU SO Corp.2.3003.1380.700.74430.93CRU SORMARI LG.3.0001.13120.700.74430.70Sourds And SA0.0040.3030.14220.700.203Sourds And SA0.0040.720.74437444Corp.2.2382.000.5031.020.70SparGam LT SP. And ASA0.0040.7174437474Condid Sourds ASA0.0040.720.700.22382.00Sourds AGA0.0040.717443747474Condid Sourds AGA0.0040.720.7875747474Sourds AGA0.004<	Deutschland				
Norms Group SE2.103.9.2680.89Symise Ad Status Real Status Rul62.51765.7375.85Symise Ad Status Rule21.92162.7376.85Yand1.5.3244.0.211.3.33Datas Hold Group PLC1.5.3244.0.211.3.33Grainba PLC1.5.3244.0.211.3.33Grainba PLC1.5.3244.0.211.3.33Grainba PLC1.6.511.3.86.9.991.4.3Cognyte Schware Lud8.8004.2.321.0.6Hatien*********************************				1,25	
Sinus Radi Emite Ltd.         62.577         6.5737         1.685           Symme AG         449         42.986         1.08           Itand         211.921         5.86           Datal Hotel Group PLC         11.532         49.021         1.33           Glands PLC         3.337         55.151         1.33           Origin Enterprises PLC         18.154         56.990         1.43           Cognyin Software Ltd.         8.800         42.328         1.06           Tarael         1.000         3.035         35.01         1.03           ARR SyA         3.030         31.83         38.43         1.00           Japan         7         7         7.63         7.77           OCD Corp.         2.200         30.265         0.76           OCD Corp.         2.200         30.265         0.76           Symme And Sa Somionductor ASA         3.030         31.622         0.76           Symme And Sa Somionductor ASA         5.102         58.89         1.50           Store Jamash MSA         5.102         58.89         1.50           Store Jamash MSA         5.102         58.89         1.50           Store Jamash MSA         5.102         58					
Symise AG         449         42.936         1.08           Itand         21.931         5.061           Datas Hool Group PLC         1.532         40.021         1.232           Ginhois PLC         3.337         55.151         1.38           Origin Entreprises PLC         16.514         56.999         1.132           Symic         A.800         42.328         1.08           Strain         49.021         1.33         3.337         55.151         3.337           Origin Entreprises PLC         18.07         3.337         55.151         3.337         55.151         3.337         3.337         55.151         3.337 </td <td>•</td> <td></td> <td></td> <td></td>	•				
Vind         ZI 491         5,66           Datase Hotel Group PLC         11,532         49,021         1,23           Gancha PLC         3,337         55,151         1,38           Isreel         16,154         58,990         1,43           Cognyte Software Ld.         8,800         42,228         1,06           ARR SpA         31,36         39,843         1,00           Japan					
thand         unstantion         unstantis andift is andift is andift is	Synnise AG	443 			
Gianbia PLC         3.337         55.151         1.33           Origin Enterprises PLC         16.514         56.999         1.43           Israel	Irland		221.921	5,50	
Origin Enterprises PLC         16.514         56.999         1.43           Strail         61.717         4.44           Cognyle Software Ltd.         8.800         42.328         1.00           NARR SpA         3.136         39.843         1.00           Japan         7         73.742         0.99           CKD Corp.         2.200         30.385         0.76           Direct Marketing MK, Inc.         3.000         15.938         1.39           Nordie Semiconductor ASA         3.000         31.62         0.77           SpareBank 1 SR-Bank ASA         3.000         31.62         0.76           Nordie Semiconductor ASA         3.000         31.62         0.76           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         55.86         1.52           Storebrand ASA         10.040         82.238         2.06           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.152           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.152           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.152           Computacetter PLC         38.056         56.510         1.43           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.152 <td>Dalata Hotel Group PLC</td> <td>11.532</td> <td>49.021</td> <td>1,23</td>	Dalata Hotel Group PLC	11.532	49.021	1,23	
Stratel         161.171         4,04           Israel         Cognyle Software Ltd.         8.800         42.328         1,06           NARR SpA         3.136         39.843         1,00           MARR SpA         3.136         39.843         1,00           Japan         2.000         30.385         0.79           CMD Corp.         1.807         39.742         0.99           CMD Corp.         2.000         30.386         0.78           Direct Markeing MiX, Inc.         3.000         11.918         0.30           Misubishi HC Capital, Inc.         8.300         55.398         1.39           Norde Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.79           SpareBank TSR-Bank ASA         5.182         59.689         1.50           Storebrand ASA         5.182         59.689         1.50           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.15           Storebrand ASA         1.040         82.238         2.06           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.55           Storebrand ASA         1.040         82.238         2.077           Storebrand SA         5.444         46.024         1.53	Glanbia PLC	3.337	55.151	1,38	
Israel         8.00         4.2.38         1.00           Cognyle Software Lid.         8.00         4.2.38         1.00           MARR SpA         3.136         39.843         1.00           Japan	Origin Enterprises PLC	16.514	56.999	1,43	
Cognyte Software Ltd.         8.800         42.328         1,06           tatien             MARR SpÅ         3.136         3.9.433         1,00           Japan          3.9.433         1,00           Anano Corp.         2.00         30.385         0,76           Direct Marketing MK, Inc.         3.300         11.118         0.33           Mitsubishi HC Capital, Inc.         3.300         11.118         0.33           Nordeg Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.76           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         58.869         1.50           Storebrand ASA         5.192         58.869         1.50           Cony AG         1.197         48.903         1.23           Storebrand ASA         5.44         6.024         1.19           Color Jace Store AG         1.132         0.76           Storebrand ASA         5.19         1.132         0.76           Coro Jace Store AG			161.171	4,04	
MAR SpA         3.136         39.843         1,00           Japan         -         -         -           Anana Corp.         2.00         30.385         0,76           CNC Orp.         3.800         11.918         0.39           Direct Marketing MIX, Inc.         3.800         15.39         1.33           Missibishi HC Capital, Inc.         3.030         55.39         1.33           Norwegen		8.800	42.328	1,06	
Anano Corp.         1.807         39.742         0.99           CKD Corp.         2.200         30.385         0.76           Dired Markeing MIX, Inc.         3.800         11.91         0.30           Mitsubishi HC Capital, Inc.         8.300         55.398         1.39           Nordic Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.79           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         59.869         1.50           Storebrand ASA         10.040         82.238         2.06           Merlin Properties Socimi SA         5.444         46.024         1.155           Schweiz         11.32         31.522         0.79           Sing Group AG         1.976         48.903         1.23           Vereinigtes Königreich         11.32         31.522         0.79           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0.79           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0.79           Cab Payments Holdings PLC         11.32         31.522         0.79           Cabridge DC         11.32         31.522         0.79           Cabridge DC         11.32         31.52         0.79           Cabr Payments Holdings LC </td <td>Italien MARR SpA</td> <td>3.136</td> <td>39.843</td> <td>1,00</td>	Italien MARR SpA	3.136	39.843	1,00	
CKD Corp.         2.200         30.385         0,76           Direct Marketing MiX, Inc.         3.300         11.918         0,300           Mistubish IH C Capital, Inc.         8.300         15.598         1,39           Norwegen         3.000         31.622         0,79           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         59.869         1,500           Storetor ASA         5.000         62.238         2.066           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         59.869         1,500           Storetor ASA         5.444         46.024         1,15           Schweiz	Japan				
Direct Marketing MiX, Inc.         3.800         11.918         0.303           Mitsubish HC Capital, Inc.         55.398         1.139         3.44           Nordie Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.79           SpareBank 1SR-Bank ASA         5.192         59.869         1.50           Storebrand ASA         5.192         59.869         1.50           Storebrand ASA         10.040         82.238         2.06           SpareBank 1SR         1.040         82.238         2.06           Storebrand ASA         5.444         46.024         1.15           Schweiz         1.040         82.932         1.06           Schweiz         2.079         2.079         2.079           Centrids PLC         1.132         31.522         0.79           Centrids PLC         38.062         67.982         1.70           Convarice Group PLC         38.062         67.982         1.70           Convarice Group PLC         3.030         56.510         1.42           Convarice Group PLC         3.018         39.573         0.99           Genus PLC         3.236         18.876         0.42           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         4	Amano Corp.	1.807	39.742	0,99	
Mitsubishi HC Capital, Inc.         8.300         55.398         1.39           Norregen         137.443         34.44           Nordic Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.79           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         59.809         1.50           Storebrand ASA         0.040         82.238         2,06           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.444         46.024         1.15           SpareIn         173.729         4.38           Schweiz         173.729         4.38           Sing Group AG         1.976         48.903         1.23           Vereinigtes Königreich         11.132         31.522         0.79           CLS Holdings PLC         36.062         67.982         1.70           CLS Holdings PLC         30.188         39.573         0.99           Gorup AG         1.314         33.616         0.44           ConvaTec Group PLC         30.188         39.573         0.99           Gerup PLC <td< td=""><td>CKD Corp.</td><td>2.200</td><td>30.385</td><td>0,76</td></td<>	CKD Corp.	2.200	30.385	0,76	
Norwagen         137.443         3.44           Nordic Semiconductor ASA         3.030         31.622         0,79           SpareBark 1SR-Bank ASA         5.192         59.659         1,50           Storebrand ASA         10.040         82.238         2,06           SpareBark 1SR-Bank ASA         10.040         82.238         2,06           Sparien         173.729         4,35           Merlin Properties Socimi SA         5.444         46.024         1,15           Schweiz         1.976         48.903         1.23           Vereinigtes Köngreich         2.079         4.800         1.23           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0,77           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0,77           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0,77           Cab Payments Holdings PLC         11.34         31.616         0.44           Computacentre PLC         11.33         31.616         0.44           Computacentre PLC         1.334         33.616         0.44           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1.21           Metrose Industries PLC         3.296	Direct Marketing MiX, Inc.	3.800	11.918	0,30	
Norregen         Nordis Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.793           Nordis Semiconductor ASA         5.192         59.869         1.505           Storebrand ASA         10.040         82.238         2,06           Merill Properties Socimi SA         10.040         82.238         2,06           Spane         1.544         46.024         1,155           Schweiz         1.976         4.8903         1,23           Vereinigtes Königreich         1.1976         4.8903         1,23           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.52         0,79           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.52         0,79           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.52         0,79           Cab Payments Holdings PLC         1.1376         4.8903         1.23           Computacenter PLC         1.138         36.610         1.42           Convarter Group PLC         1.830         56.510         1.42           Convarter Group PLC         3.088         39.573         0.99           Genus PLC         3.296         18.876         0.47           Mercos Induktries PLC         3.296         18.876         0.47 <tr< td=""><td>Mitsubishi HC Capital, Inc.</td><td>8.300</td><td>55.398</td><td>1,39</td></tr<>	Mitsubishi HC Capital, Inc.	8.300	55.398	1,39	
Nordic Semiconductor ASA         3.030         31.622         0.79           SpareBank 1 SR-Bank ASA         5.192         59.669         1.50           Storebrand ASA         10.040         82.238         2.06           SpareIm         173.729         4.35           SpareIm         5.444         46.024         1.15           Schweiz         5         48.903         1.23           Vereinigtes Königreich         11.132         31.522         0.79           Cab Payments Holdings PLC         12.37         34.480         0.686           Computacenter PLC         18.30         56.510         1.42           Convariace Group PLC         1.830         56.510         1.42           Convariace Group PLC         3.0188         39.573         0.99           Genus PLC         3.296<	Nerwogen		137.443	3,44	
SpareBank 1SR-Bank ASA         5.192         59.869         1.50           Storebrand ASA         10.040         82.238         2.06           Marini Properties Socimi SA         13.729         4.35           Schweiz         5.444         46.024         1.15           Stereininges Marini Properties Socimi SA         1.976         48.903         1.23           Vereinigtes Königreich           Cab Payments Holdings PLC         11.132         31.522         0.79           Cab Fayments Holdings PLC         23.779         34.480         0.86           Computacenter PLC         23.779         34.480         0.86           Comvarec Group PLC         13.30         56.510         1.42           Convarec Group PLC         30.188         39.573         0.99           Genus PLC         3.314         33.616         0.84           Lanceshire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1.21           Mertos Industries PLC         3.986         0.95         1.930           Genus PLC         6.164         48.225         1.21           Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1.21           Nomad Foods Ltd. <t< td=""><td>-</td><td>3 030</td><td>31 622</td><td>0 79</td></t<>	-	3 030	31 622	0 79	
Storebrand ASA         10.040         82.238         2,06           Spanien         173.729         4,35           Merlin Properties Socimi SA         5.444         46.024         1,15           Schweiz         1.976         48.903         1,23           Vereinigtes Königreich         1.1132         31.522         0.79           Cab Payments Holdings PLC         36.062         67.982         1,70           Cab Isolarity PLC         36.062         67.982         1,70           Cab Payments Holdings PLC         23.779         34.480         0,86           Computacenter PLC         1.830         56.510         1.42           Computacenter PLC         1.830         56.510         1.42           Computacenter PLC         1.830         56.510         1.42           Computacenter PLC         30.188         39.573         0.99           Genus PLC         3.018         39.573         0.99           Genus PLC         3.296         1.837         0.86         0.87           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.225         1.21           Melrose Industries PLC         8.40         30.663         0.97           Striffeer Communications Group PLC					
Spanien         Stadie				2,06	
Merin Properties Socimi SA         46.024         1,15           Schweiz         1         1,23           SIG Group AG         1.976         48.903         1,23           Vereinigtes Königreich         1         1132         31.522         0,79           Cab Payments Holdings PLC         36.062         67.982         1,70           Cab Payments Holdings PLC         36.062         67.982         1,70           Cas Holdings PLC         36.062         67.982         1,70           CSB Holdings PLC         38.062         67.982         1,70           Computacenter PLC         1.830         56.510         1,42           Convartec Group PLC         1.330         56.510         1,42           Dowlais Group PLC         3.914         3.816         0.84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Metrose Industries PLC         3.926         18.876         0.47           Next Fifteen Communications Group PLC         3.8065         0.930         1.02           Nomad Foods Ltd.         8.40         3.063         0.977           Tyman PLC         11.490         40.530         1.02           Mardocs Ltd.         841			173.729	4,35	
Schweiz         SIG Group AG         1.976         48.903         1.23           Vereinigtes Königreich         11.132         31.522         0,79           Cab Payments Holdings PLC         36.062         67.982         1,70           Cls Holdings PLC         23.779         34.480         0.86           Computacenter PLC         23.779         34.480         0.86           Computacenter PLC         1.830         56.510         1,42           CowarTec Group PLC         12.325         32.764         0,82           Dowlais Group PLC         30.188         39.573         0,99           Genus PLC         1.314         33.616         0,84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0,47           Next Fifteen Communications Group PLC         3.296         18.876         0,47           Norad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC<					
SIG Group AG       1.976       48.903       1.23         Vereinigtes Königreich       1       31.522       0.79         Cab Payments Holdings PLC       36.062       67.982       1.70         Cl.S Holdings PLC       36.062       67.982       1.70         Cl.S Holdings PLC       23.779       34.480       0.66         Computacenter PLC       1.830       56.510       1.42         ConvaTec Group PLC       1.322       32.754       0.82         Dowlais Group PLC       30.188       39.573       0.99         Genus PLC       1.314       33.616       0.84         Lancashire Holdings Ltd.       6.700       48.248       1.21         Melrose Industries PLC       38.065       0.95       0.95         Team17 Group PLC       2.501       38.065       0.95         Team17 Group PLC       9.480       30.663       0.77         Tyman PLC       11.490       40.530       1.02         Stote Stid.       38.065       0.95         Team17 Group PLC       9.480       30.663       0.77         Tyman PLC       11.490       40.530       1.02         Stote Stid.       38.065       0.95		5.444	46.024	1,15	
Cab Payments Holdings PLC       11.132       31.522       0,79         Centrica PLC       36.062       67.982       1,70         CLS Holdings PLC       23.779       34.480       0,86         Computacenter PLC       1.830       56.510       1,42         ConvaTec Group PLC       12.325       32.764       0,82         Dowlais Group PLC       30.188       39.573       0,99         Genus PLC       1.314       33.616       0,44         Lancashire Holdings Ltd.       6.700       48.248       1,21         Melrose Industries PLC       3.296       18.876       0,47         Next Fifteen Communications Group PLC       2.501       38.065       0,95         Team 7 Group PLC       9.480       30.663       0,77         Tyman PLC       11.490       40.530       1,02 <b>Stites Stites Stites Stites Stites Stites Stites Stites Stites Stites Stites</b> <td colspa<="" td=""><td></td><td>1.976</td><td>48.903</td><td>1,23</td></td>	<td></td> <td>1.976</td> <td>48.903</td> <td>1,23</td>		1.976	48.903	1,23
Centrica PLC       36.062       67.982       1,70         CLS Holdings PLC       23.779       34.480       0,86         Computacenter PLC       1.830       56.510       1,42         ConvaTec Group PLC       12.325       32.764       0,82         Dowlais Group PLC       30.188       39.573       0,99         Genus PLC       1.314       33.616       0,84         Lancashire Holdings Ltd.       6.700       48.248       1,21         Melrose Industries PLC       3.296       18.876       0,47         Norrad Foods Ltd.       2.501       38.065       0,95         Team 17 Group PLC       9.480       30.663       0,77         Tyman PLC       11.490       40.530       1,02         Stites         Stites         Obs       2.501       38.065       0,95         Tyman PLC       9.480       30.663       0,77         Tyman PLC       11.490       40.530       1,02         USA         Amdocs Ltd.       841       71.056       1,78         Avnet, Inc.       1.557       75.032       1,88         Boot Barn Holdings, Inc.       1.223       99.29	Vereinigtes Königreich	· · · ·			
CLS Holdings PLC       23.779       34.480       0,86         Computacenter PLC       1.830       56.510       1,42         ConvaTec Group PLC       12.325       32.764       0,82         Dowlais Group PLC       30.188       39.573       0,99         Genus PLC       1.314       33.616       0,84         Lancashire Holdings Ltd.       6.700       48.248       1,21         Melrose Industries PLC       3.296       18.876       0,47         Next Fifteen Communications Group PLC       3.296       18.876       0,47         Nomad Foods Ltd.       2.501       38.065       0,95         Team17 Group PLC       9.480       30.663       0,75         Tyman PLC       11.490       40.530       1,02         USA         Andocs Ltd.       841       71.056       1,78         Avnet, Inc.       841       71.056       1,78       1,88         Boot Barn Holdings, Inc.       1.223       99.295       2,49	Cab Payments Holdings PLC	11.132	31.522	0,79	
Computacenter PLC         1.830         56.510         1,42           ConvaTec Group PLC         12.325         32.764         0,82           Dowlais Group PLC         30.188         39.573         0,99           Genus PLC         1.314         33.616         0,84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0,47           Next Fifteen Communications Group PLC         3.296         18.876         0,47           Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49				1,70	
ConvaTec Group PLC         12.325         32.764         0,82           Dowlais Group PLC         30.188         39.573         0,99           Genus PLC         1.314         33.616         0,84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0,47           Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1,21           Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           Status           Status           Gentus           Status           Status         1,557         75.032 <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,86</td>				0,86	
Dowlais Group PLC         30.188         39.573         0,99           Genus PLC         1.314         33.616         0,84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0,47           Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1,21           Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49					
Genus PLC         1.314         33.616         0.84           Lancashire Holdings Ltd.         6.700         48.248         1,21           Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0,47           Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1,21           Norad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49	•				
Lancashire Holdings Ltd.       6.700       48.248       1,21         Melrose Industries PLC       3.296       18.876       0,47         Next Fifteen Communications Group PLC       6.164       48.225       1,21         Nomad Foods Ltd.       2.501       38.065       0,95         Team17 Group PLC       9.480       30.663       0,77         Tyman PLC       11.490       40.530       1,02 <b>Strust Strust Strust</b> Amdocs Ltd.         841       71.056       1,78         Avnet, Inc.       1.557       75.032       1,88         Boot Barn Holdings, Inc.       1.223       99.295       2,49	•				
Melrose Industries PLC         3.296         18.876         0.47           Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1,21           Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           S21.054         13.05           USA           Amotos Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49					
Next Fifteen Communications Group PLC         6.164         48.225         1,21           Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0,95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           S21.054         13.05           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49	•				
Nomad Foods Ltd.         2.501         38.065         0.95           Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           S21.054         13.05           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49					
Team17 Group PLC         9.480         30.663         0,77           Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           S21.054         13.05           USA           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49	•				
Tyman PLC         11.490         40.530         1,02           S21.054         521.054         13.05           USA         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49					
S21.054         13,05           USA         841         71.056         1,78           Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49	Tyman PLC			1,02	
Amdocs Ltd.         841         71.056         1,78           Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49				13,05	
Avnet, Inc.         1.557         75.032         1,88           Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49		841	71.056	1,78	
Boot Barn Holdings, Inc.         1.223         99.295         2,49				1,88	
				2,49	
	Bristow Group, Inc.	1.850	52.114	1,31	

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Smaller Cap Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
Catalent, Inc.	681	31.006	0,78
Columbia Sportswear Co.	453	33.567	0,84
Dine Brands Global, Inc.	541	26.752	0,67
Eagle Materials, Inc.	394	65.609	1,64
Encompass Health Corp.	1.118	75.085	1,88
Ensign Group, Inc.	560	52.041	1,31
Essential Properties Realty Trust, Inc.	2.730	59.050	1,48
Genpact Ltd.	1.491	53.974	1,35
GrafTech International Ltd.	9.596	36.753	0,92
Grand Canyon Education, Inc.	553	64.635	1,62
Graphic Packaging Holding Co.	4.149	92.440	2,32
GXO Logistics, Inc.	894	52.433	1,31
Hayward Holdings, Inc.	4.550	64.155	1,61
Healthcare Realty Trust, Inc.	2.623	40.053	1,00
Kirby Corp.	1.591	131.735	3,30
Kosmos Energy Ltd.	10.133	82.888	2,08
LKQ Corp.	1.558	77.136	1,93
MaxLinear, Inc.	1.659	36.913	0,93
MDC Holdings, Inc.	1.155	47.621	1,19
Molina Healthcare, Inc.	286	93.776	2,35
MSC Industrial Direct Co., Inc.	468	45.934	1,15
Plymouth Industrial REIT, Inc.	2.436	51.034	1,28
PRA Group, Inc.	2.423	46.546	1,17
QuidelOrtho Corp.	592	43.240	1,08
Savers Value Village, Inc.	252	4.705	0,12
Stericycle, Inc.	777	34.740	0,87
USA Physical Therapy, Inc.	471	43.205	1,08
Vail Resorts, Inc.	182	40.384	1,01
Viavi Solutions, Inc.	3.812	34.842	0,87
Webster Financial Corp.	1.387	55.910	1,40
WEX, Inc.	423	79.562	1,99
World Fuel Services Corp.	1.447	32.456	0,81
		2.027.677	50,80
ANTEILE GESAMT		3.938.016	98,65
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT		3.938.016	98,65
ANLAGEN INSGESAMT		3.938.016	98,65
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		53.925	1,35
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		3.991.941	100,00

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Smaller Cap Equity Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	Nettovermögens
Luftfahrt und Verteidigung	0,47
Umweltschutz	0,87
Telekommunikation	0,87
Automobilzulieferer	0,99
Freizeit und Tourismus	1,01
Chemikalien	1,08
Wohnungsbauunternehmen	1,19
Hotelgewerbe	1,23
Werbung	1,51
Maschinenbau	1,68
Landwirtschaft	2,27
Bau- und Ingenieurswesen	2,39
Software	2,76
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	2,81
Vertrieb und Großhandel	2,93
Nahrungsmittel und Getränke	2,93
Versicherungen	3,27
Halbleiter	3,60
Baustoffe	4,27
Einzelhandel	4,43
Computer	4,55
Metalle und Bergbau	4,78
Verpackungen und Container	4,80
Gewerbliche Dienstleistungen	4,82
Öl und Gas	5,09
Transport und Verkehr	5,42
Immobilien	7,42
Gesundheitswesen	9,30
Finanzdienstleistungen	9,91
Anlagen insgesamt	98,65
Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,35
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Global Total Return Bond

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse I Acc EUR eine Rendite von 1,5 %. Im Vergleich dazu erzielte der Markt-Referenzwert, der Bloomberg Barclays Global Aggregate TR EUR Hedged Index, eine Rendite von -0,4 %. Die Performance ist die Gesamtrendite nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Die Strategie übertraf ihre Benchmark, während die Rentenmärkte Verluste verzeichneten. Defensive Strategien am US-Zinsmarkt trugen dazu bei, die Auswirkungen des Anstiegs der Renditen der US-Staatsanleihen abzumildern, doch wirkte sich das Engagement im eingebetteten Zinsrisiko der Positionen des Fonds in Unternehmensanleihen negativ auf die Performance aus. Selbst als die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads aufgrund der robusten Wirtschaft. Das Engagement in "Rising Stars" – Emittenten, die den Sprung vom Kreditrating "High Yield" zu "Investment Grade" schaffen – leistete einen weiteren positiven Beitrag zur Performance, ebenso wie die Ausrichtung auf Beta-stärkere Sektoren des Marktes für Unternehmensanleihen. Kreditabsicherungsstrategien schmälerten die Erträge. Bei den Relative-Value-Zinsstrategien kam es Anfang 2023 zu einem Rücksetzer, was vor allem auf eine Long-Position im Vereinigten Königreich und eine Short-Position in Japan zurückzuführen war, wobei die Position im Vereinigten Königreich im weiteren Verlauf des Jahres die Erwartungen erfüllte.

### Marktrückblick

Die Renditen der weltweiten Staatsanleihen stiegen im Berichtszeitraum, als Reaktion auf die steigenden Zinssätze. Im letzten Quartal 2022 kam es zu einem sprunghaften Anstieg, da Inflationsängste und das Tempo der Zinsanhebungen im Vordergrund standen. Die Renditen gingen jedoch wieder zurück, als das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 nachließ und die Anleger mit einem Höchststand der Zinssätze und sogar mit Zinssenkungen rechneten, falls sich das Wirtschaftswachstum abschwächen sollte. Die US-Notenbank (Fed) beendete ihr Programm zur quantitativen Lockerung, verringerte ihre Anleihebestände und hob die Zinssätze sechsmal an, so dass sie Ende September bei 5,50 % lagen. Dadurch übertrafen die Zinssätze die sinkenden Inflationsraten. Die Verbraucherpreisinflation ging vor dem Hintergrund sinkender Energiekosten von 7,7 % im Oktober 2022 auf 3,7 % im September 2023 zurück. Die Fed dämpfte jedoch die Erwartungen der Anleger auf eine schnelle Zinswende bei einem weiteren Rückgang der Inflation und wies darauf hin, dass die Zinssätze möglicherweise "länger höher" bleiben müssen, bis der Lohndruck nachlässt. Diese Verschiebung führte zu einer steileren Renditekurve, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit in Erwartung einer lockereren Geldpolitik stiegen, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Selbst als die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads. Dies spiegelte die relative Widerstandsfähigkeit des Wirtschaftswachstums und solide Erträge wider.

#### Ausblick

Unsere Haltung in Bezug auf Staatsanleiherenditen ist nach wie vor bullisch, wenn auch mit einer Tendenz zur Versteilerung, da wir Long-Positionen am vorderen Ende der Kurven bevorzugen. Die Renditen sind sprunghaft angestiegen, mit einer starken Versteilerung, die vor allem durch das hintere Ende der US-Kurve verursacht wurde. Dies lässt sich durch eine Kombination von Themen erklären: eine Herabstufung der Kreditratings der US-Bundesbehörden, restriktive Zentralbanken, die ein längerfristig höheres Zinsniveau anführen, ein widerstandsfähigeres Wachstum als erwartet und Bedenken hinsichtlich der Emission von Schuldtiteln aufgrund einer weiterhin expansiven Finanzpolitik. Zwar sind die Bewertungen attraktiver geworden, da weniger Zinssenkungen eingepreist sind und die Laufzeitprämie gestiegen ist, doch sind wir weiterhin vorsichtig, wenn es um die Aufstockung von bullischen Anleihepositionen geht, da die Arbeitsmärkte trotz der zahlreichen Zinserhöhungen der Zentralbanken noch keine Anzeichen für eine deutliche Abschwächung erkennen lassen. Zu Beginn des letzten Quartals 2023 scheinen die Aussichten für die weltweiten Investment-Grade (IG)-Unternehmenskredite recht ausgewogen zu sein. Die wirtschaftlichen Aussichten sind schwach, aber positiv, doch die straffe Geldpolitik bleibt eine klare Bedrohung mit Blick auf eine weitere Verengung der Kreditspreads. Dagegen erwarten wir, dass die Kreditqualität, insbesondere in den USA, hoch bleibt.

#### **Global Rates Team**

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODE	R AN EINEM ANDER	EN GEREGELTEN	MARKT NOTIERTI	EÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIERE	
ANLEIHEN						
Australien						
APA Infrastructure Ltd.	4,25 %	26.11.2024	GBP	200.000	225.388	0,76
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., V/R	1,81 %	16.09.2031	GBP	101.000	99.693	0,34
Westpac Banking Corp., V/R	5,88 %	11.01.2028	GBP	200.000	231.373	0,78
Kanada					556.454	1,88
Bank of Nova Scotia	1,25 %	17.12.2025	GBP	214.000	224.318	0,76
Bausch & Lomb Escrow Corp.	8,38 %	01.10.2028	USD	94.000	89.206	0,30
Hudbay Minerals, Inc.	6,13 %	01.04.2029	USD	145.000	127.002	0,43
Toronto-Dominion Bank	5,29 %	11.01.2028	GBP	250.000	281.474	0,95
Kaimaninseln					722.000	2,44
QNB Finance Ltd.	1,63 %	22.09.2025	USD	306.000	266.190	0,90
Tencent Holdings Ltd.	3,58 %	11.04.2026	USD	200.000	179.895	0,61
Transocean Titan Financing Ltd.	8,38 %	01.02.2028	USD	200.000	192.367	0,65
					638.452	2,16
Danske Bank AS, V/R	4,63 %	13.04.2027	GBP	134.000	149.405	0,50
ISS Global AS	0,88 %	18.06.2026	EUR	211.000	192.176	0,65
	-,				341.581	1,15
Dominikanische Republik						
Dominican Republic International Bond	5,50 %	22.02.2029	USD	200.000	173.444	0,59
Finnland OP Corporate Bank PLC	1,38 %	04.09.2026	GBP	172.000	173.198	0,59
Frankreich						
Altice France SA	5,50 %	15.01.2028	USD	200.000	145.195	0,49
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1,25 %	05.12.2025	GBP	200.000	209.222	0,71
BNP Paribas SA	3,38 %	23.01.2026	GBP	168.000	182.420	0,62
BNP Paribas SA	1,63 %	02.07.2031	EUR	100.000	78.136	0,26
BPCE SA, V/R	2,13 %	13.10.2046	EUR	200.000	146.513	0,49
Crown European Holdings SA	3,38 %	15.05.2025	EUR EUR	100.000	97.752	0,33
Engie SA Faurecia SE	3,63 % 2,38 %	11.01.2030 15.06.2027	EUR	200.000 190.000	194.631 167.389	0,66 0,56
French Republic Government Bonds OAT	0,00 %	25.02.2024	EUR	1.050.000	1.034.812	3,50
French Republic Government Bonds OAT	1,75 %	25.11.2024	EUR	700.000	685.934	2,32
Iliad Holding SASU	7,00 %	15.10.2028	USD	250.000	215.194	0,73
Orange SA	0,00 %	29.06.2026	EUR	300.000	271.297	0,92
Rexel SA	5,25 %	15.09.2030	EUR	100.000	98.975	0,33
Societe Generale SA, V/R	0,13 %	17.11.2026	EUR	200.000	182.922	0,62
Deuteebland					3.710.392	12,54
Deutschland Allianz SE, V/R	2,60 %	31.12.2099	EUR	200.000	130.880	0,44
Amprion GmbH	3,88 %	07.09.2028	EUR	100.000	99.125	0,33
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7,50 %	15.05.2030	EUR	100.000	100.362	0,34
Commerzbank AG, V/R	1,38 %	29.12.2031	EUR	100.000	83.582	0,28
Deutsche Bank AG, V/R	4,50 %	30.04.2027	EUR	200.000	142.134	0,48
Deutsche Bank AG, V/R	1,88 %	22.12.2028	GBP	100.000	94.252	0,32
Mahle GmbH	2,38 %	14.05.2028	EUR	100.000	77.126	0,26
Schaeffler AG	3,38 %	12.10.2028	EUR	100.000	90.550	0,31
Vonovia SE	1,88 %	28.06.2028	EUR	200.000	174.734	0,59
ZF Finance GmbH	2,25 %	03.05.2028	EUR	100.000	84.939	0,29
Gibraltar					1.077.684	3,64
888 Acquisitions Ltd.	7,56 %	15.07.2027	EUR	100.000	92.503	0,31
Indien						
Bharti Airtel Ltd.	3,25 %	03.06.2031	USD	319.000	248.752	0,84
Irland AIB Group PLC	1,88 %	19.11.2029	EUR	100.000	95.218	0,32
Bank of Ireland Group PLC, V/R	1,38 %	11.08.2031	EUR	100.000	88.918	0,30
ESB Finance DAC	4,00 %	03.10.2028	EUR	100.000	99.955	0,34
Permanent TSB Group Holdings PLC, V/R	3,00 %	19.08.2031	EUR	100.000	89.322	0,30
Ryanair DAC	2,88 %	15.09.2025	EUR	190.000	185.938	0,63
,					559.351	1,89

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Italien						
Autostrade per l'Italia SpA	2,00 %	15.01.2030	EUR	200.000	167.386	0,57
Lottomatica SpA	9,75 %	30.09.2027	EUR	100.000	107.990	0,36
Nexi SpA	1,75 %	31.10.2024	EUR	33.000	32.152	0,11
Telecom Italia SpA	7,88 %	31.07.2028	EUR	115.000	119.396	0,40
Luxemburg					426.924	1,44
Aroundtown SA	0,63 %	09.07.2025	EUR	400.000	355.906	1,20
Aroundtown SA	0,38 %	15.04.2027	EUR	100.000	76.127	0,26
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	1,75 %	12.03.2029	EUR	302.000	237.540	0,80
CPI Property Group SA	2,75 %	22.01.2028	GBP	111.000	90.977	0,31
Mexiko					760.550	2,57
Mexico Government International Bond	2,25 %	12.08.2036	EUR	192.000	135.345	0,46
Niederlande						
Ashland Services BV	2,00 %	30.01.2028	EUR	100.000	85.003	0,29
ASR Nederland NV, V/R	7,00 %	07.12.2043	EUR	103.000	106.054	0,36
Bharti Airtel International Netherlands BV	5,35 %	20.05.2024	USD	200.000	187.988	0,64
EDP Finance BV	3,63 %	15.07.2024	USD	200.000	185.099	0,63
EnBW International Finance BV	4,05 %	22.11.2029	EUR	68.000	67.889	0,23
ING Groep NV	3,00 %	18.02.2026	GBP	100.000	107.938	0,36
JAB Holdings BV	3,38 %	17.04.2035	EUR	200.000	173.178	0,59
OI European Group BV	2,88 %	15.02.2025	EUR	100.000	97.498	0,33
Stellantis NV	4,50 %	07.07.2028	EUR	160.000	161.173	0,54
Toyota Motor Finance Netherlands BV	4,63 %	08.06.2026	GBP	104.000	117.442	0,40
United Group BV	4,00 %	15.11.2027	EUR	125.000	109.385	0,37
Universal Music Group NV	3,00 %	30.06.2027	EUR	145.000	140.482	0,47
Villa Dutch Bidco BV	9,00 %	03.11.2029	EUR	100.000	98.000	0,33
Volkswagen Financial Services NV	3,25 %	13.04.2027	GBP	200.000	208.294	0,70
Volkswagen International Finance NV, V/R	4,38 %	31.12.2099	EUR	100.000	81.400	0,27
ZF Europe Finance BV	2,50 %	23.10.2027	EUR	100.000	87.505	0,30 6,81
Norwegen						,
DNB BANK ASA, V/R	1,38 %	02.12.2025	GBP	231.000	252.057	0,85
Panama Carnival Corp.	7,63 %	01.03.2026	EUR	100.000	98.694	0,34
Carnival Corp.	7,00 %	15.08.2029	USD	23.000	21.441	0,07
	1,00 /0	10.00.2020	000	20.000	120.135	0,07
Peru						,
Peruvian Government International Bond	1,25 %	11.03.2033	EUR	230.000	167.916	0,57
Rumänien Romanian Government International Bond	2,63 %	02.12.2040	EUR	143.000	84.460	0,29
Saudi-Arabien	0.00.07	10.01.0001	1100			0.75
Saudi Arabian Oil Co. Südafrika	2,88 %	16.04.2024	USD	239.000	221.632	0,75
Republic of South Africa Government Bond	8,25 %	31.03.2032	ZAR	5.664.000	231.984	0,79
Republic of South Africa Government International Bond	5,88 %	20.04.2032	USD	200.000	160.912	0,54
Spanien					392.896	1,33
Banco Santander SA	5,29 %	18.08.2027	USD	200.000	182.773	0,62
Cellnex Finance Co. SA	2,00 %	15.02.2033	EUR	200.000	154.657	0,52
Grifols SA	1,63 %	15.02.2025	EUR	100.000	96.673	0,32
International Consolidated Airlines Group SA	3,75 %	25.03.2029	EUR	100.000	87.004	0,29
Merlin Properties Socimi SA	1,38 %	01.06.2030	EUR	100.000	78.402	0,26
Merlin Properties Socimi SA	1,88 %	04.12.2034	EUR	100.000	70.051	0,24
					669.560	2,26
Supranational JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co./JBS USA Finance,						
Inc.	5,50 %	15.01.2030	USD	205.000	180.948	0,61
Schweiz		15 16				
Credit Suisse AG	1,13 %	15.12.2025	GBP	170.000	176.588	0,60
Credit Suisse Group AG, V/R	2,13 %	12.09.2025	GBP	100.000	110.338	0,37
UBS Group AG, V/R	0,25 %	03.11.2026	EUR	200.000	181.656	0,61
					468.582	1,58

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Vereinigte Arabische Emirate						
DP World Ltd. First Abu Dhabi Bank PJSC	4,25 %	25.09.2030	GBP	100.000	101.532	0,34
First Abu Dhabi Bank PJSC	1,13 %	07.09.2026	GBP	123.000	122.702	0,42
Vereinigtes Königreich					224.234	0,76
Anglo American Capital PLC	3,63 %	11.09.2024	USD	200.000	184.258	0,62
Anglo American Capital PLC	1,63 %	11.03.2026	EUR	147.000	138.829	0,47
Barclays PLC, V/R	4,92 %	08.08.2030	EUR	100.000	98.651	0,33
Barclays PLC, V/R	8,41 %	14.11.2032	GBP	100.000	117.741	0,40
Coventry Building Society	1,88 %	24.10.2023	GBP	151.000	173.674	0,59
DWR Cymru Financing U.K. PLC Experian Finance PLC	1,63 % 0,74 %	31.03.2026 29.10.2025	GBP GBP	135.000 155.000	139.848 162.661	0,47 0,55
Haleon UK Capital PLC	2,88 %	29.10.2028	GBP	173.000	177.495	0,55
HSBC Holdings PLC, V/R	1,75 %	24.07.2027	GBP	179.000	182.424	0,62
Investec PLC, V/R	2,63 %	04.01.2032	GBP	203.000	192.277	0,65
Iron Mountain U.K. PLC	3,88 %	15.11.2025	GBP	100.000	109.086	0,37
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,88 %	15.01.2028	USD	240.000	204.064	0,69
Kane Bidco Ltd.	6,50 %	15.02.2027	GBP	100.000	105.555	0,36
Land Securities Capital Markets PLC	1,97 %	08.02.2024	GBP	100.000	113.657	0,38
Leeds Building Society, V/R Legal & General Group PLC, V/R	1,50 % 4,50 %	16.03.2027 01.11.2050	GBP GBP	255.000 100.000	261.269 98.220	0,88 0,33
Lloyds Banking Group PLC, V/R	4,50 %	11.01.2029	EUR	320.000	316.573	0,33 1,07
Market Bidco Finco PLC	5,50 %	04.11.2027	GBP	100.000	98.109	0,33
Marks & Spencer PLC	3,75 %	19.05.2026	GBP	100.000	108.338	0,37
National Express Group PLC	2,50 %	11.11.2023	GBP	130.000	149.221	0,50
Nationwide Building Society	0,25 %	22.07.2025	EUR	179.000	167.002	0,56
Nationwide Building Society, V/R	6,18 %	07.12.2027	GBP	121.000	138.368	0,47
NatWest Group PLC, V/R	2,06 %	09.11.2028	GBP	169.000	165.543	0,56
NatWest Group PLC, V/R	5,13 %	31.12.2099	GBP	200.000	190.719	0,65
Pension Insurance Corp. PLC	3,63 %	21.10.2032	GBP	108.000	92.379	0,31
Pinewood Finance Co. Ltd Rolls-Royce PLC	3,25 % 5,75 %	30.09.2025 15.10.2027	GBP GBP	100.000 100.000	108.445 109.779	0,37 0,37
Santander U.K. Group Holdings PLC, V/R	2,92 %	08.05.2026	GBP	215.000	233.175	0,37
Synthomer PLC	3,88 %	01.07.2025	EUR	100.000	95.891	0,73
Tesco Corporate Treasury Services PLC	2,50 %	02.05.2025	GBP	185.000	204.144	0,69
Tesco Corporate Treasury Services PLC	1,88 %	02.11.2028	GBP	200.000	190.845	0,65
Virgin Money U.K. PLC, V/R	4,00 %	25.09.2026	GBP	147.000	158.769	0,54
Vmed O2 U.K. Financing I PLC	4,50 %	15.07.2031	GBP	100.000	90.643	0,31
Yorkshire Building Society	0,50 %	01.07.2028	EUR	176.000	145.998	0,49
Yorkshire Building Society, V/R	3,38 %	13.09.2028	GBP	130.000	128.907	0,44
USA					5.352.557	18,10
Ally Financial, Inc.	1,45 %	02.10.2023	USD	206.000	194.569	0,66
American Tower Corp.	0,45 %	15.01.2027	EUR	204.000	179.488	0,61
Amgen, Inc.	5,25 %	02.03.2030	USD	238.000	219.738	0,74
Bayer U.S. Finance II LLC	4,25 %	15.12.2025	USD	375.000	341.125	1,15
Broadcom, Inc.	3,19 %	15.11.2036	USD	185.000	125.576	0,42
Caesars Entertainment, Inc.	4,63 %	15.10.2029	USD	175.000	140.202	0,47
Callon Petroleum Co.	7,50 %	15.06.2030	USD	80.000	73.358	0,25
Catalent Pharma Solutions, Inc.	2,38 %	01.03.2028	EUR	100.000	84.000	0,28
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp. Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK	4,50 %	15.08.2030	USD	160.000	124.243	0,42
Financing Co., Inc.	8,00 %	15.06.2029	USD	62.000	58.467	0,20
Citigroup, Inc.	2,75 %	24.01.2024	GBP	213.000	243.158	0,82
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	9,00 %	15.09.2028	USD	50.000	46.820	0,16
Coty, Inc.	5,75 %	15.09.2028	EUR	100.000	100.965	0,34
Discovery Communications LLC	2,50 %	20.09.2024	GBP	209.000	232.965	0,79
DISH DBS Corp.	5,75 %	01.12.2028	USD	80.000	58.229	0,20
EQM Midstream Partners LP	4,50 %	15.01.2029	USD	192.000	161.704	0,55
Fidelity National Information Services, Inc. Ford Motor Credit Co. LLC	1,65 % 4,54 %	01.03.2028 06.03.2025	USD GBP	267.000 118.000	213.650 130.938	0,72 0,44
GE HealthCare Technologies, Inc.	5,65 %	15.11.2027	USD	992.000	935.953	3,16
General Motors Financial Co., Inc.	2,35 %	03.09.2025	GBP	100.000	107.314	0,36
General Motors Financial Co., Inc.	4,30 %	15.02.2029	EUR	278.000	269.188	0,91
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5,25 %	01.06.2025	USD	220.000	203.696	0,69
Goldman Sachs Group, Inc.	4,25 %	29.01.2026	GBP	100.000	111.374	0,38
HCA, Inc.	4,50 %	15.02.2027	USD	150.000	135.228	0,46
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6,00 %	15.04.2030	USD	100.000	85.076	0,29
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6,00 %	01.02.2031	USD	30.000	25.038	0,08
International Business Machines Corp.	3,38 %	06.02.2027	EUR	219.000	215.454	0,73
IQVIA, Inc. Kraft Heinz Foods Co.	2,25 % 5,50 %	15.03.2029 01.06.2050	EUR USD	100.000 167.000	83.951 143.964	0,28 0,49
1 Galt 1 Bill 1 0003 00.	3,30 %	01.00.2000				
	5.25 %	01.06.2026	USD	120.000	111.749	0.38
Lennar Corp. Meritage Homes Corp.	5,25 % 3,88 %	01.06.2026 15.04.2029	USD USD	120.000 130.000	111.749 105.741	0,38 0,36

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Morgan Stanley, V/R	5,79 %	18.11.2033	GBP	115.000	128.716	0,43
NCR Atleos Escrow Corp.	9,50 %	01.04.2029	USD	70.000	64.290	0,22
Netflix, Inc.	3,63 %	15.05.2027	EUR	210.000	205.870	0,70
New York Life Global Funding	1,63 %	15.12.2023	GBP	150.000	171.498	0,58
New York Life Global Funding	3,63 %	09.01.2030	EUR	242.000	236.085	0,80
NFP Corp.	8,50 %	01.10.2031	USD	61.000	57.764	0,20
Olympus Water U.S. Holding Corp.	9,63 %	15.11.2028	EUR	125.000	125.155	0,42
OneMain Finance Corp.	9,00 %	15.01.2029	USD	68.000	64.083	0,22
Permian Resources Operating LLC	5,88 %	01.07.2029	USD	160.000	142.573	0,48
Permian Resources Operating LLC	7,00 %	15.01.2032	USD	46.000	42.960	0,15
Spectrum Brands, Inc.	3,88 %	15.03.2031	USD	180.000	138.122	0,47
Star Parent, Inc.	9,00 %	01.10.2030	USD	33.000	31.533	0,11
Tenet Healthcare Corp.	4,88 %	01.01.2026	USD	200.000	181.160	0,61
Transocean Aquila Ltd.	8,00 %	30.09.2028	USD	14.000	13.233	0,04
Venture Global Calcasieu Pass LLC	6,25 %	15.01.2030	USD	100.000	90.182	0,30
Venture Global LNG, Inc.	8,38 %	01.06.2031	USD	145.000	134.750	0,46
Verizon Communications, Inc.	2,10 %	22.03.2028	USD	144.000	116.908	0,40
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5,63 %	01.05.2024	USD	165.000	154.988	0,52
					7.568.251	25,59
ANLEIHEN GESAMT					27.334.186	92,41
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODEF ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	R AN EINEM ANDER	EN GEREGELTEN I	MARKT NOTIERTE	I	27.334.186	92,41
ANLAGEN INSGESAMT					27.334.186	92,41
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)					2.245.237	7,59
GESAMTES NETTOVERMÖGEN					29.579.423	100,00

DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

DEVISENTERMINKONT	NANTE				Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	in EUR
Nicht realisierter Gewin	nn aus Devisenterminkon	trakten			
EUR	8.639.703	GBP	(7.442.093)	24.10.2023	66.585
ZAR	113.341	EUR	(5.648)	24.10.2023	19
ZAR	114.242	EUR	(5.694)	24.10.2023	18
Summe des nicht reali	sierten Gewinns aus Dev	senterminkontrakten			66.622
Nicht realisierter Verlu	st aus Devisenterminkon	trakten			
EUR	2.880.917	USD	(3.145.840)	24.10.2023	(87.803)
EUR	135.423	USD	(147.912)	24.10.2023	(4.162)
EUR	2.397.249	USD	(2.621.534)	24.10.2023	(76.684)
EUR	2.295.908	USD	(2.512.497)	24.10.2023	(75.128)
EUR	247.537	ZAR	(5.043.251)	24.10.2023	(4.627)
JPY	926.089	EUR	(5.917)	31.10.2023	(35)
JPY	4.980	EUR	(32)	31.10.2023	(0)
USD	184.950	EUR	(175.278)	24.10.2023	(741)
USD	286.913	EUR	(273.023)	31.10.2023	(2.343)
USD	10.080	EUR	(9.577)	31.10.2023	(67)
Summe des nicht reali	sierten Verlusts aus Devi	senterminkontrakten			(251.590)

#### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten		· · ·			•
Australia Treasury Note 10YR	AUD	(15)	15.12.2023	(1.023.857)	27.424
EURO-BTP Future	EUR	(3)	07.12.2023	(329.190)	12.270
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	(9)	07.12.2023	(1.157.760)	2.220
German Federal Republic Bond 2YR	EUR	12	07.12.2023	1.259.880	1.995
German Federal Republic Bond 30YR	EUR	(2)	07.12.2023	(244.720)	16.760
Japan Government Bond 10YR	JPY	(8)	13.12.2023	(7.340.119)	60.441
US Treasury Note 2YR	USD	(16)	29.12.2023	(3.063.400)	8.499
US Treasury Ultra 30YR	USD	(4)	19.12.2023	(448.406)	32.999
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
insgesamt				(12.347.572)	162.608
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
Australia Treasury Note 3YR	AUD	45	15.12.2023	2.889.658	(21.796)
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	8	07.12.2023	926.000	(9.040)
UK Long Gilt Future	GBP	(4)	27.12.2023	(434.199)	(3.003)
US Treasury Note 10YR	USD	56	19.12.2023	5.715.702	(122.023)
US Treasury Note 5YR	USD	28	29.12.2023	2.786.364	(23.967)
US Treasury Ultra 10YR	USD	6	19.12.2023	632.231	(19.215)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten insgesam	nt			12.515.756	(199.044)

SWAPKONTRAKTE

				Marktwert in	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Währung	Nennbetrag	Zahlung/Einnahme	Fälligkeitsdatum	EUR	in EUR
Credit Defa	ult Swaps				
EUR	1.400.000	1,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Index	20.12.2027	(18.873)	(25.957)
EUR	1.406.000	5,000 % / Markit Markit iTraxx Europe Crossover Index	20.12.2027	(83.851)	(47.645)
USD	2.300.000	1,000 % / Markit Markit CDX IG Index	20.12.2027	(29.919)	3.743
USD	2.000.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.12.2027	(46.894)	32.017
USD	2.400.000	5,000 % / Markit Markit CDX HY Index	20.06.2028	(48.426)	(24.564)
Credit Defa	ault Swaps insg	Jesamt		(227.963)	(62.406)
Inflationss	waps				
GBP	500.000	4,122 % / UK Retail Prices Index	15.08.2028	(55)	(55)
GBP	500.000	UK Retail Prices Index / 3,909 %	15.08.2033	1.845	1.846
Summe Inf	lationsswaps			1.790	1.791
Zinsswaps					
AUD	5.000.000	2,529 % / BBSW 6M	17.02.2032	461,266	37.162
AUD	2.200.000	2,529 % / BBSW 6M	17.02.2032	202.957	18.629
AUD	7.200.000	BBSW 6M / 2,529 %	17.02.2032	(664.223)	(664.223)
EUR	2.940.000	1,450 % / EURIBOR 6M	09.07.2048	881.482	881.481
EUR	2.940.000	EURIBOR 3M / 1,408 %	09.07.2048	(937.071)	(937.071)
EUR	1.100.000	EURIBOR 6M / 3,052 %	15.08.2032	(26.019)	(26.019)
EUR	400.000	EURIBOR 6M / 3,220 %	20.09.2028	(3.262)	(3.916)

Nährung	Nennbetrag	Zahlung/Einnahme	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in EUR
EUR	400.000	EURIBOR 6M / 3,220 %	20.09.2028	(3.262)	(3.077)
EUR	1.100.000	EURIBOR 6M / 3,242 %	15.08.2032	(7.844)	(7.844)
GBP	1.300.000	3,790 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	03.11.2032	66.449	70.372
GBP	8.000.000	4,300 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	22.03.2025	153.367	782
GBP	1.700.000	4,300 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	22.03.2025	32.590	(185)
GBP	3.950.000	4,420 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	03.11.2024	40.394	3.720
GBP	1.700.000	4,420 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	03.11.2024	17.385	137
GBP	800.000	5,441 % / WMBA Sonia Interest Rate Benchmark	20.07.2025	(4.020)	(7.078)
GBP	900.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 3,790 %	03.11.2032	(46.003)	(16.676)
GBP	400.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 3,790 %	03.11.2032	(20.446)	(4.709)
GBP	11.400.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 4,300 %	22.03.2025	(218.547)	(223.160)
GBP	5.650.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 4,420 %	03.11.2024	(57.778)	(57.711)
GBP	1.600.000	WMBA Sonia Interest Rate Benchmark / 5,600 %	20.07.2025	13.532	13.244
ILS	6.500.000	3,136 % / TELBOR 3M	15.03.2028	52.697	(30.335)
ILS	2.000.000	3,656 % / TELBOR 3M	20.09.2028	14.625	18.212
ILS	4.700.000	3,748 % / TELBOR 3M	15.03.2028	5.961	2.072
ILS	11.200.000	TELBOR 3M / 3,136 %	15.03.2028	(90.801)	(90.801)
ILS	3.200.000	TELBOR 3M / 3,656 %	20.09.2028	(23.400)	(23.400)
ILS	3.600.000	TELBOR 3M / 3,656 %	20.09.2028	(26.325)	(19.826)
MXN	13.400.000	Mexiko - 28-Tages-Interbankenzinssatz / 8,351 %	13.09.2028	(36.485)	(36.485)
PLN	1.800.000	4,533 % / WIBOR 6M	20.09.2028	(447)	(447)
PLN	1.800.000	4,533 % / WIBOR 6M	20.09.2028	(447)	(2.935)
ZAR	37.500.000	8,070 % / LIBOR 3M	15.03.2028	47.711	47.711
ZAR	26.000.000	8,210 % / LIBOR 3M	21.06.2028	30.507	(9.618)
ZAR	26.600.000	8,210 % / LIBOR 3M	21.06.2028	31.211	(9.891)
ZAR	11.400.000	8,210 % / LIBOR 3M	21.06.2028	13.376	8.316
ZAR	64.000.000	LIBOR 3M / 8,210 %	21.06.2028	(75.095)	(67.071)
ZAR	37.500.000	LIBOR 3M / 8,520 %	15.03.2028	(16.288)	(89.292)
Summe Zir	nsswaps			(192.253)	(1.229.932)

Nicht realisierter Verlust aus Swaps

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, BNP Paribas S.A., HSBC Bank Plc., JP Morgan Securities Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Kontrahenten bei Swaps waren Morgan Stanley & Co. International Plc. und JP Morgan Securities Plc.

(2.429.991)

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Global Total Return Bond Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Werbung	0,16
Vertrieb und Großhandel	0,33
Einzelhandel	0,37
Luftfahrt und Verteidigung	0,37
Halbleiter	0,42
Haushaltswaren	0,47
Wasserwirtschaft	0,47
Transport und Verkehr	0,50
Bau- und Ingenieurswesen	0,52
Verpackungen und Container	0,66
Wohnungsbauunternehmen	0,74
Biotechnologie	0,74
Software	0,92
Fluggesellschaften	0,92
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	0,94
Computer	0,95
Chemikalien	1,03
Pipelines	1,31
Medien	1,41
Metalle und Bergbau	1,52
Internet	1,68
Arzneimittel	1,82
Elektrische Geräte	2,19
Freizeit und Tourismus	2,39
Gewerbliche Dienstleistungen	2,55
Nahrungsmittel und Getränke	2,77
Öl und Gas	3,45
Versicherungen	3,51
Telekommunikation	4,73
Gesundheitswesen	5,20
Automobilzulieferer	6,03
Immobilien	6,23
Staatliche Emittenten	9,06
Finanzdienstleistungen	26,05
· martalonologian	20,00
Anlagen insgesamt	92,41
Sonstige Aktiva / (Passiva)	7,59
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse F Inc EUR eine Rendite von 3,9 %. Im Vergleich dazu erzielte der BBI Euro Aggregate Corporate TR Index eine Rendite von 3,6 %. Die Performance ist die Gesamtrendite nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Während der zwölf Monate behielten wir im Allgemeinen eine konservative Position innerhalb des Fonds bei und hielten das Gesamtrisikoprofil nahe an der Benchmark. Eine leichte Übergewichtung des Kreditrisikos bis Anfang 2023 erwies sich als vorteilhaft, da sich die Kreditspreads verengten. Zwar reduzierten wir diese im Laufe des Sommers angesichts der weiterhin robusten Wirtschaftsaussichten und Unternehmensergebnisse, erhöhten jedoch das Kreditrisiko im Portfolio, gemessen am Produkt aus Duration und Spread, bis Ende September auf 106 % des Index. Dies war auch von Vorteil, da sich die Kreditspreads in diesem Berichtszeitraum verengten. Wir behielten während des größten Teils des Berichtszeitraums eine leicht untergewichtete Durationsposition bei, was sich angesichts steigender Anleiherenditen und Zinssätze positiv auf die Performance auswirkte. Jedoch erhöhten wir die Duration (Zinssensitivität) geringfügig, als sich die Zinssätze ihrem erwarteten Höchststand näherten. Dies schmälerte die Performance, da die Anleiherenditen weiter stiegen und die Zinsstrukturkurve steiler wurde.

### Marktrückblick

Die europäischen Unternehmensanleihen erzielten in den letzten zwölf Monaten positive Renditen. Während die Zinssätze und die Renditen von Staatsanleihen über weite Strecken des Berichtszeitraums stiegen, deutete die Europäische Zentralbank an, dass ihre Erhöhung auf 4,50 % im September die letzte war. Gleichzeitig warnte sie jedoch davor, dass die Zinssätze "länger höher" bleiben würden, was dazu führte, dass kurzfristige Anleihen in der Erwartung, dass die Zinssätze nicht weiter steigen würden deutlich zulegten, während längerfristige Anleihen fielen, da die Erwartungen für Zinssenkungen nach hinten verschoben wurden. Damit waren Unternehmensanleihen unterm Strich die Gewinner gegenüber Staatsanleihen, da sie eine kürzere durchschnittliche Duration aufweisen, aber die Renditen der einzelnen Anleihen wichen in Abhängigkeit von der Duration voneinander ab. Die Kreditspreads verengten sich geringfügig, da die Unternehmensergebnisse weiterhin robust waren und die Wirtschaft einer Rezession entging. Während sich im vierten Quartal 2022 die Kreditspreads aufgrund zunehmender Rezessionsängste weiteten, kehrten die Anleger gegen Ende 2022 an die Anleihemärkte zurück, angezogen von höheren Renditen und in der Hoffnung, dass die Zentralbanken hre aggressiven Zinserhöhungen drosseln würden. Nach einem für Anleiheemittenten schwierigen Jahr 2022 kam es Anfang 2023 zu einer regen Aktivität, und das Jahr setzte sich mit einem normaleren Niveau an Neuemissionen fort. Die Renditen begannen zu sinken, als sich die wirtschaftlichen Sorgen von der hohen Inflation auf die Verlangsamung des Wirtschaftswachstums verlagerten und die Anleiheanleger wieder optimistischer wurden. Die hartnäckige Inflation im Februar führte jedoch zu einer Neubewertung des erwarteten Zinssenkungszeitpunkts, und die Renditen stiegen wieder. Im weiteren Verlauf des ersten Quartals führten die Sorgen um die Gesundheit des Bankensystems zu weiterer Volatilität, die in einer vorübergehenden Weitung der Kreditspreads zwischen Junk- und Investment-Grade-Anleihen resultierten. Zum Ende des Berichtszeitraums verengten sich die Kreditspreads für Unternehmensanleihen moderat, da Cashflow und Bilanzen weiterhin solide blieben. Vorläufigen Schätzungen zufolge ging die Inflation in der Eurozone im September auf 4,3 % zurück, die Kerninflation sank auf 4,5 %. Die Europäische Zentralbank (EZB) straffte ihre Geldpolitik und folgte damit dem Beispiel der USA und anderer Länder. Außerdem kündigte sie eine quantitative Straffung (d. h. sie wird nicht alle Erlöse aus fällig werdenden Anleihen in ihrem Portfolio reinvestieren), ab März 2023 an.

### Ausblick

Die Aussichten für Euro-IG-Kredite scheinen recht ausgewogen zu sein. Das Risiko einer Rezession ist in Europa höher als in den USA, aber eine solche Kontraktion würde wahrscheinlich mild ausfallen. Die Kerninflation geht zurück, und das Lohnwachstum scheint seinen Höhepunkt erreicht zu haben. In Europa wird die Kombination aus geringem Wirtschaftswachstum (oder leichter Rezession) und sinkender Inflation unserer Meinung nach zu schnelleren Zinssenkungen führen, als die Märkte derzeit erwarten. In der Zwischenzeit bleibt die restriktive Geldpolitik jedoch ein Gegenwind für die Verengung der Spreads. Was die Gesundheit der Unternehmen betrifft, so erwarten wir, dass die Kreditqualität weiterhin gut bleibt. Darüber hinaus sind Euro-IG-Titel – deren Spreads zum Monatsende über dem 5- und 20-Jahres-Durchschnitt lagen – nach wie vor relativ attraktiv bewertet, insbesondere im Vergleich zu einen auf US-Dollar lautenden Pendants. Und schließlich lag die Rendite des Euro-IG-Marktes deutlich über dem 20-Jahres-Durchschnitt – eine "gute Nachricht" für alle, die auf der Suche nach Erträgen sind.

#### Andrew Brown Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE OD	ER AN EINEM ANDER	EN GEREGELTEN N	ARKT NOTIERTE	ÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIER	E
ANLEIHEN						
Australien						
Australia & New Zealand Banking Group Ltd., V/R	5,10 %	03.02.2033	EUR	335.000	330.562	0,75
Commonwealth Bank of Australia, V/R	1,94 %	03.10.2029	EUR	227.000	218.452	0,50
Telstra Corp. Ltd	1,38 %	26.03.2029	EUR	547.000	480.366	1,09
Westpac Banking Corp.	0,88 %	17.04.2027	EUR	194.000	174.447	0,40
Belgien					1.203.827	2,74
KBC Group NV, V/R	0,63 %	07.12.2031	EUR	400.000	346.591	0,79
Dänemark Danske Bank AS, V/R	1,00 %	15.05.2031	EUR	228.000	204.751	0,46
Finnland						
Nordea Bank Abp	0,38 %	28.05.2026	EUR	250.000	228.643	0,52
Frankreich AXA SA, V/R	3,38 %	06.07.2047	EUR	203.000	191.730	0,44
AXA SA, V/R	3,88 %	20.05.2049	EUR	201.000	195.246	0,44
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,10 %	08.10.2027	EUR	400.000	342.743	0,78
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4,13 %	18.09.2030	EUR	100.000	98.890	0,22
BNP Paribas Cardif SA, V/R	4,03 %	29.11.2049	EUR	100.000	96.509	0,22
BNP Paribas SA, V/R	0,50 %	19.02.2028	EUR	200.000	174.597	0,40
BNP Paribas SA, V/R	4,38 %	13.01.2029	EUR	500.000	496.793	1,13
BNP Paribas SA, V/R	2,50 %	31.03.2032	EUR	100.000	90.080	0,20
BPCE SA	0,13 %	04.12.2024	EUR	800.000	765.078	1,74
Credit Agricole SA	1,88 %	20.12.2026	EUR	500.000	466.101	1,06
Engle SA	1,38 %	21.06.2039	EUR	200.000	127.887	0,29
Engie SA	4,25 %	11.01.2043	EUR	200.000	187.176	0,43
Imerys SA	1,00 %	15.07.2031	EUR	200.000	149.986	0,34
Orange SA	1,25 %	07.07.2027	EUR	200.000	182.758	0,42
Orange SA	0,13 %	16.09.2029	EUR	100.000	80.898	0,18
Orange SA, V/R	5,00 %	29.10.2049	EUR	240.000	239.401	0,54
Orange SA, V/R	1,75 %	31.12.2099	EUR	200.000	168.007	0,38
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR	1,50 %	27.09.2030	EUR	300.000	257.714	0,59
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR	0,75 %	12.01.2034	EUR	200.000	147.943	0,34
Schneider Electric SE	0,25 %	11.03.2029	EUR	500.000	417.495	0,95
Societe Generale SA, V/R	0,88 %	22.09.2028	EUR	700.000	605.116	1,38
Suez SA, V/R	2,88 %	31.12.2099	EUR	300.000	296.629	0,67
Suez SACA	4,63 %	03.11.2028	EUR	200.000	202.750	0,46
Suez SACA	2,38 %	24.05.2030	EUR	600.000	532.019	1,21
Unibail-Rodamco-Westfield SE	1,00 %	27.02.2027	EUR	200.000	179.695	0,41
Device ships d					6.693.241	15,22
Deutschland Allianz SE, V/R	2,60 %	31.12.2099	EUR	200.000	130.880	0,30
Allianz SE, V/R	3,38 %	31.12.2099	EUR	200.000	195.596	0,30
Commerzbank AG	3,38 % 1,88 %	28.02.2028	EUR	500.000	449.254	0,45
Deutsche Bank AG, V/R	1,88 %	23.02.2028	EUR	900.000	805.064	1,02
E.ON SE	0,38 %	29.09.2027	EUR	288.000	252.079	0,57
E.ON SE EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, V/R	1,38 %	31.08.2081	EUR	300.000	240.049	0,55
Mercedes-Benz Group AG	0,75 %	10.09.2030	EUR	136.000	240.049 110.301	0,55
Talanx AG, V/R	1,75 %	01.12.2042	EUR	300.000	221.365	0,25
Vonovia SE	0,63 %	24.03.2031	EUR	200.000	145.361	0,30
ZF Finance GmbH	2,00 %	06.05.2027	EUR	200.000	175.639	0,30
					2.725.588	6,20
Irland AIB Group PLC, V/R	E 7E 0/	16.02.2020	EUD	414.000	400 000	0.07
	5,75 %	16.02.2029	EUR	414.000	426.699	0,97
Bank of Ireland Group PLC, V/R	4,88 %	16.07.2028	EUR	328.000	330.420	0,75
Bank of Ireland Group PLC, V/R	1,38 %	11.08.2031	EUR	602.000	535.283	1,22
CRH Finance DAC	1,38 %	18.10.2028	EUR	496.000	437.112	0,99
	1,25 %	05.11.2026	EUR	100.000	92.120	0,21
CRH SMW FINANCE DAC	1,25 %	05.11.2026	EUR	274.000	252.408	0,57
CRH SMW FINANCE DAC	4,25 %	11.07.2035	EUR	100.000	96.434	0,22
Experian Europe DAC	1,56 %	16.05.2031	EUR	450.000	377.826	0,86
Kerry Group Financial Services Unltd Co.	0,88 %	01.12.2031	EUR	252.000	196.376	0,45
Vodafone International Financing DAC	3,75 %	02.12.2034	EUR	193.000	181.235	0,41
					2.925.913	6,65

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Italien						
Intesa Sanpaolo SpA	0,75 %	16.03.2028	EUR	358.000	304.465	0,69
Terna - Rete Elettrica Nazionale, V/R	2,38 %	31.12.2099	EUR	200.000	172.936	0,39
Luxemburg					477.401	1,08
Aroundtown SA	0,38 %	15.04.2027	EUR	400.000	304.508	0,69
AXA Logistics Europe Master SCA	0,88 %	15.11.2029	EUR	264.000	208.763	0,48
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	1,63 %	20.04.2030	EUR	343.000	255.302	0,58
Nestle Finance International Ltd.	1,50 %	29.03.2035	EUR	312.000	245.327	0,56
Novartis Finance SA	1,63 %	09.11.2026	EUR	531.000	499.182	1,14
Prologis International Funding II SA	1,75 %	15.03.2028	EUR	475.000	427.603	0,97
Prologis International Funding II SA Segro Capital Sarl	3,13 % 1,88 %	01.06.2031 23.03.2030	EUR EUR	111.000 100.000	98.349 85.015	0,22
Segio Capital Sali	1,00 70	23.03.2030	EUK	100.000	2.124.049	0,19 <b>4,83</b>
Niederlande					2.124.049	4,03
ABN AMRO Bank NV, V/R	4,38 %	31.12.2099	EUR	200.000	182.896	0,42
Akzo Nobel NV	1,63 %	14.04.2030	EUR	428.000	363.988	0,83
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance						
Co. Ltd., V/R	3,50 %	01.10.2046	EUR	254.000	240.983	0,55
Compass Group Finance Netherlands BV	3,00 %	08.03.2030	EUR	438.000	412.594	0,94
Cooperatieve Rabobank UA	1,25 %	23.03.2026	EUR	237.000	224.093	0,51
Digital Dutch Finco BV EDP Finance BV	1,00 % 1,88 %	15.01.2032 21.09.2029	EUR EUR	359.000 100.000	259.544 87.968	0,59 0,20
Enel Finance International NV	1,50 %	21.07.2025	EUR	150.000	143.555	0,20
Enexis Holding NV	0,63 %	17.06.2032	EUR	100.000	77.093	0,17
Iberdrola International BV, V/R	3,25 %	31.12.2099	EUR	400.000	390.150	0,89
ING Groep NV, V/R	0,25 %	01.02.2030	EUR	200.000	158.385	0,36
ING Groep NV, V/R	0,25 %	01.02.2030	EUR	400.000	316.771	0,72
ING Groep NV, V/R	4,75 %	23.05.2034	EUR	200.000	197.536	0,45
ING Groep NV, V/R	4,75 %	23.05.2034	EUR	200.000	197.536	0,45
Koninklijke KPN NV	3,88 %	03.07.2031	EUR	500.000	484.616	1,10
Mondelez International Holdings Netherlands BV	0,25 %	09.09.2029	EUR	432.000	349.279	0,79
OI European Group BV	2,88 %	15.02.2025	EUR	210.000	204.745	0,46
Telefonica Europe BV, V/R	6,75 %	31.12.2099	EUR	100.000	98.902	0,22
Telefonica Europe BV, V/R TenneT Holding BV	7,13 % 2,75 %	31.12.2099 17.05.2042	EUR EUR	200.000 241.000	205.750 205.993	0,47 0,47
Volkswagen International Finance NV	3,75 %	28.09.2027	EUR	200.000	194.669	0,47
Volkswagen International Finance NV	0,88 %	22.09.2028	EUR	900.000	755.006	1,72
Volkswagen International Finance NV	4,38 %	15.05.2030	EUR	300.000	294.383	0,67
Vonovia Finance BV	2,25 %	07.04.2030	EUR	200.000	168.893	0,38
					6.215.328	14,13
Norwegen						
DNB BANK ASA, V/R	3,13 %	21.09.2027	EUR	301.000	292.743	0,67
Spanien						
Banco Santander SA	0,30 %	04.10.2026	EUR	300.000	269.426	0,61
CaixaBank SA, V/R	0,38 %	18.11.2026	EUR	400.000	365.274	0,83
CaixaBank SA, V/R	0,50 %	09.02.2029	EUR	500.000	417.063	0,95
					1.051.763	2,39
Supranational						
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial	0,15 %	10.10.2034	EUR	247.000	171.448	0,39
Schweden	0,10 /0	1011012001	2011	2		0,00
Svenska Handelsbanken AB	1,00 %	15.04.2025	EUR	167.000	159.522	0,36
Svenska Handelsbanken AB	3,75 %	01.11.2027	EUR	410.000	406.158	0,92
Swedbank AB, V/R	0,30 %	20.05.2027	EUR	518.000	464.432	1,06
					1.030.112	2,34
Vereinigtes Königreich						2,01
AstraZeneca PLC	0,38 %	03.06.2029	EUR	533.000	442.040	1,01
Aviva PLC, V/R	3,38 %	04.12.2045	EUR	262.000	250.279	0,57
Cadent Finance PLC	4,25 %	05.07.2029	EUR	142.000	140.550	0,32
Cadent Finance PLC	4,25 %	05.07.2029	EUR	300.000	296.937	0,68
DS Smith PLC	0,88 %	12.09.2026	EUR	250.000	225.792	0,51
DS Smith PLC	4,50 %	27.07.2030	EUR	223.000	218.552	0,50
GlaxoSmithKline Capital Plc	1,38 %	12.09.2029	EUR	214.000	187.733	0,43
Legal & General Group PLC, V/R Lloyds Banking Group PLC, V/R	3,75 % 3,87 %	26.11.2049 09.07.2025	GBP USD	294.000 400.000	281.676 370.538	0,64 0,84
Lloyds Banking Group PLC, V/R	4,50 %	18.03.2030	EUR	259.000	252.745	0,84
Lloyds Banking Group PLC, V/R	4,95 %	31.12.2049	EUR	200.000	186.203	0,37
Marks & Spencer PLC	3,75 %	19.05.2026	GBP	200.000	216.676	0,42
Motability Operations Group PLC	0,88 %	14.03.2025	EUR	115.000	109.822	0,25
Motability Operations Group PLC	0,13 %	20.07.2028	EUR	242.000	201.982	0,46

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeits- datum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Motability Operations Group PLC	3,50 %	17.07.2031	EUR	417.000	398.009	0,90
National Express Group PLC, V/R	4,25 %	31.12.2099	GBP	322.000	321.886	0,73
National Grid PLC	3,25 %	30.03.2034	EUR	476.000	415.793	0,95
Nationwide Building Society	1,00 %	28.08.2025	USD	200.000	172.366	0,39
Nationwide Building Society	0,25 %	14.09.2028	EUR	317.000	260.973	0,59
Nationwide Building Society, V/R	1,50 %	08.03.2026	EUR	400.000	382.530	0,87
Nationwide Building Society, V/R	2,00 %	25.07.2029	EUR EUR	629.000	609.673	1,39
NatWest Group PLC, V/R NatWest Group PLC, V/R	0,78 % 0,78 %	26.02.2030 26.02.2030	EUR	52.000 150.000	41.900 120.867	0,10 0,27
NatWest Group PLC, V/R	5,13 %	31.12.2099	GBP	200.000	190.719	0,27
Northumbrian Water Finance PLC	4,50 %	14.02.2031	GBP	253.000	262.646	0,40
Phoenix Group Holdings PLC	4,38 %	24.01.2029	EUR	441.000	403.449	0,92
Rentokil Initial PLC	0,88 %	30.05.2026	EUR	154.000	142.040	0,32
Rentokil Initial PLC	0,88 %	30.05.2026	EUR	300.000	276.701	0,63
Standard Chartered PLC, V/R	1,20 %	23.09.2031	EUR	300.000	258.960	0,59
Standard Chartered PLC, V/R	4,75 %	31.12.2099	USD	229.000	154.265	0,35
Tesco Corporate Treasury Services PLC	1,38 %	24.10.2023	EUR	300.000	299.522	0,68
Tesco Corporate Treasury Services PLC	0,38 %	27.07.2029	EUR	189.000	150.327	0,34
Tesco Corporate Treasury Services PLC	4,25 %	27.02.2031	EUR	312.000	302.312	0,69
Virgin Money U.K. PLC, V/R	4,00 %	03.09.2027	GBP	500.000	528.008	1,20
Virgin Money U.K. PLC, V/R	4,63 %	29.10.2028	EUR	223.000	215.084	0,49
Yorkshire Building Society	0,50 %	01.07.2028	EUR	265.000	219.826	0,50
Yorkshire Building Society, V/R	3,51 %	11.10.2030	GBP	111.000	107.309	0,24
104					9.616.690	21,86
USA	0,40 %	45.00.0007	EUR	246.000	045 007	0,49
American Tower Corp. Amgen, Inc.	0,40 % 5,25 %	15.02.2027 02.03.2033	USD	246.000 500.000	215.807 451.744	0,49 1,03
Apple, Inc.	1,63 %	10.11.2026	EUR	651.000	615.526	1,03
Bank of America Corp., V/R	0,81 %	09.05.2026	EUR	544.000	514.439	1,40
Bank of America Corp., V/R	0,65 %	26.10.2031	EUR	721.000	551.737	1,25
Booking Holdings, Inc.	3,63 %	12.11.2028	EUR	100.000	98.289	0,22
Broadcom, Inc.	3,19 %	15.11.2036	USD	412.000	279.662	0,64
Centene Corp.	3,00 %	15.10.2030	USD	500.000	381.499	0,87
Chubb INA Holdings, Inc.	1,55 %	15.03.2028	EUR	300.000	269.331	0,61
Chubb INA Holdings, Inc.	2,50 %	15.03.2038	EUR	301.000	234.606	0,53
Citigroup, Inc., V/R	3,71 %	22.09.2028	EUR	350.000	341.827	0,78
Digital Euro Finco LLC	2,50 %	16.01.2026	EUR	403.000	382.718	0,87
Discovery Communications LLC	1,90 %	19.03.2027	EUR	340.000	312.693	0,71
Eli Lilly & Co.	0,50 %	14.09.2033	EUR	542.000	401.239	0,91
Mondelez International, Inc.	1,63 %	08.03.2027	EUR	400.000	372.214	0,85
Paramount Global	4,20 %	19.05.2032	USD	188.000	141.286	0,32
PepsiCo, Inc.	0,75 %	18.03.2027	EUR	844.000	764.418	1,74
Prologis Euro Finance LLC	1,00 %	06.02.2035	EUR	271.000	179.446	0,41
Prologis LP	3,00 %	02.06.2026	EUR	200.000	194.011	0,44
Thermo Fisher Scientific, Inc.	1,50 %	01.10.2039	EUR	329.000	219.517	0,50
Toyota Motor Credit Corp.	0,25 %	16.07.2026	EUR	198.000	179.096	0,41
Toyota Motor Credit Corp.	0,13 %	05.11.2027	EUR	346.000	297.091	0,67
					7.398.196	16,82
ANLEIHEN GESAMT					42.706.284	97,09
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	ODER AN EINEM ANDER	EN GEREGELTEN M	IARKT NOTIERTE		42.706.284	97,09
ANLAGEN INSGESAMT					42.706.284	97,09
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)					1.277.784	2,91
GESAMTES NETTOVERMÖGEN					43.984.068	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

### DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

					Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	in EUR
Nicht realisierter Gev	winn aus Devisenterminkontr	rakten			
EUR	1.950.692	GBP	(1.680.293)	24.10.2023	15.034
EUR	8.603	GBP	(7.460)	31.10.2023	10
USD	136.132	EUR	(127.471)	24.10.2023	996
Summe des nicht rea	alisierten Gewinns aus Devis	enterminkontrakten			16.040
Nicht realisierter Ver	lust aus Devisenterminkontr	akten			
EUR	771.538	USD	(842.487)	24.10.2023	(23.514)
EUR	36.267	USD	(39.612)	24.10.2023	(1.115)
EUR	642.007	USD	(702.072)	24.10.2023	(20.537)
EUR	614.867	USD	(672.872)	24.10.2023	(20.120)
GBP	1.264.429	EUR	(1.458.666)	31.10.2023	(2.429)
Summe des nicht rea	alisierten Verlusts aus Devise	enterminkontrakten			(67.715)

#### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
UK Long Gilt Future	GBP	(6)	27.12.2023	(651.298)	0
US Treasury Note 10YR	USD	(20)	19.12.2023	(2.041.322)	40.436
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten insgesamt				(2.692.620)	40.436
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
German Federal Republic Bond 10YR	EUR	29	07.12.2023	3.730.560	(81.780)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten insgesamt				3.730.560	(81.780)

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, BNP Paribas S.A., Canadian Imperial Bank of Commerce, JP Morgan Securities Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond **Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen** zum 30. September 2023

	% des
Branche	Nettovermögens
Internet	0,22
Supranational	0,39
Einzelhandel	0,49
Halbleiter	0,64
Transport und Verkehr	0,73
Chemikalien	0,83
Elektrische Komponenten und Zubehör	0,95
Öl und Gas	1,00
Biotechnologie	1,03
Medien	1,03
Gesundheitswesen	1,37
Computer	1,40
Verpackungen und Container	1,47
Baustoffe	2,33
Wasserwirtschaft	2,94
Gewerbliche Dienstleistungen	3,42
Arzneimittel	3,49
Automobilzulieferer	4,56
Telekommunikation	4,81
Elektrische Geräte	6,17
Versicherungen	6,17
Nahrungsmittel und Getränke	7,04
Immobilien	7,05
Finanzdienstleistungen	37,56
Anlagen insgesamt	97,09
Sonstige Aktiva / (Passiva)	2,91
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A USD eine Rendite von 11,6 %. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI Emerging Markets NR Index eine Rendite von 11,7 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in US-Dollar ausgedrückt.

Das Portfolio übertraf seine Benchmark über die letzten zwölf Monate. Auf Sektorebene leistete der Sektor der zyklischen Konsumgüter den größten Beitrag, wobei sich die Titelauswahl als besonders vorteilhaft erwies, insbesondere die E-Commerce-Unternehmen MercadoLibre und Allegro.eu. Die Informationstechnologie war im Hinblick auf die Titelauswahl der größte Verlustbringer. Ein starker Beitrag von der vietnamesischen IT-Dienstleistungsgruppe FPT wurde durch die schwache Performance von EPAM und die Nichtbeteiligung an Samsung Electronics aufgezehrt. Der Beitrag Chinas war insgesamt positiv, aber es war ein sehr volatiler Berichtszeitraum für chinesische Aktien, da er die Wiedereröffnung nach der "Null-Covid"-Politik Ende 2022 umfasste. Optimistisch stimmte auch die Unterstützung Pekings für den Internet- und Gaming-Sektor, nachdem der Gründer von Alibaba, Jack Ma, zum ersten Mal seit über einem Jahr wieder nach China zurückgekehrt war. Auch das Management von Tencent äußerte sich zum ersten Mongolia Yili Industrial Group, während die Untergewichtung von Tencent am vorteilhaftesten war.

### Marktrückblick

Die Aktienmärkte der Schwellenländer lieferten über den 12-Monats-Zeitraum positive Renditen. Anfänglich wurden viele asiatische Märkte durch ihre hohe Exposition gegenüber in schwächelnden Technologiewerten belastet. Darüber hinaus litten Aktien allgemein unter der Sorge um China und seine sich abkühlende Wirtschaft und seinen durch Schulden am Laufen gehaltenen Immobilienmarkt. Gegen Ende des Jahres 2022 lockerte China jedoch seine strengen Covid-Beschränkungen, was die Märkte beflügelte. Das erste Quartal 2023 war volatil, da Anleger und politische Entscheidungsträger ein Tauziehen um Inflations- und Zinserwartungen veranstalteten. Nach dem Zusammenbruch zweier regionaler US-Banken wurden auch Befürchtungen über die Gesundheit des globalen Bankensystems laut, und die Vorhersagen hinsichtlich hoher US-Leitzinsen schreckten asiatische Aktienanleger ab. Anschließend erholgen die Märkte sich, als die Ansteckung durch die US-Regionalbanken ausblieb, die US-Notenbank (Fed) eine Pause bei der Straffung der Geldpolitik signalisierte und Peking seine Unterstützung für private Unternehmen und Reformen staatlicher Unternehmen verlautbarte. Die asiatischen Märkte wurden durch eine Erholung der Technologiewerte weiter unterstützt, nachdem Nvidia einen Anstieg der KI-Nachfrage meldete. Gegen Ende des Berichtszeitraums behielten die Anleger ihren Pessimismus bei, da die globale Dynamik die Fundamentaldatendynamik und länderspezifische Dynamik überschattete, wobei die US-Wirtschaft widerstandsfähig blieb, was dazu führte, dass die Fed die Haltung "längerfristig höher" vertrat und sich die damit verbundenen Sorgen über verschärfte finanzielle Bedingungen auf die Schwellenmärkte auswirkten.

### Ausblick

Die Inlandsnachfrage ist in vielen Schwellenmärkten nach wie vor robust, was durch Anzeichen für einen beginnenden Rückgang der Inflation gestützt werden dürfte. Da die Zentralbanken der Schwellenländer ihre Politik vor den großen Industrieländern gestrafft haben, beginnen einige bereits, die Zinsen zu senken. Die gedämpfte Auslandsnachfrage und höhere Energiepreise sorgen jedoch weiterhin für Gegenwind. Ein verbesserter Dialog zwischen den USA und China könnte die geopolitischen Spannungen verringern. Wir beobachten die Entwicklungen bei den Wahlen in Taiwan, wobei jüngste Umfragen auf eine pragmatischere politische Haltung gegenüber China hindeuten. Schwellenmarktaktien sind aus Bewertungssicht attraktiv, da sie deutlich unter dem langfristigen Durchschnitt gehandelt werden und im Vergleich zu den weltweiten Aktien günstig sind. In unseren Portfolios konzentrieren wir uns auf Qualitätsunternehmen mit einer starken Marktposition und bevorzugen Unternehmen mit stabilen Erträgen, geringem Fremdkapitalanteil und Preisgestaltungsmacht, die in diesem Umfeld besser abschneiden dürften.

### LGM Responsible GEM team

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELT	EN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBAI	RE WERTPAPIER	E
ANTEILE			
Brasilien			
Raia Drogasil SA	708.344	3.922.675	1,15
Sendas Distribuidora SA	1.501.500	3.743.858	1,09
WEG SA	998.030	7.250.322	2,12
		14.916.855	4,36
China By-Health Co. Ltd	1.401.059	3.642.652	1,06
•	1.159.449	3.730.403	1,00
Dian Diagnostics Group Co. Ltd. 'A' Haier Smart Home Co. Ltd. 'H'	3.092.800	9.734.914	2,84
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. 'A'	1.674.972	6.083.886	1,78
Meituan 'B'	420.250	6.149.725	
			1,80
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H'	1.014.500	5.810.023	1,70
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. 'O'	195.610	7.225.791	2,11
Wuxi Biologics Cayman, Inc.	1.489.500	8.682.497	2,53
Griechenland		51.059.891	14,91
JUMBO SA	110.618	3.056.923	0,89
Hongkong			
AIA Group Ltd.	1.845.800	15.049.044	4,40
SITC International Holdings Co. Ltd	2.429.000	4.081.753	1,19
Techtronic Industries Co. Ltd	1.123.000	10.898.249	3,18
le d'au		30.029.046	8,77
Indien Biocon Ltd.	3.353.976	10.979.825	3,21
HDFC Bank Ltd.	933.115	17.145.618	5,01
Infosys Ltd.	490.812	8.449.889	2,47
Marico Ltd.	1.099.259		
Marco Ltd.	1.139.808	7.439.478 7.785.963	2,17 2,27
Nestle India Ltd.	20.254	5.476.351	1,60
Tata Consultancy Services Ltd.	20.234 223.118	9.471.088	2,77
Torrent Pharmaceuticals Ltd.	281.999	6.543.881	1,91
WNS Holdings Ltd.	93.800	6.571.628	1,91
		79.863.721	23,33
Indonesien			
Bank BTPN Syariah Tbk PT	33.757.000	4.160.924	1,22
Bank Central Asia Tbk PT	23.526.300	13.433.814	3,92
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	15.438.500	5.219.422	1,52
Korea		22.814.160	6,66
NAVER Corp.	56.859	8.490.506	2,48
Mexiko			
Grupo Financiero Banorte SAB de CV 'O'	728.591	6.179.710	1,80
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.278.492	4.884.391	1,43
Polen		11.064.101	3,23
Allegro.eu SA	499.583	3.712.464	1,09
Portugal			
Jeronimo Martins SGPS SA	562.037	12.713.294	3,71
Russland			
Moscow Exchange MICEX-Rates PJSC <sup>(1)</sup>	9.696.570	0	0,00
Südafrika Clicks Group Ltd.	379.590	5.220.723	1,52
Discovery Ltd.	1.178.001	8.553.176	2,50
		13.773.899	4,02
Taiwan			.,51
Advantech Co. Ltd.	921.697	9.850.698	2,88
Delta Electronics, Inc.	665.000	6.684.918	1,95
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1.469.000	23.800.344	6,95

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
Thailand			
Fabrinet	14.700	2.463.720	0,72
Home Product Center PCL	19.771.300	6.787.264	1,98
		9.250.984	2,70
Türkei BIM Birlesik Magazalar AS	485.130	4.869.436	1,42
USA			
EPAM Systems, Inc.	26.493	6.959.181	2,03
Uruguay			
MercadoLibre, Inc.	7.414	9.601.130	2,81
Vietnam			
FPT Corp.	4.751.892	18.143.410	5,30
ANTEILE GESAMT		340.654.961	99,49
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOTIERT ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	E	340.654.961	99,49
ANLAGEN INSGESAMT		340.654.961	99,49
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		1.737.691	0,51
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	-	342.392.652	100,00
<sup>(*)</sup> Diese Wertpapiere werden einer Bewertung zum Zeitwert unterzogen (siehe Erläuterung 2).	-		

 $^{(^{)}}$  Diese Wertpapiere werden einer Bewertung zum Zeitwert unterzogen (siehe Erläuterung 2).

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	0.72
Verschiedene Unternehmen des veralbeitenden Gewerbes	1,09
Transport und Verkehr	1,09
Elektrische Komponenten und Zubehör	1,19
Gewerbliche Dienstleistungen	2,17
Elektrische Geräte	2,17
Arzneimittel	2,84
Biotechnologie	3.21
Maschinenbau	5,21
Halbleiter	6,95
Einzelhandel	6,95
Gesundheitswesen	8,00
Internet	8,00
Nahrungsmittel und Getränke	8,51
Versicherungen	8,60
Finanzdienstleistungen	13,47
Computer	17,37
	00.40
Anlagen insgesamt	99,49
Sonstige Aktiva / (Passiva)	0,51
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Responsible Global Equity

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A EUR eine Rendite von 2,9 %. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI World NR Index eine Rendite von 12,8 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Der Fonds blieb in den sechs Monaten hinter der Benchmark zurück, wobei die relativen Renditen durch den schmerzhaften Zusammenbruch von SVB Financial beeinträchtigt wurden, das Anfang 2023 etwa 1,2 % des Portfolios ausmachte und dessen Wert nach der Einsetzung der FDIC als Insolvenzverwalter am 10. März auf null herabgeschrieben wurde. Das US-Gesundheitsunternehmen CVS Health war ein Verlustbringer, da die Prognosen für die künftigen Gewinne des Unternehmens gesenkt wurden. Den größten Beitrag zum Ausgleich leistete Linde, das mit guten Ergebnissen die Sorgen der Anleger beiseite schob. Positive Beiträge kamen auch vom französischen Industriekonzern Schneider Electric, der trotz makroökonomischen Gegenwinds eine solide Endmarktnachfrage verzeichnete, und von Mastercard, das aufgrund starker Ergebnisse im zweiten Quartal und positiver Prognosen des Managements zulegte. Zwar wirkte sich das Fehlen einiger der Schwergewichte im Mega-Cap-Index, wie zum Beispiel Tesla, positiv aus, doch hatte der Verzicht auf NVIDIA und Meta Platforms größere Auswirkungen.

### Marktrückblick

Die globalen Aktienmärkte legten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die Besorgnis über Inflation und Rezession blieb jedoch bestehen, auch wenn sie abnahm. Das Jahr 2023 begann mit einer Reihe von Börsenrallys, unterstützt durch die Aufhebung der Covid-Beschränkungen in China, einen warmen Winter, der eine Energiekrise in Europa verhinderte, und eine erwartete Abschwächung der Zinsanhebungen. Dennoch hielt die US-Notenbank (Fed) angesichts der robusten US-Wirtschaft an ihrer restriktiven Zinspolitik fest, was zu Marktvolatilität führte. Darüber hinaus sorgten der Zusammenbruch zweier regionaler Kreditinstitute in den USA und die Rettung der Credit Suisse durch die UBS im Frühjahr für eine kurzzeitige Angst vor einer Finanzkrise. Die Konjunkturerholung in Chinas nach der Aufhebung der Covid-Beschränkungen enttäuschte angesichts des ausch die auf China ausgerichteten Aktien belastete. Darüber hinaus haben die Anleger gegen Ende des Berichtszeitraums die Aktienbewertungen neu kalibriert, als sie feststellten, dass die höheren Zinssätze anhalten und die Kreditkosten steigen würden.

#### Ausblick

Die globalen Aktienmärkte leiden zu Beginn des vierten Quartals unter einer vorsichtigeren Stimmung, obwohl sich die Inflation in den USA und in Europa verbessert. Die Bedenken drehen sich um eine steilere Kurve an den Treasury-Märkten, einen gewissen Verlust an wirtschaftlicher Wachstumsdynamik und einen weltweit zunehmenden Gegenwind bei den Verbrauchern. Angesichts der bevorstehenden Berichtssaison für das dritte Quartal hoffen die Anleger jedoch auf die Bestätigung, dass die Bilanzen der Verbraucher und Unternehmen weiterhin solide sind. Die Entwicklungen an den Rentenmärkten haben potenzielle Risiken für die Finanzstabilität aufgezeigt, die mit dem Narrativ "länger höher" verbunden sind. Daher werden die Maßnahmen der Zentralbanken bis Ende 2023 und möglicherweise darüber hinaus einen großen Einfluss haben, bis sich das Gleichgewicht zugunsten der Ansicht verschiebt, dass potenzielle Zinssenkungen zur Ankurbelung der globalen Wirtschaftstätigkeit anstehen werden.

#### **Global Equities Team**

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Global Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEI	REGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBARE	WERTPAPIERE	
ANTEILE			
Australien CSL Ltd.	106.874	16.339.360	2,19
	100.014	10.000.000	2,10
Kanada Waste Connections, Inc.	137.695	17.466.293	2.24
,	137.095	17.400.293	2,34
Dänemark Vestas Wind Systems AS	447.516	9.095.565	1,22
Frankreich			
Schneider Electric SE	127.570	20.025.939	2,68
Deutschland			,
adidas AG	57.957	9.656.796	1,29
Allianz SE	47.216	10.656.651	1,43
Infineon Technologies AG	238.220	7.469.388	1,00
		27.782.835	3,72
Indien			-,- =
HDFC Bank Ltd.	264.980	14.768.802	1,98
Irland			
Accenture PLC 'A'	82.641	23.971.548	3,21
Aptiv PLC	176.091	16.397.461	2,20
Kerry Group PLC	157.701	12.486.765	1,67
Smurfit Kappa Group PLC	327.270	10.328.641	1,39
		63.184.415	8,47
Japan			
Hoya Corp.	97.500	9.457.363	1,27
Keyence Corp. Kubota Corp.	39.400 574.000	13.840.576 8.007.344	1,85 1,07
Murata Manufacturing Co. Ltd	486.600	8.420.456	1,13
Shimano, Inc.	64.400	8.219.569	1,10
		47.945.308	6,42
Niederlande			0,12
ASML Holding NV	30.837	17.240.967	2,31
Wolters Kluwer NV	104.263	11.953.753	1,60
		29.194.720	3,91
Norwegen	505 100	40.054.000	4.05
DNB Bank ASA DNB Bank ASA	525.400 7.610	10.054.699 145.634	1,35 0,02
אסא אוואם סאים	7.010		
Taiwan		10.200.333	1,37
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	846.000	12.946.082	1,74
Vereinigtes Königreich			
AstraZeneca PLC	121.426	15.540.855	2,08
London Stock Exchange Group PLC	149.854	14.224.638	1,91
SSE PLC	564.132	10.470.529	1,40
1104		40.236.022	5,39
USA A O Smith Corp.	175.029	10.932.389	1,46
Acuity Brands, Inc.	83.792	13.478.739	1,81
Americold Realty Trust, Inc.	425.523	12.222.105	1,64
Apple, Inc.	339.502	54.900.718	7,36
Autodesk, Inc.	77.461	15.138.092	2,03
Becton Dickinson & Co.	69.038	16.857.987	2,26
Crowdstrike Holdings, Inc. 'A'	90.524	14.311.128	1,92
CVS Health Corp. Dexcom, Inc.	205.112 75.889	13.526.252 6.687.550	1,81 0,90
eBay, Inc.	252.235	10.503.935	1,41
Humana, Inc.	33.551	15.417.456	2,06
Intercontinental Exchange, Inc.	224.493	23.328.188	3,12
Intuitive Surgical, Inc.	54.689	15.098.038	2,02
Linde PLC	84.618	29.759.160	3,99
Mastercard, Inc. 'A'	85.485	31.966.343	4,28
Mettler-Toledo International, Inc.	13.342	13.963.513	1,87
NetApp, Inc. NVIDIA Corp.	163.297 53.969	11.703.401 22.173.293	1,57 2,97
in encorp.	33.303	22.113.233	2,37

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Roper Technologies, Inc.	41.874	19.153.473	2,57
Thermo Fisher Scientific, Inc.	39.979	19.113.265	2,56
Tractor Supply Co.	75.516	14.482.667	1,94
VF Corp.	286.022	4.773.562	0,64
Xylem, Inc.	201.985	17.366.417	2,33
Zebra Technologies Corp. 'A'	48.280	10.785.991	1,44
Zoetis, Inc.	78.211	12.852.089	1,72
		430.495.751	57,68
ANTEILE GESAMT		739.681.425	99,11
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	NOTIERTE	739.681.425	99,11
ANLAGEN INSGESAMT		739.681.425	99,11
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		6.658.271	0,89
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	_	746.339.696	100,00

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Responsible Global Equity **Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen** zum 30. September 2023

	% des
Branche	Nettovermögens
Freizeit und Tourismus	1,10
Energie	1,22
Forstprodukte und Papier	1,39
Elektrische Geräte	1,40
Internet	1,41
Versicherungen	1,43
Büro und Geschäftsausstattung	1,44
Medien	1.60
Immobilien	1.64
Nahrungsmittel und Getränke	1.67
Einzelhandel	1,94
Biotechnologie	2,19
Automobilzulieferer	2,20
Umweltschutz	2,34
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	3,39
Chemikalien	3,99
Elektrische Komponenten und Zubehör	4,49
Software	4,60
Maschinenbau	5,25
Gesundheitswesen	6,64
Arzneimittel	8,77
Halbleiter	12,29
Finanzdienstleistungen	12,66
Computer	14,06
Anlagen insgesamt	99,11
Sonstige Aktiva / (Passiva)	0,89
Gesamtes Nettovermögen	100,00
-	

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) SDG Engagement Global Equity

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A Acc USD eine Rendite von 10,6 %. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI ACWI SMID Cap NR Index eine Rendite von 15,5 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in US-Dollar ausgedrückt.

Der Fonds blieb in den zwölf Monaten hinter der Benchmark zurück. Die relativen Renditen wurden durch den schmerzhaften Zusammenbruch von SVB Financial erheblich beeinträchtigt, das Anfang März etwa 2 % des Portfolios ausmachte und das nach der Einsetzung der FDIC als Insolvenzverwalter am 10. März auf null herabgeschrieben wurde. Wir verkauften Position im USamerikanischen Ingredienzienhersteller IFF nach weiteren schlechten Nachrichten zum operativen Geschäft und wachsenden Bedenken hinsichtlich der Verschuldung. Wir stiegen aus der Position im belgischen Kathodenmaterialanbieter Umicore aus, da sich das Anlageargument weiter verringerte. Positive Beiträge leisteten unter anderem Wex, ein US-amerikanischer Konzern für die geschäftliche Zahlungsabwicklung, der ein starkes Umsatzwachstum und einen Aktienrückkauf meldete. Cholamandalam Investment and Finance kündigte für September eine erwartete Kapitalerhöhung an, um von der Stärke der indischen Wirtschaft und des indischen Marktes zu profitieren. ICON, ein Unternehmen für klinische Forschung, profitierte von einigen positiven Nachrichten zum Branchenumfeld.

### Marktrückblick

Die globalen Aktienmärkte legten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die Besorgnis über Inflation und Rezession blieb jedoch bestehen, auch wenn sie abnahm. Das Jahr 2023 begann mit einer Reihe von Börsenrallys, unterstützt durch die Aufhebung der Covid-Beschränkungen in China, einen warmen Winter, der eine Energiekrise in Europa verhinderte, und eine erwartete Abschwächung der Zinsanhebungen. Dennoch hielt die US-Notenbank (Fed) angesichts der robusten US-Wirtschaft an ihrer restriktiven Zinspolitik fest, was zu Marktvolatilität führte. Darüber hinaus sorgten der Zusammenbruch zweier regionaler Kreditinstitute in den USA und die Rettung der Credit Suisse durch die UBS im Frühjahr für eine kurzzeitige Angst vor einer Finanzkrise. Die Konjunkturerholung in Chinas nach der Aufhebung der Covid-Beschränkungen enttäuschte angesichts des ausch die auf China ausgerichteten Aktien belastete. Darüber hinaus haben die Anleger gegen Ende des Berichtszeitraums die Aktienbewertungen neu kalibriert, als sie feststellten, dass die höheren Zinssätze anhalten und die Kreditkosten steigen würden.

#### Ausblick

Die globalen Aktienmärkte leiden zu Beginn des vierten Quartals unter einer vorsichtigeren Stimmung, obwohl sich die Inflation in den USA und in Europa verbessert. Die Bedenken drehen sich um eine steilere Kurve an den Treasury-Märkten, einen gewissen Verlust an wirtschaftlicher Wachstumsdynamik und einen weltweit zunehmenden Gegenwind bei den Verbrauchern. Angesichts der bevorstehenden Berichtssaison für das dritte Quartal hoffen die Anleger jedoch auf die Bestätigung, dass die Bilanzen der Verbraucher und Unternehmen weiterhin solide sind. Die Entwicklungen an den Rentenmärkten haben potenzielle Risiken für die Finanzstabilität aufgezeigt, die mit dem Narrativ "länger höher" verbunden sind. Daher werden die Maßnahmen der Zentralbanken bis Ende 2023 und möglicherweise darüber hinaus einen großen Einfluss haben, bis sich das Gleichgewicht zugunsten der Ansicht verschiebt, dass potenzielle Zinssenkungen zur Ankurbelung der globalen Wirtschaftstätigkeit anstehen werden.

### **Global Equities Team**

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN	GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIERE	
ANTEILE			
Kanada Descartes Systems Group, Inc.	224.182	16.530.106	1,57
Frankreich Veolia Environnement SA	1.037.826	30.140.038	2,86
Indien			
Cholamandalam Investment & Finance Co. Ltd. Indonesien	1.110.718	16.318.106	1,55
Bank Mandiri Persero Tbk PT	103.849.100	40.484.686	3,85
Irland Aptiv PLC	299.235	29.501.579	2,81
ICON PLC	130.811	32.212.209	3,06
Kerry Group PLC	345.039	28.925.250	2,75
Smurfit Kappa Group PLC	799.342	26.634.879	2,53
		117.273.917	11,15
Japan Daiseki Co. Ltd	337.900	9.057.464	0,86
Hoya Corp.	202.200	20.765.388	1,98
Japan Exchange Group, Inc.	1.421.800	26.430.378	2,51
Kubota Corp.	1.355.000	20.012.866	1,90
Lasertec Corp.	155.400	24.232.923	2,30
Makita Corp.	607.700	15.035.205	1,43
Shimadzu Corp.	743.400	19.787.467	1,88
Unicharm Corp.	686.500	24.340.905	2,31
ZOZO, Inc.	810.100	14.888.251	1,42
Niederlande		174.550.847	16,59
Wolters Kluwer NV	260.588	31.631.655	3,01
Norwegen			
DNB Bank ASA	1.608.982	32.600.452	3,10
MOWI ASA	858.055	15.284.900	1,45
Singapur		47.885.352	4,55
ComfortDelGro Corp. Ltd.	19.824.100	18.881.479	1,79
Südafrika Clicks Group Ltd.	1.620.612	22.249.716	2,11
Schweiz Tecan Group AG	77.435	26.172.827	2,49
Taiwan			
Win Semiconductors Corp.	594.000	2.373.755	0,23
Thailand Kasikornbank PCL	7.029.500	24.324.531	2,31
Vereinigtes Königreich	200.050	0.005.475	0.00
Genus PLC Halma PLC	366.856 1.137.093	9.385.175 26.904.024	0,89 2,56
Rotork PLC	5.662.501	21.604.923	2,05
USA		57.894.122	5,50
A O Smith Corp.	355.936	23.538.048	2,24
Acuity Brands, Inc.	179.403	30.554.125	2,90
Americold Realty Trust, Inc.	934.858	28.429.032	2,70
Cognex Corp.	515.118	21.861.608	2,08
Encompass Health Corp.	217.649	14.617.307	1,39
IDEX Corp.	78.207	16.268.620	1,55
Kontoor Brands, Inc.	406.986	17.870.755	1,70
Mettler-Toledo International, Inc.	19.968	22.125.942	2,10
Mohawk Industries, Inc.	245.056	21.028.255	2,00
NetApp, Inc.	401.340	30.453.679	2,89
STERIS PLC	132.245	29.017.198	2,76
Tractor Supply Co.	168.512	34.216.361	3,25
Waste Connections, Inc.	288.788	38.954.340	3,70

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
WEX, Inc.	142.156	26.738.122	2,54
Xylem, Inc.	334.805	30.477.299	2,90
Zebra Technologies Corp. 'A'	106.420	25.171.523	2,39
		411.322.214	39,09
ANTEILE GESAMT		1.038.033.351	98,65
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	NOTIERTE	1.038.033.351	98,65
ANLAGEN INSGESAMT		1.038.033.351	98,65
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		14.163.221	1,35
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	-	1.052.196.572	100,00

### DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Nicht realisierte Gewinn/(Verlus in US	Fälligkeitsdatum	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Kauf
	-		trakten	vinn aus Devisenterminkon	Nicht realisierter Gewi
	31.10.2023	(302)	USD	408	CAD
101.16	31.10.2023	(17.520.661)	CAD	11.916.765	CHF
	31.10.2023	(124)	CAD	84	CHF
7.23	31.10.2023	(1.253.241)	CAD	852.398	CHF
5	31.10.2023	(9.691)	CAD	6.591	CHF
9	31.10.2023	(16.226)	CAD	11.036	CHF
Ũ	31.10.2023	(480)	EUR	464	CHF
21.46	31.10.2023	(17.218.595)	GBP	19.191.623	CHF
2	31.10.2023	(112)	GBP	133	CHF
1.52	31.10.2023	(1.222.551)	GBP	1.362.640	CHF
1.52	31.10.2023	(9.341)	GBP	10.412	CHF
8	31.10.2023	(68.909)	GBP	76.805	CHF
0	31.10.2023	( )	GBP	67	CHF
		(60)	GBP	731	CHF
	31.10.2023	(655)			
2	31.10.2023	(15.947)	GBP	17.774	CHF
000.40	31.10.2023	(36)	GBP	40	CHF
233.18	31.10.2023	(6.370.350.472)	JPY	39.324.146	CHF
	31.10.2023	(45.445)	JPY	280	CHF
16.74	31.10.2023	(457.347.091)	JPY	2.823.202	CHF
13	31.10.2023	(3.544.353)	JPY	21.879	CHF
21	31.10.2023	(5.965.200)	JPY	36.823	CHF
8.42	31.10.2023	(8.224.988)	SGD	5.510.812	CHF
60	31.10.2023	(586.221)	SGD	392.773	CHF
	31.10.2023	(4.567)	SGD	3.060	CHF
	31.10.2023	(7.617)	SGD	5.104	CHF
5	03.10.2023	(30.340)	USD	27.808	CHF
2.38	31.10.2023	(297.018)	USD	273.082	CHF
	31.10.2023	(148)	USD	136	CHF
2	31.10.2023	(18.372)	USD	16.780	CHF
887.63	31.10.2023	(110.630.889)	USD	101.715.588	CHF
10.10	31.10.2023	(7.208.004)	USD	6.583.603	CHF
95	31.10.2023	(119.096)	USD	109.498	CHF
2	31.10.2023	(17.207)	USD	15.717	CHF
63.63	31.10.2023	(7.931.016)	USD	7.291.887	CHF
48	31.10.2023	(343.277)	USD	313.540	CHF
78	31.10.2023	(144.235)	USD	132.272	CHF
10	31.10.2023	· · · · ·	USD	710	CHF
82		(777)	USD	94.200	CHF
	31.10.2023	(102.456)			
01.00	31.10.2023	(6.612)	USD	6.039	CHF
81.00	31.10.2023	(12.941.834)	CAD	9.110.712	EUR
18	31.10.2023	(29.188)	CAD	20.548	EUR
2	31.10.2023	(3.498)	CAD	2.462	EUR
49	31.10.2023	(766.388)	CHF	793.183	EUR
1	31.10.2023	(17.525)	CHF	18.137	EUR
24	31.10.2023	(702.066)	CHF	726.412	EUR
	31.10.2023	(2.463)	CHF	2.547	EUR
3	31.10.2023	(54.986)	CHF	56.908	EUR
	31.10.2023	(114)	CHF	118	EUR
1	31.10.2023	(51.462)	CHF	53.247	EUR
2.87	31.10.2023	(4.418.881)	CHF	4.573.374	EUR
	31.10.2023	(9.966)	CHF	10.314	EUR
	31.10.2023	(1.168)	CHF	1.209	EUR
	31.10.2023	(710)	CHF	735	EUR
	31.10.2023	(651)	CHF	674	EUR
25.90	31.10.2023	(12.719.930)	GBP	14.673.908	EUR
5	31.10.2023	(28.128)	GBP	32.449	EUR
	31.10.2023	(3.371)	GBP	3.889	EUR
58	31.10.2023	(286.694)	GBP	330.734	EUR
88	31.10.2023	(417.274)	GBP	481.402	EUR
	31.10.2023	(228)	GBP	263	EUR
4	31.10.2023	(220)	GBP	305.422	EUR
4	31.10.2023	(205.159) (2.412)	GBP	2.783	EUR
	31.10.2023		GBP	171	EUR
		(148)			
	31.10.2023	(215)	GBP	249	EUR
400.00	31.10.2023	(137)	GBP	158	EUR
192.32	31.10.2023	(4.705.539.353)	JPY	30.063.925	EUR
10	31.10.2023	(7.581)	JPY	48	EUR
43	31.10.2023	(10.734.378)	JPY	68.582	EUR
5	31.10.2023	(1.279.241)	JPY	8.173	EUR
0.4.4	31.10.2023	(6.075.991)	SGD	4.213.548	EUR
9.14	24 40 2022	(13.704)	SGD	9.503	EUR
2	31.10.2023	( )			
2	31.10.2023	(1.648)	SGD	1.143	EUR
2					EUR EUR

Kauf	Nominalwert Verkauf		Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
EUR	537	USD	(564)	31.10.2023	5
EUR	1.647.761	USD	(1.746.417)	31.10.2023	157
EUR	63.909	USD	(67.644)	31.10.2023	97
EUR	330	USD	(349)	31.10.2023	1
EUR	77.762.828	USD	(81.718.857)	31.10.2023	707.296
EUR EUR	3.493.523 17.940	USD USD	(3.697.699) (18.852)	31.10.2023 31.10.2023	5.326 163
EUR	11.271	USD	(11.930)	31.10.2023	17
EUR	54	USD	(11000)	31.10.2023	0
EUR	175.381	USD	(184.303)	31.10.2023	1.595
EUR	8.181	USD	(8.659)	31.10.2023	12
EUR	49.418	USD	(52.008)	31.10.2023	373
EUR	262	USD	(276)	31.10.2023	1
GBP GBP	4.450.090 2.297	CAD CAD	(7.292.433)	31.10.2023	36.590 19
GBP	2.297 14.684.899	JPY	(3.764) (2.651.461.333)	31.10.2023 31.10.2023	78.900
GBP	7.581	JPY	(1.368.725)	31.10.2023	41
GBP	2.057.977	SGD	(3.423.432)	31.10.2023	1.012
GBP	1.062	SGD	(1.767)	31.10.2023	1
GBP	27.232	USD	(33.216)	03.10.2023	22
GBP	393	USD	(477)	31.10.2023	3
GBP	251	USD	(307)	31.10.2023	0
GBP	37.983.688	USD	(46.046.485)	31.10.2023	322.469
GBP	1.422	USD	(1.724)	31.10.2023	12
GBP GBP	72 19.608	USD USD	(88) (23.770)	31.10.2023 31.10.2023	0 166
JPY	58.203.937	GBP	(320.668)	31.10.2023	331
JPY	801.451	GBP	(4.415)	31.10.2023	5
JPY	30.144	GBP	(166)	31.10.2023	0
JPY	149.254	USD	(1.002)	31.10.2023	3
JPY	18.403.706	USD	(123.816)	31.10.2023	65
JPY	94.997	USD	(639)	31.10.2023	0
NOK	98.353	CHF	(8.395)	31.10.2023	46
NOK	14.641	CHF	(1.247)	31.10.2023	9
NOK NOK	639 15.569	CHF EUR	(54) (1.375)	31.10.2023 31.10.2023	0
NOK	10.151	EUR	(895)	31.10.2023	6
NOK	1.423	GBP	(109)	31.10.2023	1
NOK	15.997	GBP	(1.222)	31.10.2023	13
NOK	2.911	USD	(270)	31.10.2023	4
NOK	367.321	USD	(34.265)	31.10.2023	281
NOK	1.886	USD	(177)	31.10.2023	1
SGD	2.083.631	CHF	(1.394.062)	31.10.2023	47
SGD SGD	731 141.137	CHF CHF	(489) (94.428)	31.10.2023 31.10.2023	0 3
SGD	1.929	CHF	(94.428) (1.291)	31.10.2023	0
SGD	507	EUR	(351)	31.10.2023	0
SGD	843.115	GBP	(505.732)	31.10.2023	1.096
SGD	798	GBP	(479)	31.10.2023	1
SGD	435	GBP	(261)	31.10.2023	1
SGD	2.632.950	USD	(1.928.616)	31.10.2023	2.804
SGD	192	USD	(140)	31.10.2023	1
SGD	18.332	USD	(13.428)	31.10.2023	20
	lisierten Gewinns aus Deviser				2.841.963
	rlust aus Devisenterminkon 573.309		(000.050)	24 40 0000	(4.400)
CAD CAD	573.309 13.787	CHF CHF	(388.253) (9.377)	31.10.2023 31.10.2023	(1.462) (80)
CAD	2.022	CHF	(9.377) (1.369)	31.10.2023	(5)
CAD	90	CHF	(11000)	31.10.2023	(0)
CAD	525	CHF	(356)	31.10.2023	(1)
CAD	2.182	EUR	(1.536)	31.10.2023	(14)
CAD	1.402	EUR	(982)	31.10.2023	(4)
CAD	170.198	GBP	(103.334)	31.10.2023	(212)
CAD	200	GBP	(122)	31.10.2023	(1)
CAD	2.209	GBP	(1.341)	31.10.2023	(3)
CAD CAD	88 50.716	GBP USD	(53) (37 603)	31.10.2023 31.10.2023	(0)
CAD	262	USD	(37.603) (194)	31.10.2023	(76) (1)
CHF	22.818.150	EUR	(23.615.920)	31.10.2023	(1)(14.860)
CHF	157	EUR	(163)	31.10.2023	(14.000)
CHF	1.633.061	EUR	(1.690.156)	31.10.2023	(1.064)
CHF	12.318	EUR	(12.749)	31.10.2023	(8)
CHF	136.781	EUR	(141.564)	31.10.2023	(89)
CHF	729	EUR	(754)	31.10.2023	(0)
CHF	310	EUR	(321)	31.10.2023	(0)
CHF CHF	21.131 10.694.537	EUR NOK	(21.870) (125.288.634)	31.10.2023 31.10.2023	(14) (58.156)
0 III	10.094.037	NUIT	(123.200.034)	31.10.2023	(30.130)

Nicht realisiert Gewinn/(Verlus in US	Fälligkeitsdatum	Nominalwert	f Nominalwert Verkauf		Kauf
(	31.10.2023	(885)	NOK	75	CHF
(4.16	31.10.2023	(8.966.724)	NOK	765.392	CHF
(3)	31.10.2023	(69.132)	NOK	5.901	CHF
(5-	31.10.2023	(116.026)	NOK	9.904	CHF
(	31.10.2023	(95)	USD	87	CHF
(	31.10.2023	(85)	USD	78	CHF
(3)	31.10.2023	(1.320.795)	CHF	1.366.125	EUR
(1	31.10.2023	(72.076)	CHF	74.550	EUR
(07.50)	31.10.2023	(1.216)	CHF	1.257	EUR
(37.50	31.10.2023	(92.539.297)	NOK	8.175.533	EUR
(8)	31.10.2023	(208.681)	NOK	18.436	EUR
(1)	31.10.2023	(24.951)	NOK	2.204	EUR
(54	31.10.2023	(490.537)	CHF	440.106	GBP
(93	31.10.2023	(499.827)	CHF	448.130	GBP
(1	31.10.2023	(14.813)	CHF	13.290	GBP
(-	31.10.2023	(2.164)	CHF	1.940	GBP
(7	31.10.2023	(39.986)	CHF	35.850	GBP
(	31.10.2023	(96)	CHF	86	GBP
(2.78	31.10.2023	(2.489.958)	CHF	2.233.973	GBP
(	31.10.2023	(456)	CHF	409	GBP
(	31.10.2023	(456)	CHF	409	GBP
(	31.10.2023	(1.285)	CHF	1.153	GBP
(67)	31.10.2023	(379.403)	EUR	328.882	GBP
(-	31.10.2023	(2.427)	EUR	2.104	GBP
(17.05	31.10.2023	(1.552)	EUR	1.345	GBP
(17.35	31.10.2023	(9.829.144)	EUR	8.520.296	GBP
()	31.10.2023	(5.074)	EUR	4.398	GBP
(29.16	31.10.2023	(52.146.323)	NOK	3.993.576	GBP
(1)	31.10.2023	(26.918)	NOK	2.061	GBP
(2)	31.10.2023	(59.436)	USD	48.671	GBP
(82	31.10.2023	(2.398.316)	USD	1.963.933	GBP
(	31.10.2023	(18.800)	USD	15.395	GBP
(	31.10.2023	(1.237)	USD	1.013	GBP
(1.16	31.10.2023	(1.226.994)	CHF	199.676.171	JPY
(18	31.10.2023	(31.128)	CHF	5.042.556	JPY
(-	31.10.2023	(4.508)	CHF	733.568	JPY
(	31.10.2023	(202)	CHF	32.825	JPY
(	31.10.2023	(1.527)	CHF	248.434	JPY
(3	31.10.2023	(5.100)	EUR	798.211	JPY
(	31.10.2023	(3.233)	EUR	508.590	JPY
()	31.10.2023	(1.949)	EUR	306.695	JPY
(	31.10.2023	(74)	EUR	11.664	JPY
(1	31.10.2023	(404)	GBP	72.975	JPY
(	31.10.2023	(4.353)	CHF	6.497	SGD
(1-	31.10.2023	(1.019.790)	EUR	1.473.548	SGD
()	31.10.2023	(713)	EUR	1.028	SGD
(	31.10.2023	(2.571)	EUR	3.715	SGD
(	31.10.2023	(57)	GBP	94	SGD
(	31.10.2023	(69)	USD	94	SGD
(4.26	31.10.2023	(25.535.984)	CAD	18.890.608	USD
(76.08	31.10.2023	(8.719.113)	CHF	9.483.338	USD
(42.51	31.10.2023	(7.663.560)	CHF	8.359.633	USD
(1.11	31.10.2023	(188.231)	CHF	205.255	USD
(;	31.10.2023	(983)	CHF	1.075	USD
(5)	31.10.2023	(27.808)	CHF	30.430	USD
(1.61	31.10.2023	(291.326)	CHF	317.787	USD
(67)	31.10.2023	(76.965)	CHF	83.711	USD
(3)	31.10.2023	(7.004)	CHF	7.641	USD
(313.00	31.10.2023	(34.413.438)	EUR	36.164.152	USD
(23.58	31.10.2023	(3.186.466)	EUR	3.353.966	USD
(23	31.10.2023	(30.823)	EUR	32.439	USD
(	31.10.2023	(170)	EUR	179	USD
(4	31.10.2023	(19.939)	EUR	21.086	USD
(5)	31.10.2023	(7.157)	EUR	7.534	USD
(26	31.10.2023	(28.751)	EUR	30.213	USD
(208.92	31.10.2023	(24.608.818)	GBP	29.832.532	USD
(14.12	31.10.2023	(2.006.264)	GBP	2.435.037	USD
(1	31.10.2023	(2.443)	GBP	2.966	USD
(2)	31.10.2023	(27.232)	GBP	33.222	USD
(	31.10.2023	(1.036)	GBP	1.258	USD
	31.10.2023	(9.453.275.370)	JPY	63.469.593	USD
(163.42		( )			
(163.42) (220.76)	31.10.2023	(182.572.552)	NOK	16.950.178	USD
	31.10.2023 31.10.2023	(182.572.552) (4.662.898)	NOK NOK	16.950.178 434.974	USD

(1.303.915)

Die Gegenpartei für Devisenterminkontrakte war State Street Bank & Trust Company.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) SDG Engagement Global Equity Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen

zum 30. September 2023

	% des
Branche	Nettovermögens
Landwirtschaft	0,89
Internet	1,42
Software	1,57
Transport und Verkehr	1,79
Baustoffe	2,00
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	2,31
Büro und Geschäftsausstattung	2,39
Forstprodukte und Papier	2,53
Gewerbliche Dienstleistungen	2,54
Immobilien	2,70
Automobilzulieferer	2,81
Wasserwirtschaft	2,86
Computer	2,89
Elektrische Komponenten und Zubehör	2,90
Medien	3,01
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	3,94
Nahrungsmittel und Getränke	4,20
Umweltschutz	4,56
Einzelhandel	5,36
Gesundheitswesen	9,70
Halbleiter	11,05
Maschinenbau	11,91
Finanzdienstleistungen	13,32
Anlagen insgesamt	98,65
Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,35
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income

### Performance

Der Fonds wurde am 2. August 2023 aufgelegt und dies ist der erste Jahresbericht.

Der Fonds hat ein duales Mandat für Nachhaltigkeit und Erträge. Er zielt darauf ab, langfristig (über mindestens 5 Jahre) Erträge in Kombination mit Kapitalwachstum zu erwirtschaften. Der Fonds wird aktiv verwaltet und kombiniert eine Kernaktienkomponente mit einer aktiven Derivatestrategie zur Steigerung der Erträge. Der Fonds strebt einen langfristigen Kapitalzuwachs an, indem er in erster Linie in nachhaltige Anlagen investiert. Für diesen Fonds werden Aktien von Unternehmen als nachhaltig angesehen, die einen wesentlichen Teil (50 % oder mehr) ihres Nettoumsatzes mit Aktivitäten erzielen, die in direktem Zusammenhang mit einem oder mehreren der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen ("SDGs") stehen, oder die sich auf einem glaubwürdigen kurz- bis mittelfristigen Weg dorthin befinden.

#### Marktrückblick

Die globalen Aktienmärkte fielen im August und September. Die Aktienmärkte stürzten zunächst ab, weil die Anleger eine weitere Straffung der Geldpolitik aufgrund der anhaltend hohen Inflation und der robusten US-Wirtschaft befürchteten. Schwache chinesische Wirtschaftsdaten in Verbindung mit anhaltenden Sorgen über den überschuldeten lokalen Immobiliensektor waren ebenfalls negative Faktoren. Im Allgemeinen passten die Anleger ihre Aktienbewertungen an, als sie erkannten, dass die höheren Zinssätze kurz- bis mittelfristig Bestand haben würden. Es wurden Bedenken laut, dass die Kosten für die Kreditaufnahme steigen, während die Binnenwirtschaft angesichts steigender Energiepreise am Rande einer Rezession stand, wodurch die Gewinnmargen der Unternehmen unter Druck gerieten.

In diesem Berichtszeitraum kam es zu einem allgemeinen Anstieg der Renditen von Staatsanleihen, da Festzinsanleger aufgrund des Mottos "längerfristig höher" der Zentralbanken Anleihen mit kürzerer Laufzeit auf Kosten von solchen mit längerer Laufzeit bevorzugten. Die Anleger konzentrierten sich auch auf die Folgen der zunehmenden Emission von Staatsanleihen in Verbindung mit einer robusten Wirtschaft und einer hartnäckigen Inflation. Der Wert von Unternehmensanleihen sank trotz einer anfänglichen Emissionsflut, da die Renditen stiegen.

#### Ausblick

Die globalen Märkte leiden zu Beginn des vierten Quartals unter mangelndem Vertrauen und einer vorsichtigeren Anlegerstimmung, obwohl sich die Inflationsaussichten verbessern. Die Bedenken drehen sich um eine steilere Kurve an den Treasury-Märkten, einen gewissen Verlust an wirtschaftlicher Wachstumsdynamik und einen weltweit zunehmenden Gegenwind bei den Verbrauchern. In jüngster Zeit sind die ungewissen Auswirkungen des hohen Ölpreises hinzugekommen. Angesichts der bevorstehenden Berichtssaison für das dritte Quartal hoffen die Anleger jedoch auf ein weiteres Quartal mit zuversichtlichen Unternehmenskommentaren, die bestätigen, dass die Bilanzen der Verbraucher und Unternehmen weiterhin solide sind. Bei japanischen Aktien wurde der Enthusiasmus, der sich aufgrund der nachlassenden Besorgnis über die chinesische Wirtschaft entwickelte, gegen Ende des Quartals von den USA überschattet. Zu Beginn des vierten Quartal hat es den Anschein, dass sich das Geschiebe und Gezerre zwischen Bullen und Bären wohl fortsetzen wird. Die Entwicklungen an den Rentenmärkten haben die potenziellen Risiken für die Finanzstabilität aufgezeigt, die mit dem Narrativ "länger höher" verbunden sind. Daher werden die Maßnahmen der Zentralbanken die Märkte möglicherweise auch über das Jahr 2023 hinaus stark beeinflussen, oder bis sich die Überzeugung durchsetzt, dass Zinssenkungen zur Ankurbelung der globalen Wirtschaftstätigkeit anstehen werden.

Global Equities Team Fondsmanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des

Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOT	IERTE ÜBERTRAGBAR	E WERTPAPIERE	
ANTEILE			
Kanada Brookfield Renewable Partners LP	664.256	14.440.925	3,35
Frankreich	0011200		0,00
Cie de Saint-Gobain	78.366	4.719.334	1,09
Schneider Electric SE	47.384	7.875.343	1,83
		12.594.677	2,92
Deutschland			
Allianz SE	38.230	9.135.436	2,12
Deutsche Telekom AG E.ON SE	519.931 413.099	10.936.876 4.898.528	2,54 1,14
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG	17.863	6.980.586	1,14
Siemens Healthineers AG	128.571	6.533.979	1,52
		38.485.405	8,94
Indonesien			
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	19.703.000	6.661.157	1,55
Irland			
Smurfit Kappa Group PLC	265.469	8.870.421	2,06
Italien			
Intesa Sanpaolo SpA	3.650.387	9.430.228	2,19
Japan			
Daiwa House Industry Co. Ltd.	541.600	14.572.116	3,38
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd	390.400	12.141.708	2,82
Tokio Marine Holdings, Inc.	454.200	10.546.510	2,45
Norwegen		37.260.334	8,65
MOWI ASA	378.351	6.739.728	1,57
Singapur			
ComfortDelGro Corp. Ltd.	7.414.400	7.061.851	1,64
Schweiz			
SGS SA	88.509	7.451.862	1,73
Taiwan			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	104.000	9.037.600	2,10
Vereinigtes Königreich			
AstraZeneca PLC	49.425	6.697.356	1,56
BT Group PLC GSK PLC	5.054.729 430.932	7.199.862 7.847.531	1,67 1,82
Legal & General Group PLC	3.202.824	8.697.983	2,02
RELX PLC	234.645	7.947.485	1,85
SSE PLC	533.271	10.479.228	2,43
		48.869.445	11,35
USA			
American Water Works Co., Inc.	36.260	4.490.077	1,04
Becton Dickinson & Co.	35.596	9.202.634	2,14
Broadcom, Inc.	11.064	9.189.537	2,13
Colgate-Palmolive Co. CVS Health Corp.	132.369 108.275	9.412.760 7.559.760	2,19 1,76
eBay, Inc.	275.200	12.133.568	2,82
Elevance Health, Inc.	14.133	6.153.791	1,43
Emerson Electric Co.	128.631	12.421.896	2,88
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc.	403.208	8.548.010	1,99
Johnson Controls International PLC	192.767	10.257.132	2,38
Linde PLC	31.655	11.786.739	2,74
Microsoft Corp.	63.125	19.931.719	4,63
Motorola Solutions, Inc.	52.377	14.259.114	3,31
NetApp, Inc.	195.759	14.854.193	3,45
NortonLifeLock, Inc.	552.858	9.774.529	2,27
Packaging Corp. of America Pfizer, Inc.	75.291 305.690	11.560.933 10.139.737	2,69 2,35
Quest Diagnostics, Inc.	49.231	5.999.290	1,39

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
TE Connectivity Ltd.	49.231	6.081.505	1,41
Waste Management, Inc.	53.023	8.082.826	1,88
		201.839.750	46,88
ANTEILE GESAMT		408.743.383	94,93
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MA ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	RKT NOTIERTE	408.743.383	94,93
ANLAGEN INSGESAMT		408.743.383	94,93
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		21.805.377	5,07
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	-	430.548.760	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

### DERIVATE

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
-	vinn aus Devisenterminkor			5	
CHF	26.084	EUR	(26.979)	31.10.2023	1
CHF	377	EUR	(390)	31.10.2023	0
CHF	345	EUR	(356)	31.10.2023	0
CHF	377	EUR	(390)	31.10.2023	0
CHF	345	EUR	(357)	31.10.2023	0
CHF	345	EUR	(357)	31.10.2023	0
CHF	10.926	EUR	(11.301)	31.10.2023	0
CHF	11.960	EUR	(12.370)	31.10.2023	0
CHF	10.924	EUR	(11.299)	31.10.2023	0
CHF	11.951	EUR	(12.361)	31.10.2023	0
CHF	10.920	EUR	(11.295)	31.10.2023	0
CHF	11.935	EUR	(12.344)	31.10.2023	0
CHF	1.314	GBP	(1.179)	31.10.2023	2
CHF	98	GBP	(88)	31.10.2023	0
CHF	1.314	GBP	(1.179)	31.10.2023	2
CHF	98	GBP	(88)	31.10.2023	0
CHF	41.688	GBP	(37.403)	31.10.2023	47
CHF	3.101	GBP	(2.780)	31.10.2023	6
CHF	41.680	GBP	(37.395)	31.10.2023	47
CHF	3.096	GBP	(2.775)	31.10.2023	6
CHF	41.625	GBP	(37.346)	31.10.2023	47
CHF	3.092	GBP	(2.772)	31.10.2023	6
CHF	10.919	GBP	(9.790)	31.10.2023	21
CHF	1.335	JPY	(216.282)	31.10.2023	8
CHF	1.335	JPY	(216.282)	31.10.2023	8
CHF	42.345	JPY	(6.859.643)	31.10.2023	251
CHF	42.336	JPY	(6.858.259)	31.10.2023	251
CHF	42.280	JPY	(6.849.183)	31.10.2023	251
CHF	210	SGD	(314)	31.10.2023	0
CHF	210	SGD	(314)	31.10.2023	0
CHF	6.671	SGD	(9.956)	31.10.2023	10
CHF	6.669	SGD	(9.954)	31.10.2023	10
CHF	6.661	SGD	(9.941)	31.10.2023	10
CHF	7.422	USD	(8.073)	31.10.2023	65
CHF	143	USD	(157)	31.10.2023	0
CHF	7.422	USD	(8.073)	31.10.2023	65
CHF	143	USD	(157)	31.10.2023	0
CHF	235.398	USD	(256.031)	31.10.2023	2.054
CHF	4.592	USD	(5.028)	31.10.2023	7
CHF	235.351	USD	(255.979)	31.10.2023	2.054
CHF	4.568	USD	(5.001)	31.10.2023	7
CHF	235.039	USD	(255.640)	31.10.2023	2.051
CHF	4.562	USD	(4.995)	31.10.2023	7
EUR	37.133	CHF	(35.879)	31.10.2023	23
EUR	7.361	CHF	(7.112)	31.10.2023	5
EUR	792	CHF	(765)	31.10.2023	0
EUR	580	CHF	(560)	31.10.2023	0
EUR	580	CHF	(561)	31.10.2023	0
EUR	580	CHF	(561)	31.10.2023	0
EUR	18.389	CHF	(17.768)	31.10.2023	12
EUR	18.386	CHF	(17.765)	31.10.2023	12
EUR	18.379	CHF	(17.758)	31.10.2023	12
EUR	86.911	GBP	(75.338)	31.10.2023	153
EUR	11.331	GBP	(9.821)	31.10.2023	21
EUR	17.212	GBP	(14.920)	31.10.2023	30
EUR	5.256	GBP	(4.555)	31.10.2023	10
EUR	1.356	GBP	(1.176)	31.10.2023	2
EUR	124	GBP	(107)	31.10.2023	0
EUR	1.358	GBP	(1.177)	31.10.2023	2
EUR	124	GBP	(107)	31.10.2023	0
EUR	1.358	GBP	(1.177)	31.10.2023	2
EUR	124	GBP	(107)	31.10.2023	0
EUR	43.017	GBP	(37.289)	31.10.2023	76
EUR	3.929	GBP	(3.406)	31.10.2023	7
EUR	43.008	GBP	(37.281)	31.10.2023	76
EUR	3.924	GBP	(3.401)	31.10.2023	7
EUR	42.992	GBP	(37.267)	31.10.2023	76
EUR	3.922	GBP	(3.400)	31.10.2023	7
EUR	88.184	JPY	(13.802.324)	31.10.2023	564
EUR	17.376	JPY	(2.719.648)	31.10.2023	111
EUR	4.146	JPY	(652.291)	31.10.2023	4
EUR	1.378	JPY	(215.626)	31.10.2023	9
EUR	1.379	JPY	(215.843)	31.10.2023	9
EUR	1.379	JPY	(215.843)	31.10.2023	9

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
EUR	43.693	JPY	(6.838.775)	31,10,2023	280
EUR	43.685	JPY	(6.837.398)	31.10.2023	279
EUR	43.668	JPY	(6.834.845)	31.10.2023	279
EUR	13.897	SGD	(20.040)	31.10.2023	30
EUR	2.747	SGD	(3.960)	31.10.2023	6
EUR	752	SGD	(1.086)	31.10.2023	0
EUR	217	SGD	(313)	31.10.2023	1
EUR	217	SGD	(313)	31.10.2023	1
EUR	217	SGD	(313)	31.10.2023	1
EUR	6.883	SGD	(9.926)	31.10.2023	15
EUR	6.882	SGD	(9.924)	31.10.2023	15
EUR	6.879	SGD	(9.920)	31.10.2023	15
EUR	490.544	USD	(515.499)	31.10.2023	4.462
EUR	167.825 1.293	USD	(176.622)	31.10.2023	1.267
EUR EUR	45.840	USD USD	(1.364) (48.477)	31.10.2023	6 112
EUR	45.840 205	USD	(48.477) (217)	31.10.2023 31.10.2023	0
EUR	7.658	USD	(8.048)	31.10.2023	70
EUR	7.666	USD	(8.056)	31.10.2023	70
EUR	7.666	USD	(8.056)	31.10.2023	70
EUR	242.895	USD	(255.252)	31.10.2023	2.209
EUR	242.846	USD	(255.200)	31.10.2023	2.209
EUR	242.755	USD	(255.105)	31.10.2023	2.208
GBP	37.722	JPY	(6.810.970)	31.10.2023	203
GBP	5.943	SGD	(9.886)	31.10.2023	3
GBP	209.701	USD	(254.214)	31.10.2023	1.780
JPY	1.043.613	GBP	(5.750)	31.10.2023	6
SGD	12	CHF	(8)	31.10.2023	0
SGD	12	CHF	(8)	31.10.2023	0
SGD	390	CHF	(261)	31.10.2023	0
SGD	391	CHF	(261)	31.10.2023	0
SGD	390	CHF	(261)	31.10.2023	0
SGD	8	EUR	(5)	31.10.2023	0
SGD	8	EUR	(5)	31.10.2023	0
SGD	8	EUR	(5)	31.10.2023	0
SGD	238	EUR	(165)	31.10.2023	0
SGD	290	GBP	(174)	31.10.2023	0
USD	311	CHF	(284)	31.10.2023	0
USD	311	CHF	(284)	31.10.2023	0
USD	9.870	CHF	(9.000)	31.10.2023	3
USD	9.868	CHF	(8.999)	31.10.2023	3
USD USD	9.855 6.899	CHF GBP	(8.987)	31.10.2023	3 0
	alisierten Gewinns aus Dev		(5.652) akten	31.10.2023	24.139
	lust aus Devisenterminkor		(100)	04 40 0000	(0)
CHF CHF	124	EUR EUR	(128)	31.10.2023	(0)
CHF	1.605	EUR	(1.661)	31.10.2023	(1)
CHF	1.605 50.914	EUR	(1.661) (52.694)	31.10.2023 31.10.2023	(1) (33)
CHF	50.904	EUR	(52.684)	31.10.2023	(33)
CHF	50.837	EUR	(52.614)	31.10.2023	(33)
CHF	193	NOK	(2.259)	31.10.2023	(1)
CHF	193	NOK	(2.259)	31.10.2023	(1)
CHF	6.115	NOK	(71.633)	31.10.2023	(33)
CHF	6.113	NOK	(71.618)	31.10.2023	(33)
CHF	6.105	NOK	(71.523)	31.10.2023	(33)
EUR	12.734	NOK	(144.140)	31.10.2023	(59)
EUR	543	NOK	(6.155)	31.10.2023	(4)
EUR	2.498	NOK	(28.272)	31.10.2023	(12)
EUR	721	NOK	(8.175)	31.10.2023	(5)
EUR	199	NOK	(2.252)	31.10.2023	(1)
EUR	199	NOK	(2.254)	31.10.2023	(1)
EUR	199	NOK	(2.254)	31.10.2023	(1)
EUR	6.309	NOK	(71.415)	31.10.2023	(29)
EUR	6.308	NOK	(71.400)	31.10.2023	(29)
EUR	6.306	NOK	(71.374)	31.10.2023	(29)
GBP	15.877	CHF	(17.696)	31.10.2023	(20)
GBP	259	EUR	(300)	31.10.2023	(1)
GBP	47	EUR	(55)	31.10.2023	(0)
GBP GBP	45.353 11.217	EUR EUR	(52.320)	31.10.2023 31.10.2023	(92)
GBP	5.447	NOK	(12.941) (71.124)	31.10.2023	(24) (40)
JPY	34.994	CHF	(71.124) (215)	31.10.2023	(40)
JPY	34.994	CHF	(215)	31.10.2023	(0)
JPY	1.109.659	CHF	(6.819)	31.10.2023	(7)
JPY	1.110.055	CHF	(6.821)	31.10.2023	(7)
JPY	1.108.586	CHF	(6.812)	31.10.2023	(7)

Nicht realisiert Gewinn/(Verlus					
in US	Fälligkeitsdatum	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Kauf
(1	31.10.2023	(13.925)	EUR	2.190.801	JPY
(	31.10.2023	(303)	EUR	47.474	JPY
(	31.10.2023	(204)	EUR	32.045	JPY
(	31.10.2023	(204)	EUR	32.054	JPY
(	31.10.2023	(204)	EUR	32.054	JPY
(	31.10.2023	(6.455)	EUR	1.015.569	JPY
(	31.10.2023	(6.458)	EUR	1.015.985	JPY
(	31.10.2023	(6.455)	EUR	1.015.606	JPY
(	31.10.2023	(164)	EUR	237	SGD
(	31.10.2023	(165)	EUR	238	SGD
(	31.10.2023	(420)	CHF	458	USD
(	31.10.2023	(420)	CHF	458	USD
(7	31.10.2023	(13.353)	CHF	14.566	USD
(7	31.10.2023	(13.351)	CHF	14.563	USD
(7	31.10.2023	(13.333)	CHF	14.544	USD
(1.27	02.10.2023	(167.825)	EUR	176.409	USD
(11	03.10.2023	(45.840)	EUR	48.421	USD
(4	31.10.2023	(6.499)	EUR	6.840	USD
(67	31.10.2023	(74.216)	EUR	77.991	USD
	31.10.2023	(20.696)	EUR	21.935	USD
(3	31.10.2023	(19.753)	EUR	20.908	USD
	31.10.2023	(227)	EUR	239	USD
(	31.10.2023	(240)	EUR	254	USD
(	31.10.2023	(227)	EUR	239	USD
(	31.10.2023	(239)	EUR	254	USD
(	31.10.2023	(227)	EUR	239	USD
(	31.10.2023	(239)	EUR	254	USD
(5	31.10.2023	(7.205)	EUR	7.584	USD
Ì	31.10.2023	(7.575)	EUR	8.028	USD
(5	31.10.2023	(7.204)	EUR	7.583	USD
(*	31.10.2023	(7.598)	EUR	8.053	USD
(5	31.10.2023	(7.201)	EUR	7.580	USD
(3	31.10.2023	(7.596)	EUR	8.050	USD
(5	31.10.2023	(8.217)	GBP	9.974	USD
(3.19		(0.2.17)	-	lisierten Verlusts aus Devi	

#### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in USD	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
MSCI World Index	USD	587	15.12.2023	52.941.530	128.480
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten insgesamt				52.941.530	128.480

#### OPTIONEN

Währung	Menge	Bezeichnung	Fälligkeitsdatum	Marktwert in USD	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in USD
Verkaufte Optionen					
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9100	23.10.2023	(103.300)	(17.300)
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9100	20.11.2023	(230.200)	(10.200)
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9100	18.12.2023	(339.200)	12.800
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9150	23.10.2023	(73.700)	(3.900)
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9150	20.11.2023	(187.300)	5.900
USD	(2.000)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9150	18.12.2023	(290.100)	21.800
USD	(50)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9300	23.10.2023	(585)	4.415
USD	(50)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9400	20.11.2023	(1.320)	5.280
USD	(50)	Call MSCI World Net Return Index, Ausübungskurs 9450	18.12.2023	(2.318)	6.182
Veräußerte O	ptionen gesam	ıt		(1.228.023)	24.977

Der Kontrahent bei Swaps war State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Gegenpartei für Optionskontrakte war Goldman Sachs & Co.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

	% des
Branche	Nettovermögens
Wasserwirtschaft	1.04
Nahrungsmittel und Getränke	1,04
Transport und Verkehr	1,57
Umweltschutz	1,84
Forstprodukte und Papier	2,06
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	2,00
Verpackungen und Container	2,19
Chemikalien	2,09
Wohnungsbauunternehmen	3,38
Computer	3,45
Baustoffe	3,47
Gewerbliche Dienstleistungen	3,58
Gesundheitswesen	4,34
Software	4,63
Elektrische Komponenten und Zubehör	4,71
Internet	5,09
Halbleiter	5,64
Finanzdienstleistungen	5,73
Elektrische Geräte	6,92
Telekommunikation	7,52
Versicherungen	8,21
Arzneimittel	12,45
Anlagen insgesamt	94,93
Sonstige Aktiva / (Passiva)	5,07
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income

### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse I EUR eine Rendite von -1,8 %. Im Vergleich dazu erbrachte der 1-Monats-Euribor eine Rendite von 2,5 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt.

Die Positionierung unseres Portfolios ist weiterhin auf höherwertige, nachhaltige Wachstumsunternehmen ausgerichtet, die trotz der kurzfristigen wirtschaftlich und politisch bedingten Volatilität gedeihen können. Daraus ergibt sich für uns eine Ausrichtung auf Gesundheitswesen, Informationstechnologie und Industrietitel. Unser integrierter Ansatz für nachhaltige Investitionen verhindert jegliche Allokation in Unternehmen, die Waffen oder Tabakwaren herstellen oder die über Reserven an fossilen Brennstoffen verfügen oder Erträge aus diesen generieren. Wir setzen unsere Strategie fort, Positionen aufzustocken, bei denen wir eine starke zugrunde liegende Qualität sehen und der Markt uns Aufstockungen zu attraktiveren Kursen ermöglicht. Aktien und Schuldtitel bleiben unsere umfangreichsten Allokationen, mit einer kleineren Position in alternativen Anlagen.

#### Marktrückblick

Die globalen Aktienmärkte legten in den zwölf Monaten bis zum 30. September 2023 kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Anlegerstimmung im Herbst 2022 beherrschten, und stiegen dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die Besorgnis über Inflation und Rezession blieb jedoch bestehen, auch wenn sie abnahm. Das Jahr 2023 begann mit einer Reihe von Börsenrallys, unterstützt durch die Aufhebung der Covid-Beschränkungen in China, einen warmen Winter, der eine Energiekrise in Europa verhinderte, und eine erwartete Abschwächung der Zinsanhebungen. Dennoch hielt die US-Notenbank (Fed) angesichts der robusten US-Wirtschaft an ihrer restriktiven Zinspolitik fest, was zu Marktvolatilität führte. Darüber hinaus sorgten der Zusammenbruch zweier regionaler Kreditinstitute in den USA und die Rettung der Credit Suisse durch die UBS im Frühjahr für eine kurzzeitige Angst vor einer Finanzkrise. Die Konjunkturerholung in Chinas nach der Aufhebung der Covid-Beschränkungen enttäuschte angesichts des angeschlagenen chinesischen Immobilienmarktes trotz bescheidener Konjunkturmaßnahmen, was sowohl den Binnenmarkt als auch die auf China ausgerichteten Aktien belastete. Darüber hinaus haben die Anleger gegen Ende des Berichtszeitraums die Aktienbewertungen neu kalibriert, als sie feststellten, dass die höheren Zinssätze anhalten und die Kreditkosten steigen würden. Die Renditen der weltweiten Staatsanleihen stiegen im Berichtszeitraum, als Reaktion auf die steigenden Zinssätze. Im letzten Quartal 2022 kam es zu einem sprunghaften Anstieg, da Inflationsängste und das Tempo der Zinsanhebungen im Vordergrund standen. Die Renditen gingen jedoch wieder zurück, als das Tempo der Zinserhöhungen im Jahr 2023 nachließ und die Anleger mit einem Höchststand der Zinssätze und sogar mit Zinssenkungen rechneten, falls sich das Wirtschaftswachstum abschwächen sollte. In den letzten Monaten des Berichtszeitraums stiegen sie jedoch auf neue Höchststände, selbst als sich der Höchststand der Zinssätze näherte, da die Zentralbanken signalisierten, dass die Zinssätze "länger höher" bleiben würden. Dies wurde von einer Versteilerung der Renditekurve begleitet, da die Bewertungen von Anleihen mit kürzerer Laufzeit in Erwartung einer lockereren Geldpolitik stiegen, während die Bewertungen von Anleihen mit längerer Laufzeit aufgrund von Inflationssorgen und der Aussicht auf eine Verschlechterung der Haushaltslage sanken. Während die Renditen von Staatsanleihen stiegen, verengten sich die Kreditspreads, was die relative Widerstandsfähigkeit des Wirtschaftswachstums und solide Erträge widerspiegelte.

### Ausblick

Mit Blick auf die Zukunft rechnen wir nach wie vor mit einer Verlangsamung des globalen Wachstums gegenüber dem Trendniveau, begleitet von einer geringeren, aber immer noch über dem Trend liegenden Inflation. Unsere jüngsten Untersuchungen deuten darauf hin, dass die Auswirkungen der bereits erfolgten Zinserhöhungen in den USA, der Eurozone und dem Vereinigten Königreich auf das BIP-Wachstum wahrscheinlich erst Ende dieses Jahres oder Anfang 2024 vollständig spürbar werden, wenn die bisherigen Straffungszyklen als Anhaltspunkt genommen werden können. Auch wenn der genaue Zeitpunkt ungewiss ist, sind wir zuversichtlich, dass die Wirtschaftstätigkeit von nun an zunehmend die Auswirkungen der früheren geldpolitischen Straffung spüren wird. Dies deutet auf einen positiven fundamentalen Ausblick für Kern-Staatsanleihen hin, deren Renditeaufschläge im Vergleich zu den langfristigen BIP-Prognosen historisch hoch sind. Obwohl wir die Anlageklasse konstruktiv einschätzen, erwarten wir weiterhin eine hohe Volatilität. Bei Unternehmenskrediten, deren Bewertungen eher angemessen als attraktiv sind, dürften die geringen Wachstumsaussichten im kommenden Jahr zu unterdurchschnittlichen, aber immer noch positiven Überschussrenditen gegenüber Kernanleihen führen. Die ermutigende Mischung aus Disinflation und Wirtschaftswachstum in den USA hat dazu geführt, dass wir die Aussichten für Aktien konstruktiver einschätzen als noch vor einigen Monaten. Dennoch bleiben wir in Bezug auf die Anlageklasse als Ganzes etwas zurückhaltend. Das schleppende Wachstum stellt ein leichtes Risiko für die Unternehmensgewinne dar, und, was besorgniserregender ist, die globalen Aktienbewertungen (auf der Basis des Kurs-Gewinn-Verhältnisses) sind im historischen Vergleich hoch, sowohl absolut als auch im Vergleich zu anderen Anlageklassen. Der anhaltende Konflikt in der Ukraine zeigt keine Anzeichen für ein baldiges Ende, und die Eskalation der Spannungen im Nahen Osten bedeutet, dass geopolitische Risiken auf absehbare Zeit weiterhin die Schlagzeilen beherrschen werden.

#### Simon Holmes

Fondsmanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE OD		-	MARKT NOTIE	RTE ÜBERTRAGBAR		
ANLEIHEN						
Australien Australia & New Zealand Banking Group Ltd., V/R	5,10 %	03.02.2033	EUR	100.000	98.675	0,15
Belgien KBC Group NV	4,38 %	06.12.2031	EUR	200.000	196.162	0,31
Kanada Bank of Nova Scotia	4,50 %	16.12.2025	USD	550.000	502.218	0,79
Kaimaninseln Southern Water Services Finance Ltd.	3,00 %	28.05.2037	GBP	132.000	97.847	0,15
Dänemark Orsted AS	1,50 %	26.11.2029	EUR	273.000	234.787	0,37
Orsted AS Orsted AS, V/R	1,50 %	18.02.3021	EUR	116.000	84.654	0,13
					319.441	0,50
Finnland Nordea Bank Abp	0,38 %	28.05.2026	EUR	500.000	457.287	0,72
Frankreich						
AXA SA, V/R	1,38 %	07.10.2041	EUR	100.000	76.061	0,12
AXA SA, V/R Bangue Federative du Credit Mutuel SA	3,38 %	06.07.2047 08.10.2027	EUR EUR	302.000 100.000	285.234 85.686	0,45
Banque Federative du Credit Mutuel SA Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,10 % 4,13 %	18.09.2030	EUR	100.000	98.890	0,13 0,15
BNP Paribas SA	4,38 %	12.05.2026	USD	600.000	542.666	0,85
BPCE SA	4,13 %	10.07.2028	EUR	100.000	99.538	0,16
Credit Agricole SA, V/R	4,00 %	12.10.2026	EUR	100.000	99.454	0,16
Engie SA	3,50 %	27.09.2029	EUR	100.000	97.153	0,15
Engie SA	3,63 %	11.01.2030	EUR	100.000	97.315	0,15
Imerys SA	1,00 %	15.07.2031	EUR	100.000	74.993	0,12
Orange SA	0,13 %	16.09.2029	EUR	100.000	80.898	0,13
Orange SA, V/R	5,00 %	29.10.2049	EUR	429.000	427.929	0,67
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR Schneider Electric SE	0,75 %	12.01.2034	EUR EUR	100.000	73.972	0,12
Scrifterder Electric SE Societe Generale SA, V/R	0,25 % 0,88 %	11.03.2029 22.09.2028	EUR	100.000 100.000	83.499 86.445	0,13 0,13
Societe Generale SA, V/R	5,25 %	06.09.2032	EUR	100.000	99.188	0,15
Suez SACA	2,38 %	24.05.2030	EUR	100.000	88.670	0,14
					2.497.591	3,91
Deutschland						
Amprion GmbH	4,13 %	07.09.2034	EUR	100.000	97.333	0,15
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0,00 %	15.08.2031	EUR	2.700.000	2.186.506	3,42
Deutsche Bahn Finance GMBH Deutsche Bank AG, V/R	1,38 % 1,88 %	16.04.2040 23.02.2028	EUR EUR	165.000 200.000	112.579 178.903	0,18 0,28
E.ON SE	3,88 %	12.01.2035	EUR	47.000	44.686	0,20
Mercedes-Benz Group AG	0,75 %	10.09.2030	EUR	305.000	247.366	0,39
Mercedes-Benz Group AG	0,75 %	11.03.2033	EUR	46.000	34.453	0,05
Talanx AG, V/R	1,75 %	01.12.2042	EUR	100.000	73.788	0,12
Vonovia SE	5,00 %	23.11.2030	EUR	100.000	98.854	0,15
Vonovia SE	0,63 %	24.03.2031	EUR	100.000	72.681	0,11
ZF Finance GmbH	2,00 %	06.05.2027	EUR	100.000	87.819 3.234.968	0,14 <b>5,06</b>
		<i></i>	FUE	000		
AIB Group PLC, V/R	2,25 %	04.04.2028	EUR	220.000	201.627	0,32
Bank of Ireland Group PLC, V/R Bank of Ireland Group PLC, V/R	5,00 %	04.07.2031 11.08.2031	EUR EUR	100.000 152.000	100.058 135.155	0,16
ESB Finance DAC	1,38 % 4,25 %	03.03.2036	EUR	100.000	99.137	0,21 0,15
Johnson Controls International PLC	4,25 %	23.05.2035	EUR	129.000	124.206	0,10
Kerry Group Financial Services Unltd Co.	0,88 %	01.12.2031	EUR	140.000	109.098	0,17
Smurfit Kappa Treasury ULC	1,50 %	15.09.2027	EUR	350.000	317.575	0,50
Smurfit Kappa Treasury ULC	0,50 %	22.09.2029	EUR	100.000	80.778	0,13
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., V/R	1,88 %	17.09.2050	EUR	290.000	232.356	0,36
Italien					1.399.990	2,19
Intesa Sanpaolo SpA	0,75 %	16.03.2028	EUR	154.000	130.971	0,20
Terna - Rete Elettrica Nazionale	0,75 %	24.07.2032	EUR	100.000	75.528	0,12
Terna - Rete Elettrica Nazionale, V/R	2,38 %	31.12.2099	EUR	100.000	86.468	0,14
					292.967	0,46

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Luxemburg						
AXA Logistics Europe Master SCA	0,88 %	15.11.2029	EUR	227.000	179.505	0,28
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl	1,63 %	20.04.2030	EUR	115.000	85.597	0,13
Prologis International Funding II SA	3,63 %	07.03.2030	EUR	100.000	92.988	0,15
Prologis International Funding II SA	2,75 %	22.02.2032	GBP	100.000	91.515	0,14
Prologis International Funding II SA	4,63 %	21.02.2035	EUR	100.000	94.618	0,15
Segro Capital Sarl	0,50 %	22.09.2031	EUR	100.000	72.540	0,11
Niederlande					616.763	0,96
ABN AMRO Bank NV	4,00 %	16.01.2028	EUR	100.000	98.332	0,15
Akzo Nobel NV	1,63 %	14.04.2030	EUR	156.000	132.669	0,21
Compass Group Finance Netherlands BV	3,00 %	08.03.2030	EUR	100.000	94.199	0,15
Cooperatieve Rabobank UA, V/R	1,00 %	24.09.2026	USD	450.000	384.524	0,60
Digital Dutch Finco BV	1,50 %	15.03.2030	EUR	100.000	80.854	0,13
Digital Dutch Finco BV	1,00 %	15.01.2032	EUR	110.000	79.526	0,12
EnBW International Finance BV	3,63 %	22.11.2026	EUR	29.000	28.761	0,05
EnBW International Finance BV	4,05 %	22.11.2029	EUR	19.000	18.969	0,03
Enexis Holding NV	0,63 %	17.06.2032	EUR	100.000	77.093	0,12
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV	1,75 %	29.03.2030	EUR	255.000	220.411	0,35
ING Groep NV, V/R	0,25 %	01.02.2030	EUR	200.000	158.385	0,25
ING Groep NV, V/R	1,00 %	13.11.2030	EUR	200.000	181.420	0,28
ING Groep NV, V/R	0,88 %	09.06.2032	EUR	100.000	85.084	0,13
Koninklijke KPN NV	0,88 %	14.12.2032	EUR	100.000	75.225	0,12
Mondelez International Holdings Netherlands BV	0,25 %	09.09.2029	EUR	254.000	205.363	0,32
OI European Group BV	2,88 %	15.02.2025	EUR	150.000	146.246	0,23
RELX Finance BV	0,50 %	10.03.2028	EUR	575.000	497.510	0,78
Siemens Financieringsmaatschappij NV	3,50 %	24.02.2036	EUR	100.000	93.915	0,15
Telefonica Europe BV, V/R	2,50 %	31.12.2099	EUR	200.000	174.888	0,27
TenneT Holding BV	0,13 %	30.11.2032	EUR	100.000	84.928	0,13
TenneT Holding BV	2,75 %	17.05.2042	EUR	106.000	90.603	0,14
Volkswagen International Finance NV	4,38 %	15.05.2030	EUR	100.000	98.127	0,15
Norwegen					3.107.032	4,86
DNB BANK ASA, V/R	3,13 %	21.09.2027	EUR	213.000	207.157	0,32
DNB BANK ASA, V/R	4,00 %	14.03.2029	EUR	127.000	126.310	0,20
Telenor ASA	0,25 %	14.02.2028	EUR	466.000	398.320	0,62
Singapur					731.787	1,14
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	4,45 %	19.05.2028	USD	39.000	35.572	0,06
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	4,75 %	19.05.2033	USD	112.000	100.462	0,16
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	5,34 %	19.05.2063	USD	84.000	72.924	0,11
Spanien					208.958	0,33
Banco Santander SA	0,30 %	04.10.2026	EUR	300.000	269.425	0,42
CaixaBank SA, V/R	0,38 %	18.11.2026	EUR	200.000	182.637	0,29
CaixaBank SA, V/R	0,50 %	09.02.2029	EUR	100.000	83.413	0,13
					535.475	0,84
Schweden Swedbank AB, V/R	0,30 %	20.05.2027	EUR	288.000	258.217	0.40
Swedbank AB, V/R	1,38 %	08.12.2027	GBP	184.000	183.362	0,29
					441.579	0,69
Vereinigtes Königreich AstraZeneca PLC	0,38 %	03.06.2029	EUR	158.000	131.036	0,21
Cadent Finance PLC	4,25 %	05.07.2029	EUR	100.000	98.979	0,21
DS Smith PLC	4,23 %	27.07.2029	EUR	147.000	146.762	0,13
ENW Finance PLC	4,89 %	24.11.2032	GBP	100.000	107.961	0,23
Experian Finance PLC	1,38 %	25.06.2026	EUR	500.000	466.103	0,17
GlaxoSmithKline Capital Plc	1,38 %	12.10.2028	GBP	157.000	150.924	0,73
Karbon Homes Ltd.	3,38 %	15.11.2047	GBP	100.000	80.587	0,24
Legal & General Group PLC, V/R	5,13 %	14.11.2048	GBP	462.000	492.018	0,13
Lloyds Banking Group PLC, V/R	1,88 %	15.01.2026	GBP	402.000	467.865	0,73
Lloyds Banking Group PLC, V/R	1,99 %	15.12.2031	GBP	100.000	99.008	0,16
Motability Operations Group PLC	4,88 %	17.01.2043	GBP	100.000	103.966	0,16
Nationwide Building Society	3,25 %	20.01.2028	GBP	274.000	287.510	0,45
Nationwide Building Society, V/R	2,97 %	16.02.2028	USD	200.000	169.091	0,45
NatWest Group PLC, V/R	4,70 %	14.03.2028	EUR	100.000	99.676	0,20
NatWest Group PLC, V/R	4,70 %	06.09.2028	EUR	100.000	97.636	0,15
NatWest Group PLC, V/R	2,06 %	09.11.2028	GBP	100.000	97.954	0,15
NatWest Group PLC, V/R	0,78 %	26.02.2030	EUR	156.000	125.701	0,13
Pearson Funding PLC	3,75 %	04.06.2030	GBP	148.000	147.917	0,20
Phoenix Group Holdings PLC	4,38 %	24.01.2029	EUR	309.000	282.689	0,23
	1,00 /0	2		000.000	202.000	0,44

Wertpapierbezeichnung	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Währung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Sanctuary Capital PLC	2,38 %	14.04.2050	GBP	100.000	62.226	0,10
Standard Chartered PLC, V/R	1,21 %	23.03.2025	USD	321.000	296.544	0,46
Tesco Corporate Treasury Services PLC	2,50 %	02.05.2025	GBP	285.000	314.492	0,49
Britische Gilts	0,88 %	31.07.2033	GBP	5.906.973	4.898.304	7,66
Britische Gilts	1,50 %	31.07.2053	GBP	5.619.870	3.089.954	4,83
United Utilities Water Finance PLC	1,88 %	03.06.2042	GBP	115.000	71.323	0,11
Vodafone Group Plc	4,38 %	30.05.2028	USD	650.000	593.616	0,93
Yorkshire Building Society	0,50 %	01.07.2028	EUR	142.000	117.794	0,18
Yorkshire Water Finance PLC	5,25 %	28.04.2030	GBP	151.000	164.128	0,26
USA					13.261.764	20,74
American International Group, Inc.	5,13 %	27.03.2033	USD	279.000	245.524	0,38
Amgen, Inc.	5,50 %	07.12.2026	GBP	348.000	402.289	0,63
Amgen, Inc.	5,75 %	02.03.2063	USD	37.000	32.230	0,05
AstraZeneca Finance LLC	2,25 %	28.05.2031	USD	118.000	89.912	0,14
AstraZeneca Finance LLC	4,88 %	03.03.2033	USD	194.000	177.019	0,28
Bank of America Corp.	4,13 %	12.06.2028	EUR	100.000	99.000	0,16
Bank of America Corp., V/R	2,46 %	22.10.2025	USD	344.000	312.151	0,49
Citigroup, Inc., V/R	3,71 %	22.09.2028	EUR	100.000	97.665	0,15
Comcast Corp.	2,89 %	01.11.2051	USD	174.000	97.204	0,15
CVS Health Corp.	5,05 %	25.03.2048	USD	246.000	193.704	0,30
Eli Lilly & Co.	0,50 %	14.09.2033	EUR	198.000	146.578	0,30
Equinix, Inc.	0,30 %	15.03.2027	EUR	100.000	87.444	0,23
Fidelity National Information Services, Inc.	5,10 %	15.07.2032	USD	160.000	142.898	0,14
Fidelity National Information Services, Inc.	2,95 %	21.05.2032	EUR	239.000	142.898	0,22
			GBP			
Fiserv, Inc.	3,00 %	01.07.2031		419.000	397.358	0,62
Five Corners Funding Trust II	2,85 %	15.05.2030	USD	198.000	156.118	0,25
Haleon U.S. Capital LLC	3,63 %	24.03.2032	USD	250.000	202.675	0,32
Metropolitan Life Global Funding I	5,15 %	28.03.2033	USD	252.000	225.658	0,35
Prologis Euro Finance LLC	0,38 %	06.02.2028	EUR	221.000	187.283	0,29
Thermo Fisher Scientific, Inc.	1,50 %	01.10.2039	EUR	301.000	200.835	0,31
UnitedHealth Group, Inc.	4,25 %	15.01.2029	USD	279.000	251.017	0,39
UnitedHealth Group, Inc.	5,05 %	15.04.2053	USD	279.000	235.769	0,37
Verizon Communications, Inc.	3,88 %	08.02.2029	USD	500.000	433.027	0,68
VF Corp.	0,25 %	25.02.2028	EUR	250.000	206.668	0,32
Visa, Inc. Wells Fargo & Co., V/R	1,90 % 5,56 %	15.04.2027 25.07.2034	USD USD	158.000 278.000	133.959 248.694	0,21 0,39
Wells Faigu & Co., WK	5,56 %	25.07.2054	030	278.000	5.188.538	8,11
ANLEIHEN GESAMT					33.189.042	51,91
FONDS						
Guernsey Renewables Infrastructure Group Ltd.				520.387	639.508	1,00
Jersey						· · · · ·
Digital 9 Infrastructure PLC Vereinigtes Königreich				754.006	336.394	0,52
Downing Renewables & Infrastructure Trust PLC				586.742	602.680	0,94
Greencoat U.K. Wind PLC				407.592	657.833	1,03
Triple Point Energy Efficiency Infrastructure PLC				853.104	604.838	0,95
					1.865.351	2,92
FONDS GESAMT					2.841.253	4,44
ANTEILE						
Australien CSL Ltd.				1.812	277.026	0,43
Telstra Corp. Ltd				19.030	44.662	0,07
					321.688	0,50
Kanada						
Bank of Nova Scotia				1.290	54.864	0,09
Brookfield Renewable Partners LP				17.652	362.460	0,57
Constellation Software, Inc.				28	54.850	0,08
Descartes Systems Group, Inc.				2.742	190.963	0,30
					663.137	1,04

Dänemark         Novo Nordisk AS 'B'         Vestas Wind Systems AS         Frankreich         Air Liquide SA         AXA SA         Cie de Saint-Gobain         Dassault Systemes SE         EssilorLuxottica SA         Schneider Electric SE         Deutschland         Allianz SE	924 7.144 390 2.044 2.083 1.244 293 3.262	79.786 145.199 <b>224.985</b> 62.337 57.600 118.481	0,12 0,23 <b>0,35</b> 0,10 0,09
Vestas Wind Systems AS  Frankreich Air Liquide SA AXA SA Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE  Deutschland	7.144 390 2.044 2.083 1.244 293	145.199 224.985 62.337 57.600 118.481	0,23 <b>0,35</b> 0,10
Frankreich Air Liquide SA AXA SA Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	390 2.044 2.083 1.244 293	<b>224.985</b> 62.337 57.600 118.481	<b>0,35</b> 0,10
Air Liquide SA AXA SA Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	2.044 2.083 1.244 293	62.337 57.600 118.481	0,10
Air Liquide SA AXA SA Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	2.044 2.083 1.244 293	57.600 118.481	
AXA SA Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	2.044 2.083 1.244 293	57.600 118.481	
Cie de Saint-Gobain Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	2.083 1.244 293	118.481	
Dassault Systemes SE EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	1.244 293		0,00
EssilorLuxottica SA Schneider Electric SE Deutschland	293	43.907	0,07
Deutschland	3.262	48.392	0,08
		512.069	0,80
		842.786	1,32
	990	223.443	0,35
Deutsche Telekom AG	6.501	129.162	0,20
E.ON SE	10.947	122.606	0,19
Infineon Technologies AG	5.861	183.772	0,29
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG	478	176.430	0,28
Siemens Healthineers AG	3.389	162.672	0,25
Hongkong		998.085	1,56
AIA Group Ltd.	6.400	49.281	0,07
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	500	17.644	0,03
Indien		66.925	0,10
HDFC Bank Ltd.	5.263	293.336	0,46
Indonesien			
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	491.500	156.945	0,25
Irland	0.004	004 000	
Aptiv PLC	2.384	221.996	0,35
Greencoat Renewables PLC	658.955	633.915	0,99
Kerry Group PLC	2.847 13.294	225.425	0,35 0,66
Smurfit Kappa Group PLC Trane Technologies PLC	707	419.559 135.497	0,00
	101	1.636.392	2,56
Italien	95.740	222.005	0.07
Intesa Sanpaolo SpA Japan	95.740	233.605	0,37
Astellas Pharma, Inc.	3.800	49.884	0,08
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd	2.100	61.461	0,00
Daiichi Sankyo Co. Ltd	1.200	31.186	0,10
Daiwa House Industry Co. Ltd.	15.000	381.190	0,60
Hoya Corp.	2.200	213.397	0,33
Keyence Corp.	900	316.155	0,49
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	9.300	74.669	0,12
Mizuho Financial Group, Inc.	3.800	61.116	0,10
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	45.000	50.300	0,08
Shimadzu Corp.	7.500	188.554	0,29
SoftBank Group Corp.	1.200	48.116	0,07
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd	10.600	311.374	0,49
Tokio Marine Holdings, Inc.	14.000	307.041	0,48
Tokyo Electron Ltd.	400	51.750	0,08
Niederlande		2.146.193	3,36
ASML Holding NV	394	220.285	0,34
ING Groep NV	2.089	26.217	0,04
NXP Semiconductors NV	268	50.606	0,08
Norwegen		297.108	0,46
MOWI ASA	9.891	166.416	0,26
Singapur	100 50-	470 574	0.65
ComfortDelGro Corp. Ltd.	198.500	178.571	0,28
DBS Group Holdings Ltd.	2.500	58.197	0,09
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd	2.700	23.934 260.702	0,04 0,41

Wertpapierbezeichnung	Stück/Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Schweiz		50.000	
Chubb Ltd. DSM-Firmenich AG	297 3.259	58.398 261.144	0,09 0,41
Novartis AG.	3.259 697	67.552	0,41
SGS SA	2.691	213.992	0,33
		601.086	0,94
Taiwan Taiwan Samisandustar Manufasturing Co. Ltd	5.400	442 224	0.60
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. Vereinigtes Königreich	5.400	443.221	0,69
AstraZeneca PLC	3.825	489.547	0,77
BT Group PLC	119.229	160.404	0,25
Compass Group PLC	1.510	34.815	0,05
Ferguson PLC	400	62.138	0,10
GSK PLC	11.110	191.093	0,30
Impact Healthcare Reit PLC	643.505	615.733	0,96
Legal & General Group PLC	84.183	215.932	0,34
RELX PLC SSE PLC	6.179 13.954	197.671 258.992	0,31 0,40
VH Global Sustainable Energy Opportunities PLC	674.518	600.306	0,40
Vodafone Group Plc	16.771	14.852	0,04
		2.841.483	4,44
USA	4.400	000.004	0.07
Acuity Brands, Inc.	1.482	238.394	0,37
Advanced Drainage Systems, Inc. Aflac, Inc.	1.921 846	206.534 61.327	0,32 0,10
Ariac, Inc. Air Products & Chemicals, Inc.	846 178	61.327 47.646	0,10
American Express Co.	377	53.124	0,07
American Tower Corp.	360	55.917	0,09
American Water Works Co., Inc.	969	113.333	0,18
Americold Realty Trust, Inc.	6.222	178.712	0,28
Amgen, Inc.	266	67.523	0,11
Applied Materials, Inc.	494	64.599	0,10
Archer-Daniels-Midland Co	644	45.875	0,07
Arista Networks, Inc.	325	56.460	0,09
Autodesk, Inc.	1.003	196.015	0,31
Becton Dickinson & Co.	958	233.928	0,37
Boston Scientific Corp.	1.314 410	65.529	0,10
Broadcom, Inc. Builders FirstSource, Inc.	391	321.641 45.975	0,50 0,07
Cadence Design Systems, Inc.	260	57.538	0,07
Centene Corp.	616	40.076	0,06
Charles Schwab Corp.	1.056	54.757	0,09
CME Group, Inc.	282	53.329	0,08
Colgate-Palmolive Co.	3.405	228.694	0,36
Copart, Inc.	1.344	54.699	0,09
Crowdstrike Holdings, Inc. 'A'	1.435	226.862	0,35
Crown Castle, Inc.	611	53.110	0,08
CVS Health Corp.	5.900	389.080	0,61
Danaher Corp. Deere & Co.	293 177	68.659 63.090	0,11
			0,10
Dexcom, Inc. DR Horton, Inc.	1.852 476	163.203 48.317	0,26 0,08
eBay, Inc.	7.345	305.871	0,48
Ecolab, Inc.	156	24.960	0,04
Edwards Lifesciences Corp.	580	37.953	0,06
Elevance Health, Inc.	505	207.686	0,32
Eli Lilly & Co.	541	274.463	0,43
Emerson Electric Co.	3.454	315.044	0,49
Equinix, Inc.	85	58.307	0,09
Fidelity National Information Services, Inc.	981	51.211	0,08
Fiserv, Inc.	527	56.227	0,09
Fortinet Inc	900	49.881	0,08
Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc. HCA Healthcare, Inc.	10.954 199	219.339 46.234	0,34 0,07
HP, Inc.	1.829	46.234 44.397	0,07
Humana, Inc.	533	244.926	0,07
Incyte Corp.	526	28.701	0,05
Intercontinental Exchange, Inc.	536	55.698	0,09
Intuit, Inc.	137	66.114	0,10
Intuitive Surgical, Inc.	782	215.887	0,34
IQVIA Holdings, Inc.	262	48.688	0,08
Johnson Controls International PLC	5.132	257.921	0,40
KLA Corp.	125	54.151	0,08
Lam Research Corp.	103	60.975	0,10

Wertpapierbezeichnung	Stück/Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
Linde PLC	1.977	695.288	1,09
Lowe's Cos., Inc.	318	62.426	0,10
Mastercard, Inc. 'A'	1.318	492.854	0,77
Mettler-Toledo International, Inc.	49	51.283	0,08
Microsoft Corp.	3.480	1.037.837	1,62
Motorola Solutions, Inc.	2.882	741.058	1,16
NetApp, Inc.	9.679	693.688	1,08
NortonLifeLock, Inc.	14.782	246.844	0,39
NVIDIA Corp.	1.452	596.558	0,93
Otis Worldwide Corp.	600	45.512	0,07
Packaging Corp. of America	2.039	295.715	0,46
PayPal Holdings, Inc.	843	46.547	0,07
Pfizer, Inc.	7.881	246.907	0,39
PNC Financial Services Group, Inc.	343	39.773	0,06
Progressive Corp.	300	39.471	0,06
PulteGroup, Inc.	708	49.518	0,08
QUALCOMM, Inc.	601	63.043	0,10
Quest Diagnostics, Inc.	1.317	151.584	0,24
Roper Technologies, Inc.	563	257.520	0,40
S&P Global, Inc.	178	61.434	0,10
Salesforce, Inc.	303	58.033	0,09
ServiceNow, Inc.	136	71.800	0,11
Snowflake, Inc. 'A'	113	16.305	0,03
Stryker Corp.	250	64.527	0,10
Synopsys, Inc.	138	59.823	0,09
TE Connectivity Ltd.	1.735	202.432	0,32
Thermo Fisher Scientific, Inc.	690	329.877	0,52
Travelers Cos., Inc.	327	50.439	0,02
Trimble, Inc.	5.052	257.002	0,00
Truist Financial Corp.	1.157	31.265	0,40
USA Bancorp	1.184	36.971	0,05
Veeva Systems, Inc. 'A'	300	57.648	0,00
VeriSign Inc	249	47.632	0,03
Verisk Analytics, Inc.	1.034	230.717	0,07
Visa. Inc. 'A'	421	91.461	0,30
	380	59.752	0,14
VMware, Inc. 'A'			
Waste Management, Inc.	1.594 3.441	229.506	0,36
Xylem, Inc.		295.853	0,46
Zebra Technologies Corp. 'A'	517	115.500	0,18
Zoetis, Inc.	1.288	211.652 14.711.635	0,33 23,01
Uruguay	400		
MercadoLibre, Inc.	188	225.135	0,35
ANTEILE GESAMT		27.130.863	42,43
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOTIEI ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	RTE	63.161.158	98,78
ANLAGEN INSGESAMT		63.161.158	98,78
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		780.267	1,22
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	_	63.941.425	100,00

DERIVATE

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kauf	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn a	us Devisenterminkon	trakten			
AUD	16.325	EUR	(9.884)	24.10.2023	67
DKK	703.512	EUR	(94.359)	24.10.2023	4
DKK	139.679	EUR	(18.735)	24.10.2023	1
DKK	44.847	EUR	(6.014)	24.10.2023	2
EUR	442.511	CHF	(421.956)	24.10.2023	6.260
EUR	344.854	DKK	(2.568.773)	24.10.2023	298
EUR	11.845	DKK	(88.232)	24.10.2023	10
EUR	12.258	DKK	(91.376)	24.10.2023	1
EUR	4.266.024	GBP	(3.668.405)	19.10.2023	39.366
EUR	4.259.133	GBP	(3.662.480)	19.10.2023	39.303
EUR	3.934.549	GBP	(3.383.366)	19.10.2023	36.307
EUR	3.895.138	GBP	(3.349.476)	19.10.2023	35.944
EUR	108.407	GBP	(92.923)	19.10.2023	1.343
EUR	97.179	GBP	(83.713)	19.10.2023	726
EUR	1.433.958	GBP	(1.235.187)	24.10.2023	11.051
EUR	1.478	HKD	(12.202)	24.10.2023	7
EUR	81.632	JPY	(12.851.012)	24.10.2023	85
EUR	48.374	USD	(51.052)	24.10.2023	196
EUR	74.992	USD	(79.144)	24.10.2023	304
EUR	12.556	USD	(13.237)	24.10.2023	65
GBP	3.349.476	EUR	(3.847.279)	19.10.2023	11.915
GBP	3.761.328	EUR	(4.320.341)	19.10.2023	13.380
GBP	3.746.193	EUR	(4.302.957)	19.10.2023	13.326
GBP	3.462.233	EUR	(3.976.794)	19.10.2023	12.316
HKD	21.183	EUR	(2.520)	24.10.2023	34
HKD	13.385	EUR	(1.607)	24.10.2023	6
NOK	44.285	EUR	(3.869)	24.10.2023	61
SEK	157.148	EUR	(13.530)	31.10.2023	132
SEK	3.039	EUR	(13.330)	31.10.2023	2
USD	20.738	EUR	(19.563)	18.10.2023	12
USD	48.058	EUR	(45.336)		28
USD	22.204	EUR	(43.336) (20.520)	18.10.2023	438
USD	234.941	EUR		19.10.2023	4.635
USD			(217.124)	19.10.2023	
	45.611	EUR	(41.803)	19.10.2023	1.249
USD	62.455	EUR	(57.241)	19.10.2023	1.710
USD	15.029	EUR	(13.802)	19.10.2023	383
USD	42.725	EUR	(39.238)	19.10.2023	1.090
USD	8.485	EUR	(7.807)	19.10.2023	202
USD	6.890	EUR	(6.364)	19.10.2023	139
USD	555	EUR	(515)	19.10.2023	8
USD	9.956	EUR	(9.261)	19.10.2023	137
USD	22.165	EUR	(20.617)	19.10.2023	305
USD	6.830	EUR	(6.352)	19.10.2023	95
USD	4.184	EUR	(3.891)	19.10.2023	58
USD	32.027	EUR	(30.000)	19.10.2023	230
USD	30.152	EUR	(28.244)	19.10.2023	217
USD	35.975	EUR	(33.779)	19.10.2023	178
USD	6.382.905	EUR	(6.021.109)	19.10.2023	3.664
USD	65.320	EUR	(61.618)	19.10.2023	38
USD	6.958	EUR	(6.563)	20.10.2023	4
USD	28.249	EUR	(26.647)	20.10.2023	16
USD	393.295	EUR	(369.304)	24.10.2023	1.847
USD	198.098	EUR	(186.831)	24.10.2023	113
USD Summe des nicht realisiert	28.203 en Gewinns aus Devi	EUR senterminkontrakten	(26.592)	24.10.2023	23 239.331
Nicht realisierter Verlust au					
CAD	15.548	EUR	(10.856)	24.10.2023	(0)
CHF	210.042	EUR	(220.380)	24.10.2023	(3.222)
CHF	5.797	EUR	(6.055)	24.10.2023	(62)
DKK	329.015	EUR	(44.176)	24.10.2023	(44)
DKK	211.994	EUR	(28.443)	24.10.2023	(44)
DKK	42.049	EUR	(5.641)	24.10.2023	(0)
DKK	52.032	EUR	(6.980)	24.10.2023	(1)
EUR		AUD	(419.735)		
	249.460	CAD	. ,	24.10.2023	(6.385)
	000 470		(330.377)	24.10.2023	(7.207)
EUR	223.476		(70.000)	40.40.0000	
EUR EUR	88.086	GBP	(76.686)	18.10.2023	(273)
EUR EUR EUR	88.086 90.751	GBP GBP	(78.867)	19.10.2023	(118)
EUR EUR EUR EUR	88.086 90.751 3.943.774	GBP GBP GBP	(78.867) (3.434.092)	19.10.2023 24.10.2023	(118) (12.220)
EUR EUR EUR EUR EUR	88.086 90.751 3.943.774 3.911.922	GBP GBP GBP GBP	(78.867) (3.434.092) (3.406.357)	19.10.2023 24.10.2023 24.10.2023	(118) (12.220) (12.122)
EUR EUR EUR EUR EUR EUR	88.086 90.751 3.943.774 3.911.922 4.254.753	GBP GBP GBP GBP GBP	(78.867) (3.434.092) (3.406.357) (3.704.881)	19.10.2023 24.10.2023 24.10.2023 24.10.2023 24.10.2023	(118) (12.220) (12.122) (13.184)
EUR EUR EUR EUR EUR	88.086 90.751 3.943.774 3.911.922	GBP GBP GBP GBP	(78.867) (3.434.092) (3.406.357)	19.10.2023 24.10.2023 24.10.2023	(118) (12.220) (12.122)

Nicht realisiert Gewinn/(Verlus in EU	Fälligkeitsdatum	Nominalwert	Verkauf	Nominalwert	Kauf
(9.23	24.10.2023	(304.417.045)	JPY	1.922.484	EUR
(2.99	24.10.2023	(1.396.378)	NOK	120.918	EUR
(5	24.10.2023	(39.287)	NOK	3.434	EUR
(	31.10.2023	(1.614)	SEK	140	EUR
(3.57	24.10.2023	(274.307)	SGD	186.260	EUR
(24	18.10.2023	(20.738)	USD	19.327	EUR
(57	18.10.2023	(48.058)	USD	44.788	EUR
(125.91	19.10.2023	(6.382.905)	USD	5.898.863	EUR
(	19.10.2023	(208)	USD	191	EUR
(27	19.10.2023	(13.784)	USD	12.732	EUR
(13	19.10.2023	(9.519)	USD	8.848	EUR
(25	19.10.2023	(17.396)	USD	16.170	EUR
(23	19.10.2023	(21.689)	USD	20.233	EUR
(10	19.10.2023	(9.567)	USD	8.925	EUR
(49	19.10.2023	(39.577)	USD	36.859	EUR
(90	19.10.2023	(71.999)	USD	67.054	EUR
(13	19.10.2023	(10.258)	USD	9.544	EUR
(10	19.10.2023	(16.248)	USD	15.118	EUR
(17	19.10.2023	(23.362)	USD	21.880	EUR
(28	19.10.2023	(39.165)	USD	36.681	EUR
(46	19.10.2023	(44.054)	USD	41.118	EUR
(40	19.10.2023	(38.746)	USD	36.380	EUR
					EUR
(39	19.10.2023	(78.906)	USD	74.085	
(62	19.10.2023	(125.975)	USD	118.278	EUR
(5	19.10.2023	(10.993)	USD	10.325	EUR
(4	19.10.2023	(74.058)	USD	69.860	EUR
(7	20.10.2023	(6.958)	USD	6.494	EUR
(29	20.10.2023	(28.249)	USD	26.366	EUR
(133.43	24.10.2023	(4.780.891)	USD	4.378.274	EUR
(6.32	24.10.2023	(224.790)	USD	205.808	EUR
(116.54	24.10.2023	(3.984.076)	USD	3.643.220	EUR
(114.17	24.10.2023	(3.818.369)	USD	3.489.207	EUR
(5.79	24.10.2023	(859.255)	USD	805.083	EUR
(2	24.10.2023	(45.006)	USD	42.446	EUR
(3.60	24.10.2023	(6.301.092)	USD	5.942.714	EUR
(72	18.10.2023	(89.085)	EUR	76.686	GBP
(2.10	24.10.2023	(216.573)	EUR	186.172	GBP
(16	24.10.2023	(35.959)	EUR	31.069	GBP
(66	24.10.2023	(221.306)	EUR	191.532	GBP
(35	24.10.2023	(117.841)	EUR	101.987	GBP
(23	24.10.2023	(78.568)	EUR	67.998	GBP
(20	24.10.2023	(1.630)	EUR	13.462	HKD
(1.71	24.10.2023	(333.656)	EUR	52.309.923	JPY
(1.7	24.10.2023	(44.070)	EUR	6.917.616	JPY
(1)	24.10.2023	(1.939)	EUR	2.044	USD

-----

### TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Währung	Anzahl der Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Marktwert in EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in EUR
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten					
MSCI World Index	USD	(60)	15.12.2023	(5.111.121)	186.706
UK Long Gilt Future	GBP	(15)	27.12.2023	(1.628.245)	0
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten i	nsgesamt			(6.739.366)	186.706
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten					
German Federal Republic Bond 30YR	EUR	15	07.12.2023	1.835.400	(124.200)
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten in	nsgesamt			1.835.400	(124.200)

#### OPTIONEN

				Marktwert in	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Währung	Menge	Bezeichnung	Fälligkeitsdatum	EUR	in EUR
Gekaufte Optionen					
USD	950	Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 4150	15.12.2023	59.894	15.940
USD	1.900	Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 4300	15.12.2023	198.300	(16.648)
Gekaufte Optionen g	gesamt			258.194	(708)
Verkaufte Optionen					
USD	(1.900)	Put S&P 500 E-mini Index Future Option, Ausübungskurs 3950	15.12.2023	(61.913)	(7.617)
Veräußerte Optioner	n gesamt			(61.913)	(7.617)

## Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Die Kontrahenten bei Devisenterminkontrakten waren Bank of Montreal, Barclays Bank Plc. Wholesale, BNP Paribas S.A., Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Ltd., HSBC Bank Plc., JP Morgan Securities Plc., Lloyds Bank Corporate Markets Plc. und State Street Bank & Trust Company.

Die Gegenpartei für Futures-Kontrakte war Goldman Sachs & Co.

Die Gegenpartei für Optionskontrakte war Goldman Sachs & Co.

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income **Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen** zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Landwirtschaft	0,07
Einzelhandel	0,10
Öl und Gas	0,15
Büro und Geschäftsausstattung	0,18
Vertrieb und Großhandel	0,19
Energie	0,23
Umweltschutz	0,36
Medien	0,38
Transport und Verkehr	0,46
Forstprodukte und Papier	0,66
Wohnungsbauunternehmen	0,76
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	0,79
Wasserwirtschaft	0,84
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	1,03
Automobilzulieferer	1,08
Maschinenbau	1,12
Baustoffe	1,17
Biotechnologie	1,27
Internet	1,29
Verpackungen und Container	1,55
Computer	1,58
Elektrische Komponenten und Zubehör	1,79
Nahrungsmittel und Getränke	1,79
Chemikalien	1,92
Elektrische Geräte	3,35
Immobilien	3,63
Gesundheitswesen	3,78
Halbleiter	4,71
Software	4,77
Versicherungen	5,18
Gewerbliche Dienstleistungen	5,33
Telekommunikation	5,36
Arzneimittel	6,14
Staatliche Emittenten	15,91
Finanzdienstleistungen	19,86
Anlagen insgesamt	98,78
Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,22
Gesamtes Nettovermögen	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity

#### Performance

In den zwölf Monaten zum 30. September 2023 erbrachten die Anteile der Klasse A EUR eine Rendite von 15,5 %. Im Vergleich dazu erbrachte die Benchmark eine Rendite von 19,2 %. Die Performance versteht sich nach Abzug der Gebühren, in Euro ausgedrückt. Die Benchmark für dieses Portfolio wechselte am 14.10.2019 vom FTSE All-World Developed Europe NR zum MSCI Europe NR.

Das Portfolio blieb hinter der sehr starken Erholung der europäischen Aktienmärkte im Berichtszeitraum zurück. Der größte Verlustbringer war National Express Group, wo trotz eines starken Umsatzwachstums die anhaltenden Sorgen über die Kosteninflation zu einer Underperformance führten. Alfen Beheer blieb hinter den Erwartungen zurück, da die schwachen Preise für das Laden von Elektrofahrzeugen zu schlechten Ergebnissen führten. Auch Lenzing, ein Hersteller von nachhaltiger Viskose, verzeichnete eine sehr schwache Performance. Trotz des Abschlusses der ehrgeizigen Investitionspläne liegen die Gewinne immer noch weit unter den Prognosen zu Beginn der Projekte, und das Unternehmen sah sich gezwungen, eine Bezugsrechtsemission zur Stärkung der Bilanz durchzuführen und eine Gewinnwarnung herauszugeben.

#### Marktrückblick

Die europäischen Aktienmärkte legten im Berichtszeitraum kräftig zu. Die Aktienmärkte starteten im Allgemeinen von einem Tiefpunkt aus, als hohe Inflation, steigende Zinsen und Rezessionsängste die Märkte im Herbst 2022 beherrschten, und erholten sich dann während des größten Teils des Berichtszeitraums. Die europäischen Aktien wiesen über den Winter eine Outperformance auf, da die Wirtschaft eine Rezession weitgehend vermieden hat. Anfang 2023 wurde der Markt jedoch von fallenden Bankaktien getroffen, die aus dem Zusammenbruch zweier US-Regionalbanken und der Rettung der Credit Suisse resultierten und zur Unsicherheit bezüglich der Ausrichtung der Geldpolitik beitrugen. Obwohl das Ausbleiben einer Ansteckung durch die Finanzkrise begrüßt wurde, erhöhte die Europäische Zentralbank (EZB) die Zinsen weiter, sogar als die Wirtschaft mit einer schwachen chinesischen Importnachfrage und einer gedämpften inländischen Verbraucherbasis zu kämpfen hatte. Gegen Ende des Berichtszeitraums wurde den risikoscheuen Anlegern klar, dass die weltweiten Zinssätze wahrscheinlich noch länger höher bleiben würden, was zu dem wirtschaftlichen Pessimismus einer breiteren regionalen Konjunkturabschwächung hinzukam und die Aktien belastete. Da die Energiepreise in Europa nachgaben, sank die Inflation in der Eurozone nach vorläufigen Schätzungen im September 2023 auf 4,3 % und damit auf den niedrigsten Stand seit Oktober 2021. Unterdessen kühlte sich die Kerninflation von 5,5 % im Juli auf 5,3 % ab. Innerhalb von zwölf Monaten hob die EZB die Zinssätze acht Mal an, mit einer großen Anhebungen im Dezember, Februar, März, Mai, Juni, Juli und September 2023, wodurch der Einlagensatz auf 4,00 % stieg. Darüber hinaus begann im März die quantitative Straffung.

#### Ausblick

Zu Beginn des letzten Quartals des Jahres wird die Richtung der europäischen Aktienmärkte weiterhin von der Inflation und den Aussichten auf einen möglichen Höchststand der Zinssätze und die damit verbundenen Auswirkungen auf die Wirtschaft bestimmt. Zwar gibt es Anzeichen für eine Verlangsamung der Konjunktur, da die Einkaufsmanagerindizes deutlich schwächer ausfielen, insbesondere im Vereinigten Königreich und in Europa, doch bleibt die Inflation hartnäckig hoch, auch wenn sie einige Anzeichen einer Abschwächung aufweist. Die Kommentare der Zentralbanken deuten darauf hin, dass wir den Höhepunkt der Zinssätze erreicht haben, dass diese aber noch einige Zeit hoch bleiben werden. Wir sind der Ansicht, dass das Portfolio weiterhin gut positioniert ist, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige Unternehmen zu attraktiven Bewertungen konzentrieren, die trotz des wirtschaftlichen Umfelds eine gute Performance erzielen können.

#### David Moss

Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDER WERTPAPIERE	EN GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGBAR	E	
ANTEILE			
Österreich			
Lenzing AG	6.997	271.834	1,98
Dänemark			
Novo Nordisk AS 'B'	9.514	821.520	5,99
Vestas Wind Systems AS	13.806	280.601	2,05
Frankreich		1.102.121	8,04
Air Liquide SA	3.125	499.500	3,64
Cie de Saint-Gobain	7.169	407.773	2,98
Schneider Electric SE	3.583	562.459	4,10
Deutschland		1.469.732	10,72
Brenntag SE	5.033	369.825	2,70
Deutsche Boerse AG	3.009	492.573	3,59
Infineon Technologies AG	8.718	273.353	1,99
SAP SE	5.003	614.469	4,48
Symrise AG	2.223	200.781	1,46
Irland		1.951.001	14,22
Cairn Homes PLC	372.812	410.016	2,99
Kerry Group PLC	5.329	421.950	3,08
Smurfit Kappa Group PLC	12.429	392.259	2,86
Italien		1.224.225	8,93
Intesa Sanpaolo SpA	171.107	417.501	3,04
Niederlande			
Alfen Beheer BV	2.206	88.571	0,65
ASML Holding NV	1.185	662.534	4,83
Wolters Kluwer NV	3.542	406.090	2,96
Norwegen		1.157.195	8,44
DNB Bank ASA	23.245	444.845	3,24
MOWI ASA	9.574	161.082	1,17
Storebrand ASA	46.932	363.092	2,65
Schweden		969.019	7,06
Atlas Copco AB 'A'	17.303	221.506	1,61
Schweiz			
DSM-Firmenich AG	1.794	143.753	1,05
Lonza Group AG	658	289.140	2,11
Partners Group Holding AG Roche Holding AG	359 1.892	383.447 489.241	2,79 3,57
UBS Group AG	17.954	420.606	3,07
		1.726.187	12,59
Vereinigtes Königreich AstraZeneca PLC	5.005	640.571	4,67
GSK PLC	13.675	235.211	4,07
Legal & General Group PLC	166.334	426.651	3,11
National Express Group PLC	150.682	154.254	1,12
Pearson PLC	23.849	238.755	1,74
Prudential PLC	35.065	359.286	2,62

### Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in EUR	% des Nettover- mögens
RELX PLC	13.575	435.079	3,17
SSE PLC	22.807	423.307	3,09
		2.913.114	21,24
AKTIEN GESAMT		13.423.435	97,87
SUMME DER ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENEN ODER AN EINEM GEREGELTEN MARKT NO ÜBERTRAGBAREN WERTPAPIERE	DTIERTEN	13.423.435	97,87
ANLAGEN INSGESAMT		13.423.435	97,87
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		292.252	2,13
GESAMTES NETTOVERMÖGEN	_	13.715.687	100,00

## Columbia Threadneedle (Lux) III - CT (Lux) Sustainable Opportunities **European Equity** Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Nettovermögens
Transport und Verkehr	1.12
Maschinenbau	1,12
Energie	2,05
Gesundheitswesen	2,03
Forstprodukte und Papier	2,11
Baustoffe	2,80
Wohnungsbauunternehmen	2,98
Elektrische Geräte	2,99 3.09
Gewerbliche Dienstleistungen	3,09
Elektrische Komponenten und Zubehör	4.10
Nahrungsmittel und Getränke	4,10
Software	4,23
Medien	4,40
Halbleiter	6.82
Versicherungen	8.38
Chemikalien	10,83
Finanzdienstleistungen	15,73
Arzneimittel	15,75
	10,80
Anlagen insgesamt	97,87
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)	2,13
Nettovermögen insgesamt	100,00

### Columbia Threadneedle (Lux) III CT (Lux) US Smaller Companies

#### Performance

In den sechs Monaten zum 30. September 2023 erbrachte der CT (Lux) US Smaller Companies Fund eine Rendite von 15,3 %. Im Vergleich dazu erzielte die Benchmark (der Russell 2000 Index) eine Rendite von -0,8 %. Die Renditen sind nach Abzug von Gebühren, in Pfund Sterling und auf Total-Return-Basis angegeben. US-Small-Cap-Aktien, gemessen am Russell 2000 Index in US-Dollar, erzielten im Berichtszeitraum eine Rendite von 8,93 %. Wachstumswerte schnitten im Jahresverlauf besser ab als Substanzwerte, mit einem Anstieg des Russell 2000 Value Index um 7,84 % gegenüber einer Rendite von 9,59 % für den Russell 2000 Growth Index. Sieben der elf Global Industry Classification Standard-Sektoren innerhalb des Russell 2000 verzeichneten im Berichtszeitraum positive Renditen, allen voran der Energiesektor mit einer Rendite von 39,12 %, während das Gesundheitswesen mit einer Rendite von -13,43 % im Berichtszeitraum den größten Nachzügler darstellte. Der US Smaller Companies Fund übertraf den Russell 2000 Index für den Einjahreszeitraum zum 30. September 2023. Unser Prozess erwies sich im Berichtszeitraum im gesamten Small-Cap-Universum als vorteilhaft, da wir von iedem der fundamentaldatenbasierten, bewertungsbezogenen und anlegerorientierten Themen unseres Modells profitierten. Der Großteil der Outperformance im Berichtszeitraum war auf die Titelauswahl zurückzuführen, aber auch die Sektorallokation leistete einen positiven Beitrag. Die Übergewichtung des Portfolios im Bereich Informationstechnologie und die Untergewichtung von Versorgern trugen am stärksten zur relativen Performance bei, während eine leichte Untergewichtung von Finanzwerten und eine Übergewichtung des Gesundheitswesens die relative Performance schmälerten. Am stärksten war die Titelauswahl bei den Finanzwerten und den Industriewerten, während sie in den Sektoren Versorger und Basiskonsumgüter am abträglichsten war. Zu den wichtigsten Beitragsleistern auf Einzeltitelebene zählten im Berichtszeitraum Duolingo, Inc. Class A und Helix Energy Solutions, während Axogen und CareDx zu den größten Verlustbringern gehörten.

#### Marktrückblick

Volatilität, geopolitische Spannungen und die Befürchtung einer weltweiten Konjunkturabschwächung aufgrund der Straffung der Geldpolitik durch die Zentralbanken dämpften die Renditen an den Aktienmärkten, auch wenn diese nach einem schwierigen Kalenderjahr 2022 insgesamt höher ausfielen. Die auf höherem Beta und höherem Risiko basierende Rallye, die zu Beginn des Kalenderjahres 2023 vor allem in Bezug auf US-amerikanische Large-Cap-Unternehmen einsetzte, wirkte sich auch auf USamerikanische Small Caps aus, da die Bewertungsunterschiede zwischen Small und Large Caps weiterhin extrem hoch sind. So sehr, dass die US-amerikanischen Small Caps unserer Meinung nach bereits eine Rezession einpreisen. Die US-Notenbank hat seither ihre Wachsamkeit im Hinblick auf eine Straffung der Geldpolitik beibehalten, da die Inflationsdaten trotz der Abkühlung im Laufe des Jahres weiterhin deutlich über dem Zielwert von 2 % liegen und die Beschäftigungslage weiterhin solide ist. Wie weit wird die Straffung der Fed im laufenden Zyklus gehen? Der Fed-Vorsitzende Powell und andere Mitglieder des FOMC erinnern sich daran, wie der Fed-Vorsitzende Volcker Anfang der 1980er Jahre bei der Straffung den Fuß zu früh vom Pedal nahm und dann den Kurs erneut ändern musste, als sich die Inflation wieder beschleunigte, und der Ausschuss scheint entschlossen, diesen Fehler nicht zu wiederholen. Bei den Fed Funds Futures Ende liegt aktuell, Ende September 2023, die Wahrscheinlichkeit einer weiteren Straffung derzeit jedoch unter 50/50, was einen Endsatz des Leitzinses von etwa 5,4 % impliziert. Darüber hinaus nehmen die Fed Funds Futures eine Senkung des Leitzinses um insgesamt etwa 75 Basispunkte im Jahr 2024 vorweg. Vorerst benötigt die Fed wohl weitere Anhaltspunkte für eine Verlangsamung der Inflation, bevor sie sich entschließt, die Pause-Taste zu drücken oder zu Zinssenkungen überzugehen, was darauf hindeutet, dass "länger höher" der wahrscheinlichste Weg ist. Viel wird von den Arbeitsmarktprognosen abhängen, die bisher darauf hindeuten, dass die Futures-Händler möglicherweise zu optimistisch sind, wenn sie einen Lockerungszyklus im Jahr 2024 ausrufen, da das Lohnwachstum weiterhin hoch ist.

#### Ausblick

Zwar hat sich die Stimmung der Anleger verbessert, da die Wahrscheinlichkeit einer Rezession im Jahr 2023 offenbar gesunken ist, doch besteht weiterhin die Gefahr einer Konjunkturabschwächung im Jahr 2024. In diesem Umfeld müssen wir zu Beginn des neuen Geschäftsjahres an unserer Bewertungsdisziplin festhalten und das Portfolio weiterhin auf Qualität ausrichten, da jene Unternehmen, die ihr Wachstum am besten aus eigener Kraft finanzieren können, sich wahrscheinlich besser entwickeln werden. Die Marktbreite, die zu Beginn des Jahres sehr gering war, verbesserte sich im Laufe des Jahres auf ein neutraleres Niveau, und jede weitere Verbesserung könnte sich insbesondere für Small-Cap-Aktien positiv auswirken. Mit Blick auf die Zukunft, in der die Zinssätze wahrscheinlich fest im positiven Bereich bleiben werden, werden Fundamentaldaten wie Erträge und Cashflow (und nicht die Liquidität, die durch billiges Geld bereitgestellt wird) die wahrscheinlicheren Renditetreiber sein, so dass unser Prozess weiterhin günstig sein sollte.

#### Portfoliomanager

Hinweis: Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Alle angegebenen Performancedaten entsprechen den Gesamtrenditen. Im vorliegenden Bericht enthaltene Aussagen, die sich auf die zukünftige Wertentwicklung beziehen, spiegeln die Meinungen des Managements wider und es wird nicht garantiert, dass sich diese Meinungen als richtig erweisen.

## Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) US Smaller Companies Anlagenaufstellung zum 30. September 2023

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN O WERTPAPIERE	GEREGELTEN MARKT NOTIERTE ÜBERTRAGE	BARE	
ANTEILE			
Bermuda Golar LNG Ltd.	2.798	67.879	0,48
Irland Alkermes PLC	3.387	94.870	0,67
Luxemburg Orion SA	4.090	87.035	0,62
Puerto Rico			
EVERTEC, Inc.	2.337	86.890	0,61
First BanCorp	4.690	63.127	0,45
Thailand		150.017	1,06
Fabrinet	796	132.630	0,94
Vereinigtes Königreich LivaNova PLC	1.724	91.165	0,64
USA			
A10 Networks, Inc. ACADIA Pharmaceuticals, Inc.	6.646 3.325	99.889 69.293	0,71 0,49
Alkami Technology, Inc.	3.739	68.125	0,49
A-Mark Precious Metals, Inc.	2.648	77.666	0,55
Amicus Therapeutics, Inc.	6.914	84.074	0,59
Amkor Technology, Inc. Anika Therapeutics, Inc.	4.895 2.992	110.627 55.741	0,78 0,39
Apogee Enterprises, Inc.	1.627	76.599	0,54
Apple Hospitality REIT, Inc.	7.003	107.426	0,76
ArcBest Corp.	1.152	117.101	0,83
ARS Pharmaceuticals, Inc. ASGN, Inc.	11.164 929	42.200 75.881	0,30 0,54
Astec Industries	1.771	83.432	0,54
Astronics Corp.	3.724	59.063	0,42
Atkore, Inc.	821	122.485	0,87
Avanos Medical, Inc. Axogen, Inc.	3.036 9.534	61.388 47.670	0,43 0,34
Axos Financial, Inc.	2.353	89.085	0,34
Bancorp, Inc.	2.346	80.937	0,57
Banner Corp.	1.279	54.204	0,38
Belden, Inc.	985 4.121	95.102	0,67
Bloomin' Brands, Inc. Brady Corp. 'A'	4.121	101.335 92.101	0,72 0,65
Cabot Corp.	1.361	94.276	0,67
California Resources Corp.	1.850	103.618	0,73
Calix, Inc.	2.136	97.914	0,69
CareDx, Inc. Central Pacific Financial Corp.	9.129 4.079	63.903 68.038	0,45 0,48
ChampionX Corp.	2.792	99.451	0,70
Chico's FAS, Inc.	17.183	128.529	0,91
Clearway Energy, Inc. Commercial Metals Co.	4.055	85.804	0,61
Community Healthcare Trust, Inc.	2.606 2.768	128.762 82.210	0,91 0,58
Community Trust Bancorp, Inc.	1.695	58.071	0,41
CommVault Systems, Inc.	2.010	135.896	0,96
Computer Programs & Systems, Inc.	2.380	37.937	0,27
Crocs, Inc. DiamondRock Hospitality Co.	951 10.518	83.907 84.460	0,59 0,60
Dime Community Bancshares, Inc.	5.114	102.075	0,72
Diodes, Inc.	832	65.595	0,46
Duolingo, Inc.	825 3.017	136.843	0,97
DXP Enterprises, Inc. Eagle Pharmaceuticals, Inc.	3.917 3.138	136.860 49.486	0,97 0,35
Employers Holdings, Inc.	2.371	94.721	0,67
EngageSmart, Inc.	4.829	86.874	0,61
Entravision Communications Corp. 'A'	13.976	51.012	0,36
Essent Group Ltd. Everbridge, Inc.	2.531 3.179	119.691 71.273	0,85 0,50
Evercore, Inc.	604	83.280	0,59
Everi Holdings, Inc.	5.813	76.848	0,54
Evolent Health, Inc. 'A'	2.682	73.031	0,52
ExlService Holdings, Inc.	2.650	74.306	0,53

## Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) US Smaller Companies Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Fiel Fiend Coord         1.708         57.808         0.00           Golds Entrainment, Br.         1.301         16.808         0.00           Golds Entrainment, Br.         1.301         16.808         0.00           Golds Entrainment, Br.         1.301         15.748         1.11           Goldsend Figuration, Br.         1.301         15.748         1.11           Gold Dynamics Holding, Br.         1.301         119.410         0.00           Halloyme Co., Br.         2.744         118.87         0.00           Halloyme Co., Br.         2.400         71.921         0.00           Halloyme Co., Br.         1.301         11.810         0.00           Halloyme Co., Br.         1.301         11.810         0.00           Head Financia Co., Br.         1.301         11.810         0.00           Head Financia Co.         1.301         11.810         0.00           Head Financia Co. </th <th>Wertpapierbezeichnung</th> <th>Stück/ Nennwert</th> <th>Marktwert in USD</th> <th>% des Nettover- mögens</th>	Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
Gloralla relaxation, Inc.         1.663         1.663         6.6655           Goode Benerinariane, Inc.         1.613         1.752.268         0.606           Goode Benerinariane, Inc.         1.53         1.710         0.606           Hamonolos Corp.         1.53         1.710         0.606           Hamonolos Corp.         2.408         7.723         0.606           Hamonolos Corp.         2.408         7.7257         0.706           Hamonolos Corp.         2.408         7.626.203         0.60           Hamonolos Corp.         2.408         7.626.203         0.60           Hamonolos Corp.         2.408         7.62.703         0.13         0.13.10         0.00           Hashaffaram, Inc.         1.407         7.72.876         0.00	First Commonwealth Financial Corp.	8.574	104.689	0,74
Golden Enversioners, Inc. N         1951         95.88         0.0           Grahm Heddings Co. B         138         75.482         0.0           Grahm Heddings Co. B         138         75.482         0.0           Haborers Fundings Co. B         27.44         11.69.00         0.0           Haborers Fundings Con. Inc.         27.44         11.69.00         0.0           Haborers Fundings Con. Inc.         27.44         11.69.00         0.0           HG Graug, Inc.         13.40         16.30.00         0.0           HG Graug, Inc.         15.47         17.19.1         0.0           Hote Serie Graug, Inc.         15.47         17.19.1         0.0           Hote Serie Graug, Inc.         15.47         17.19.1         0.0           Hote Serie Graug, Inc.         15.47         17.19.1         0.0           Hote Graug, Inc.         12.86         0.0         1.19.00         0.0           Hote Graug, Inc.         12.86         0.0         1.19.00         0.0         0.0           Hote Graug, Inc.         12.87         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0	First Financial Corp.	1.706	57.680	0,41
Gooshmat Houmon, Inc. <sup>1</sup> . <sup>1</sup>	Gibraltar Industries, Inc.	1.663	112.269	0,79
Ghalam Shdings Co. B         138         79.88         0.00           Heenonalis Corp.         1.33         11.40         0.00           Heenonalis Corp.         1.34         11.40         0.00           Heenonalis Corp.         1.34         11.40         0.00           HG Gravp. Inc.         1.24         10.42         0.00           HG Gravp. Inc.         1.24         0.00         0.00           Heathad Financia USA. Inc.         1.37         1.72.878         0.00           Heathad Financia USA. Inc.         1.40         1.10         10.10         0.00           Heathad Financia USA. Inc.         1.26         0.01         0.00 <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,47</td>				0,47
Grid Dymain         6.214         T.587         0.0           Heacymei         1.33         119.400         0.0           Heacymei         2.474         10.421         0.0           Heacymei         1.342         11.201         0.0           Headymein         1.342         11.201         0.0           Headymein         1.342         11.201         0.0           Heading Francin Calles         1.342         11.201         0.0           Heading Francin Calles         1.207         11.213         11.831         0.0           Heading Francin Calles         1.201         11.813         0.0				1,11
Henromits Com.         1.33         1.10         0.0           Hensorp Tenquesties, Inc.         2.48         7.12         0.0           Hensorp Tenquesties, Inc.         2.48         7.12         0.0           Head Parlues Cox, Inc.         2.48         7.12         0.0           Head Stand, Inc.         6.30         11.53         10.80           Head Stand, Inc.         4.267         142.13         10.5           Holds Enging Stands, Inc.         1.63         10.80         6.4.13         0.0           Holds Enging Stands, Inc.         1.33         8.6.3.13         0.0	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			0,56
Habogm Threageurios, Inc.         2.744         91.48.21         0.0           Habogm Canality Cosp., Inc.         1.264         96.82.3         0.0           Hab Group, Inc.         1.264         115.30         0.0           Hab Group, Inc.         1.577         172.378         1.5           Hab Group, Shains Group, Inc.         1.577         172.378         1.5           Hab Group, Inc.         1.513         184.31         0.0           Hab Group, Inc.         1.513         184.31         0.0           Hab Group, Inc.         1.513         154.31         0.0           Inger Machang Systems, Inc.         1.528         60.30.80         0.0           Inger Machang Systems, Inc.         1.717         78.473         0.0           Hack Group         1.771         78.473         0.0           Hack Group         3.00         0.0         0.0           Hack Group         3.00         0.0         0.0         0.0           Hack Group         3.00         0.0         0.0         0.0         0.0           Hack Group         3.00         0.0         0.0         0.0         0.0         0.0           Hack Group         3.00         0.0				0,53
Hearder Functure Cos., Inc.         2.499         7.1921         0.00           Hearder Funcance USA, Inc.         3.342         71.5289         0.00           Hearder Funcance USA, Inc.         15.477         71.7281         1.1           Hearder Funcance USA, Inc.         11.88         80.313         1.0           Inder Sammer, Inc.         46.68         0.0186         0.0186         0.0186           Inspire Modical Systems, Inc.         11.89         86.60         0.018         0.0086         0.018         0.0086         0.01         0.018         0.0186         0.018 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td>0,84</td></t<>				0,84
HG Group, Inc.       1.244       1.542       115.200         Hearting Financial USA, Inc.       1.547       172.477       0.0         Hearting Financial USA, Inc.       1.547       172.477       0.0         Hearting Staturich, Inc.       4.557       172.477       0.0         Houses Staturich, Inc.       4.557       172.477       0.0         Ingerie Model System, Inc.       1.580       9.00.80       0.0         Ingerie Model System, Inc.       1.565       9.00.80       0.0         Inter Parkam, Enc.       1.477       78.378       0.0         Landing Corp.       3.481       0.0       0.0       0.0         Landing Thermosciella Corp.       3.497       0.0       0.0       0.0       0.0         Landing Corp.       3.497       0.0				0,74
Healing Financian USA, Inc.         5.420         5.427         715.287         6.0           Healizen Financian USA, Inc.         15.477         712.278         71           Healizen Financian USA, Inc.         15.477         712.278         71           Healizen Financia, Inc.         15.13         161.313         100           Inceis Stratican/Incolutor, Inc. //         15.13         161.313         100           Inceis Stratican/Incolutor, Inc. //         15.47         714.213.41         100           Inceis Antican/Incolutor, Inc. //         14.48         60.01         60.01           Inter Famma, Inc.         718         66.02         60.01           Inter Calular Thrappis, Inc.         17.77         78.37         60.00           Jahn Bean Technologies Corp.         81.61         98.61         00           Jahn Bean Technologies Corp.         81.61         98.61         00           Jahn Bean Technologies Corp.         340         60.03         98.61         00           Markon Technologies Corp.         341         98.61         00         00           Markon Technologies Corp.         340         60.03         00         00         00         00         00         00         00         00 </td <td>•</td> <td></td> <td></td> <td>0,51</td>	•			0,51
Heartand IVAS, Inc.         1.970         1.970         1.971         1.727         1.727           Heartang Financia, Inc.         4.967         1.727         1.727         1.727           Heartang Financia, Inc.         4.967         1.721         1.731         1.881         0.0           Inde Samura, Inc.         1.039         6.018         0.00				0,48
Heix Engry Solutions Group, Inc.         15.47         17.2479         12.14           Hebriss Bank, Inc.         16.37         14.247         14.247         14.247           Hebriss Bank, Inc.         16.38         63.131         63.131         63.131           Inder Group, Inc. Y.         13.38         63.131         63.131         63.131         63.131           Inder Grund, Inc. M.         436         63.131         63.1				0,81
Hotess Brands, Inc.         42.07         142.134         1.0.1           Hold Grang, Inc.         1.513         118.131         0.0.0           Indie Berinde, Kr.         1.38         6.3.131         0.0.0           Inegrin Moderal Systems, Inc.         4.38         6.3.131         0.0.0           Inegrin Moderal Systems, Inc.         4.38         6.3.131         0.0.0           Inegrin Moderal Systems, Inc.         4.367         4.368         0.0.16           Inerd Calluar Therapen, Inc.         4.467         47.418         0.0.2           Inerd Calluar Therapen, Inc.         7.409         0.0.2         0.0.2           Jackson Finandal, Inc. 'n         3.187         48.50         0.0.2           Leagarond Cany, Inc.         7.409         81.55         0.0.2           Leagarond Cany, Inc.         3.681         9.251.60         0.0.2           Leagaron Hodings, Inc.         3.697         0.0.2         0.0.2           Madriag Hommonautasts, Inc.         3.697         0.0.2         0.0.2           Madriag Hommonautasts, Inc.         3.697         0.0.2         0.0.2           Madriag Hommonautasts, Inc.         5.69         110.432         0.0.2           Madron Systems, Inc.         5.69				
He Group, Inc. 'A         15.13         18.831         0.6           Indeg Senicodization, Inc. 'A         13.86         0.6           Ingerie Medical Systems, Inc.         5.05         0.0116         0.0116           Integrie Medical Systems, Inc.         5.05         0.0116         0.0116           Inter Farture, Inc.         1.47         7.8416         0.02           Inter Science, Inc. 'A         1.47         7.8416         0.02           Inter Science, Inc. 'A         1.47         7.8416         0.02           John Bern Technologies Corp.         7.49         81.040         0.02           Londsgrop, Inc.         3.107         48.053         0.03           Londsgrop, Inc.         3.401         98.815         0.02           Londsgrop, Inc.         3.401         98.815         0.03           Marcian Parametolis, Inc.         3.401         98.815         0.03           Marciane Co., Inc.         3.401         98.815         0.03           Marciane Termonolis, Inc.         3.401         98.815         0.03           Marciane, Inc.         3.401         98.915         0.03           Marciane, Inc.         3.401         98.915         0.03           Marean Termonolis,				
inde Beniconductor, Inc. 'A'         10.160         64.134         0.4           Inspire Machical Systems, Inc.         458         60.865         0.05           Inspire Machical Systems, Inc.         718         60.855         0.05           Inter Parture, Inc.         718         66.455         0.05           Inter Caluar Therapise, Inc.         718         66.455         0.05           Inter Caluar Therapise, Inc.         718         66.456         0.05           Inter Caluar Therapise, Inc.         718         66.456         0.05           Adm Bar Technologies Corp.         266         0.40         0.05           Adm Systems, Inc.         10.67         78.07         0.05           Undergy Corp.         266         0.45         0.00           Mandrog Ten.         3.68         0.630         0.00           Mandrog Ten.         3.68         0.630         0.00           Mandrog Ten.         3.68         0.630         0.00           Mandrog Ten.         5.63         4.660         0.30           Mandrog Ten.         5.63         4.660         0.30           Mandrog Ten.         5.63         4.660         0.30           Mandrog Ten.         5.63				
ingen Macial Systems, Inc.         1.36         6.31.31         0.4           integra Macial Systems, Inc.         6.06         60.116         0.01           inter Parlums, Inc.         1.47         78.416         0.01           Inter Parlums, Inc.         1.477         78.516         0.01           Jackson Financial, Inc. X         1.771         78.516         0.01           Landrig Orgo, Inc.         3.66         94.503         0.02           Lindrig Orgo, Inc.         3.66         94.503         0.02           March Parlums, Inc.         3.66         94.503         0.02           March Financial, Inc. M         2.69         10.02         0.02           March Financial, Inc. M         2.60         10.02         0.02           March Financial, Inc. M         2.60         10.02         0.02           March Financial, Inc. M         1.68         42.60         0.02           March Financial, Inc. M         1.64         42.60         0.02				
input Macinal Systems, Inc.         458         9.0.86         0.0.116           Inter Parturs, Inc.         7.16         9.0.466         0.0.0           Inter Calular Therapies, Inc.         1.467         7.5.416         0.0.0           Radimed Cap.         1.727         0.6.00         0.0.0           Jackscon Financial, Inc.         1.727         0.6.00         0.0.0           Jackscon Financial, Inc.         7.400         0.1.00         0.0.00           Leading Time, Inc.         3.401         0.0.0         0.0.00           Leading Time, Inc.         3.401         0.0.0         0.0.0           Leading Time, Inc.         3.401         0.0.0         0.0.0           Leading Time, Inc.         3.401         0.0.0         0.0.0           Matching Transport Ld.         3.401         0.0.0         0.0.0           Matching Resources Co.         2.131         12.5.72         0.0           Matching Resources Co.         1.188         10.09         40.00           Matching Resources Co.         1.188         10.05         10.62         0.0           Matching Resources Co.         1.593         44.550         0.0         0.0           Matching Lisc.         1.594         67.055				
integr Parlams, Inc.         9.68         60.116         60.116           Intra Calluar, Therapias, Inc.         1.77         76.416         0.0           Intra Calluar, Therapias, Inc.         1.77         76.416         0.0           Jackson Financial, Inc. 'A         1.777         75.79         0.0           Jackson Financial, Inc. 'A         4.00         0.0         0.0           Legalexon corn, Inc.         7.40         81.054         0.0           Legalexon corn, Inc.         3.197         48.053         0.0           Lendary Corp.         80.6         9.45.0         0.0           Lendary Corp.         80.6         9.45.0         0.0           Mancing Toc. Inscitals, Inc.         3.41         98.815         0.0           Matching Inc.         3.44         98.450         0.0           Matching Inc.         5.600         10.53         0.0           Matching Inc.         1.53         10.0         11.0.43         0.0           Matching Inc.         3.44         10.0         11.0.43         0.0           Matching Inc.         3.44         10.00         10.04         10.04         10.04           Matching Inc.         3.00         0.00         10.				0,64
Inter Partum, Inc.         11.467         77.46         0.0           IRadimed Corp.         1.777         78.579         0.6           Jackson Financial, Inc.'         1.727         66.006         0.0           John Bean Technologies Corp.         28.5         86.740         0.6           Landson Financial, Inc.'         7.409         81.054         0.55           Londson Financial, Inc.'         3.00         94.850         0.6           Londson Financial, Inc.'         3.041         98.850         0.0           Londson Financial, Inc.'         3.461         98.851         0.0           Londson Financial, Inc.'         3.461         98.850         0.0           Marchancial, Inc.'         3.462         63.618         0.0           Marchancial, Inc.'         3.462         63.618         0.0           Marchancial, Inc.'         1.198         107.942         0.0           Marchancial, Inc.'         1.198         0.0         0.0           Marchancial, Inc.'         1.198         0.0         0.0           Marchancial, Inc.'         1.198         0.0         0.0           Marchancial, Inc.'         1.231         1.27.62         0.0           Marchansing and and a				0,42
inra-Caluar Therapas, Inc.         1.47         7.4.41         7.4.41           Insaknes Corp.         1.771         7.8.579         6.0           Johkson Financial, Inc. 'A'         4.00         6.00         6.00           Laplacton Corn, Inc.         7.40         81.054         0.00           Laplacton Corn, Inc.         3.197         48.05.3         0.00           Lenglary Corp.         0.00         9.4850         0.00           Landary Corp.         0.00         9.4850         0.00           Mathem Transport Lid.         3.441         9.09.815         0.00           Mathem Transport Lid.         5.00         0.00				0,42
Radmed Cop.         1.71         7.8.57         0.600           John Bean Technologies Corp.         82.5         8.7.40         0.60           Landarg Tree, Inc.         3.17         4.05.3         0.5.0           Landarg Corp.         8.06         0.60         0.60           Landarg Corp.         8.07.40         88.10.44         0.60           Landarg Corp.         8.06         0.60         0.60           Landarg Tree, Inc.         3.46         9.8.15         0.0           Marily Prove Co., Inc.         4.22         6.3.81         0.0           Match Transport Lid.         5.000         11.95.3         0.7           Mastor Risourcita, Inc.         1.5.03         48.650         0.3           Match Risource Co., Inc.         1.21.31         11.27.62         0.0           Match Risource Co.         1.3.10         11.4.22         0.0           Match Risource Co.         1.3.9         0.0         0.0           Match Risource Co.         1.				0,08
Jackson Francial, Inc. 'A'         96.006         0.25           John Bana Technologia Corp,         82.5         86.740         0.0           Lendang Teo, Inc.         31.97         49.553         0.0           Lendang Teo, Inc.         34.61         98.85         0.0           Machiga Pharmaceuticals, Inc.         34.61         99.815         0.0           Marian Transport Ld.         42.27         63.616         0.0           Marian Transport Ld.         15.63         107.949         0.0           Machine International Corp.         15.83         48.60         0.0           Machine International Corp.         16.00         107.75         0.7           Machine International Corp.         24.60         77.75         0.7         0.7           Marke Torp.         2.83         112.15         0.7         0.7         0.7         0.7         0.7         0.7         0.7				0,54
John Bean Technologies Corp.         863         86.740         0.6           LandgarDore, Inc.         7.409         81.044         0.6           Lindsay Corp.         806         94.800         0.0           Lindsay Corp.         3.64         99.815         0.0           Maribay Dec.         3.46         50.530         0.0           Maribay Dec.         5.609         110.553         0.0           Marchay Corp.         2.813         126.722         0.50           Marchay Corp.         2.813         126.722         0.0           Marchay International Corp.         2.131         126.722         0.0           Marchay, Inc.         3.042         67.644         0.0           Marchay, Inc.         3.042         67.644         0.0           Marchay, Inc.         3.042         77.36         0.0           Marchay, Inc.         10.049         107.725         0.0           Marchay, Inc.         10.049         107.725         0.0           Marchay, Inc.         10.049         107.25         0.0           Marchay, Inc.         10.049         107.25         0.0           Null Noticing, Inc.         10.049         107.25         0.0 </td <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,30</td>				0,30
Laglatom.com. Inc.         7,499         81.054         0.05           Landary Ten, Inc.         31.97         49.553         0.05           Landary Corp.         80.61         94.850         0.05           Madrigal Pharmaceuticals, Inc.         34.61         99.815         0.07           Martowor Co., Inc.         42.27         63.616         0.05           Martoson Transport Ltd.         15.69         110.553         0.07           Martoson Transport Ltd.         15.63         48.60         0.05           Martoson Transport Ltd.         15.63         48.60         0.07           Martoson Transport Ltd.         15.93         48.60         0.03           Martoson Transport Ltd.         15.93         48.60         0.03           Martoson Transport Ltd.         15.93         48.60         0.03           Martoson Transport Ltd.         16.00         110.432         0.07           Martoson Transport Ltd.         16.00         10.02         0.02				0,47
Landary Corp.         3.97         49.53         0.0           Linekay Corp.         3.86         99.85         0.0           Marigue Pharameuticats, Inc.         3.46         50.53         0.3           Marian Pharameuticats, Inc.         5.69         110.553         0.0           Macore Co., Inc.         4.207         65.61         0.00           Macore Transport Lid.         5.69         110.553         46.60         0.00           Macore, Inc.         3.042         67.644         0.0           Macore, Inc.         9.00         10.049         107.25         0.0           Macore, Inc.         10.049         107.25         0.0         0.0           Macore, Inc.         10.049         107.25         0.0         0.0           Nume Products, Inc.         10.049         107.25         0.0         0.0           Nume Products, Inc.         10.049         107.25         0.0         0.	5			0,57
Lindsag' Corp.         906         94.800         0.6           Lindsag' Corp.         346         99.810         0.7           Madrigo Pharmacoulicias, Inc.         427         63.616         0.4           Marinovo Co., Inc.         4.227         63.616         0.4           Marinovo Co., Inc.         4.227         63.616         0.4           Masonine International Corp.         1.158         107.940         0.7           Masonine International Corp.         1.583         48.650         0.03           Maxium Pharmacoulicias, Inc.         3.042         67.684         0.04           Marking, Inc.         3.042         67.684         0.04           Mitter Medical Systems, Inc.         1.004         110.725         0.0           Mitter Marcina Contractoculticas, Inc.         2.80         77.65         0.0           Mitter Marcina Contractoculticas, Inc.         887         133.008         0.0           Natural Concers by Vilemin Cottage, Inc.         5.194         67.055         0.0           Number Water Products, Inc.         5.194         67.055         0.0           Not Wess, Inc.         2.839         112.152         0.0           Not Wess, Inc.         1.66         52.65 <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td>0,35</td></td<>				0,35
LiveRamp Holdings, Inc.         3.461         99.815         0.70           Maringto Parametricals, Inc.         4227         63.616         0.00           Maren Transport Id.         5.609         110.553         0.07           Masching International Corp.         1.158         107.949         0.07           Masching, Inc.         1.553         46.650         0.03           Matching, Inc.         1.600         110.32         0.07           Ment Medical Systems, Inc.         1.600         110.32         0.07           Ment Medical Systems, Inc.         1.600         110.725         0.03           Minur Pharmacoucitals, Inc.         2.400         10.77         0.05         0.07           Mine Kystems, Inc.         8.082         102.440         0.07         0.07           Mine Kystems, Inc.         8.082         102.440         0.07         0.07           Mine Kystems, Inc.         10.048         10.77.25         0.07         0.07           Mine Kystems, Inc.         10.049         10.72.5         0.07         0.07           Mine Kystems, Inc.         1.040         10.249         10.29         0.07           Mine Kystems, Inc.         1.040         10.249         12.50         <	<b>0</b>			0,67
Madrig Pharmaceuticals, Inc.         426         60.530         6.5           Maritowo Co, Inc.         42.27         63.616         6.0.0           Martowo Co, Inc.         5.609         110.553         6.0.7           Masonite International Corp.         115.68         107.49         0.7.7           Matadr Resources Co.         2.131         126.752         0.0.9           Maxing, Inc.         3.042         67.684         0.0.4           Merri Medical Systems, Inc.         1.600         110.432         0.0.7           Mure Maranaceuticals, Inc.         2.60         77.65         0.6.5           Mure Maranaceuticals, Inc.         2.60         77.75         0.6.5           Mure Maranaceuticals, Inc.         10.049         107.725         0.0.7           Mure Maranaceuticals, Inc.         8.087         10.308         0.05           Mure Maranaceuticals, Inc.         5.194         67.055         0.0           MW Holdings, Inc.         4.544         123.00         0.05           Natural Holding Co.         2.839         112.152         0.0           NUP Locings, Inc.         4.54         123.00         0.05           NUP Locings, Inc.         4.54         123.00         0.05     <				0,71
Mani Transport Lid.         6.227         6.3.616         0.4.           Maren Transport Lid.         1.689         11.68         107.849         0.7.           Maschine International Corp.         1.168         107.849         0.0.         0.0				0,36
Marten Transport Ltd.         6.609         110.853         017.049         0.0           Masonic International Corp.         2.131         126.752         0.0         0.0           MaxiCrite, Inc.         3.042         67.684         0.0 <td< td=""><td></td><td></td><td></td><td>0,45</td></td<>				0,45
Masonic International Corp.         1.18         107 749         0.0           Matador Resources Co.         2.13         126 752         0.0           Max Lore Resources Co.         3.042         67.684         0.0           Max Lore Resources Co.         3.042         67.684         0.0           Ment Medical Systems, Inc.         783         97.055         0.0           Minur Pharmaceuticals, Inc.         10.049         107.725         0.7           Muler Systems, Inc.         10.049         107.725         0.7           Muler Systems, Inc.         10.049         107.725         0.7           Muler Systems, Inc.         987         133.008         0.0           Nortwest Natural Holding Co.         987         133.008         0.0           Nortwest Natural Holding Co.         2.939         12.152         0.0           Nortwest Natural Holding Co.         2.939         12.152         0.0           Nortwest Natural Holding Co.         10.88         19.202         12.65				0,78
Matadyre, Inc.       2131       127.722       0.0         MaxCyre, Inc.       3.042       67.684       0.0         Merit Medical Systems, Inc.       1.000       110.432       0.0         Mirum Pharmaceuticals, Inc.       2.460       77.736       0.0         Mirum Pharmaceuticals, Inc.       2.460       77.736       0.0         Mirum Pharmaceuticals, Inc.       3.042       0.043       0.07.25         Mueler Water Products, Inc. 'A'       8.082       102.480       0.0         NrW Group, Inc.       9.907       133.006       0.0         Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.       5.26       71.285       0.0         Nutri Mercoart, Inc.       4.544       123.007       0.00         Northwest Natural Holding Co.       2.939       112.152       0.7         NOW, Inc.       10.86       138.487       0.00         Northwest Natural Holding Co.       1.086       138.487       0.00         Option Care Hautin Holding Co.       2.824       91.356       0.0         Option Care Hautin Holding Co.       1.086       138.487       0.0         Option Care Hautin Holding Co.       2.824       91.356       0.0         Option Care Hauting Natural Holding Co.       <				0,76
MaxCipre, Inc.         15.53         46.850         0.5           MaxLinear, Inc.         3.042         67.884         0.0           Merit Medical Systems, Inc.         16.00         110.432         0.0           Mirer Mamaceulicals, Inc.         793         97.055         0.6           Mirer Norducts, Inc.         10.049         107.726         0.7           Mirer Norducts, Inc.         38.02         102.480         0.7           Mirer Norducts, Inc.         38.07         133.008         0.0           MaxLinear, Inc.         38.07         133.008         0.0           Natural Fooducts, Inc.         5.526         71.285         0.0           Natural Fooduts, Inc.         4.544         123.097         0.0           Northwest Natural Holding Co.         2.939         112.152         0.0           NOW, Inc.         10.88         129.300         0.9           NVE Corp.         744         61.112         0.0           Ornicall, Inc.         1.88         58.652         0.3           Option Care Health, Inc.         1.88         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         1.88         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.				0,90
MaxLines, Inc.         3.042         67.684         0.4           Merit Medical Systems, Inc.         1.600         110.432         0.7           Mirti Medical Systems, Inc.         2.460         77.758         0.5           Mirte Systems, Inc.         10.049         107.725         0.7           Mule Water Products, Inc. 'A'         8.082         102.480         0.7           Mire Group, Inc.         8.082         102.480         0.7           Natural Grocers by Vitamir Cottage, Inc.         5.56         71.285         0.5           Natural Grocers by Vitamir Cottage, Inc.         5.56         71.285         0.5           Northwest Natural Holding, Inc. 'A'         4.54         123.097         0.60           Northwest Natural Holding, Inc. 'A'         6.70.55         0.40           NOW, Inc.         10.883         129.300         0.50           Northwest Natural Holding, Inc.         10.86         138.487         0.50           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.50           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.50           Patheret Maxer Moding, Inc.         2.037         1162.05         0.70           Porak Hotel & Resorts, Inc.         2.037				0,34
Meri Audral Systems, Inc.         10.402         7.7           Meritage Homes Corp.         7.93         97.055         0.0           Mitek Systems, Inc.         10.049         107.725         0.7           Mitek Systems, Inc.         8.062         102.460         0.7           MVR Group, Inc.         9.07         133.008         0.02           Nable, Inc.         6.525         7.128         0.55           Natural Groops by Vitamin Cottage, Inc.         5.144         67.055         0.0           Null Holdings, Inc. 'A'         6.194         67.055         0.0           Null Holdings, Inc. 'A'         10.803         129.300         0.0           NVE Corp.         744         61.112         0.0           NVE Corp.         744         61.12         0.0           Onnicell, Inc.         1.166         138.487         0.05           Option Care Heath, Inc.         2.024         19.358         0.6           Owens & Minor, Inc.         2.033         105.25         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.024         19.358         0.6           Ovens & Minor, Inc.         2.037         152.05         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         4.16<				0,48
Meriage Homes Corp.         793         97.055         0.6           Mirum Pharmaceuticals, Inc.         10.049         107.725         0.7           Mueller Watter Products, Inc. A'         8.062         102.480         0.7           Nr G Group, Inc.         987         133.008         0.5           Natural Groors by Vitamin Cottage, Inc.         5.526         71.285         0.40           Nutral Groors by Vitamin Cottage, Inc.         5.54         122.307         0.60           Northwest Natural Holding Co.         2.539         112.152         0.7           NOW, Inc.         10.893         122.3007         0.60           NOW Corp.         744         61.112         0.4           Oceaneering International, Inc.         1.169         52.652         0.3           Option Care Health, Inc.         1.169         52.652         0.5           Option Care Health, Inc.         2.843         19.356         0.5           Option Care Health, Inc.         1.966         138.467         0.5           Option Care Health, Inc.         2.812         19.85         0.5           Park Core S.W.         3.812         13.85         0.5           Park Dets A Resorts, Inc.         1.161         4.524				0,78
Mirun Pharmaceuticals, Inc.         2,460         77.736         6,5           Mitek Systems, Inc.         10.049         107.735         6,7           Mitek Systems, Inc.         8,082         102.480         0,7           MrR Group, Inc.         9,87         133.008         0.02           Nable, Inc.         5,526         77.126         0,5           Natural Groops by Vitamin Cottage, Inc.         16,144         67.055         0,4           NMI Holdings, Inc. 'A'         4,544         122.007         0,60           Northwest Natural Holding Co.         2,939         112.152         0,7           NOW, Inc.         744         61.112         0,4           Oceaneering International, Inc.         744         61.112         0,4           Oramicell, Inc.         11.066         138.487         0,00           Option Care Heath, Inc.         2,824         91.356         0,6           Option Care Heath, Inc.         4,874         15.205         0,7 <t< td=""><td></td><td></td><td></td><td>0,69</td></t<>				0,69
Mitek Systems, Inc.         10.049         107.725         0.77           Mueller Water Products, Inc. 'A'         8.082         102.480         0.77           Mueller Water Products, Inc. 'A'         9.07         13.008         0.02           Natural Crocers by Vitamin Cottage, Inc.         5.126         71.285         0.64           NMI Holdings, Inc. 'A'         4.544         123.097         0.60           Northwest Natural Holding Co.         2.939         112.12         0.70           NOW, Inc.         10.893         129.300         0.92           NVE Corp.         744         61.112         0.40           Oceaneering International, Inc.         4.246         19.297         0.70           Onto Innovation, Inc.         1.069         13.487         0.92           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.92           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.25         0.70           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.25         0.70           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.327         124.562         0.80           Perdooce Education Corp.         4.846         78.925         0.90           Parit Hotels & Resorts, Inc.         1.216         <		2.460		0,55
Muellar Vatar Products, Inc. 'A'         8.082         102.480         0.7           MYR Group, Inc.         987         133.008         0.3           Nable, Inc.         5.56         71.285         0.4           Null Holdings, Inc. 'A'         67.055         0.4           Null Holdings, Inc. 'A'         112.82         0.7           NVR Corp.         2.939         112.152         0.7           NVR, Inc.         10.893         129.300         0.3           NVE Corp.         744         61.112         0.4           Onnicell, Inc.         11.69         52.652         0.3           Onto Innovation, Inc.         1.086         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         1.086         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         2.024         91.356         0.6           Path Holds R Reorts, Inc.         2.037         105.205         0.7           Path Holds R Reorts, Inc.         2.037         105.205         0.7           Path Holds R Reorts, Inc.         2.327         124.564         0.8           Path Holds R Reorts, Inc.         6.17         9.85         0.6           Path Holds R Reorts, Inc.         1.216         48.275<				0,76
MYR Group, Inc.       987       133.008       0.525         N-able, Inc.       5.526       71.285       0.5         Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.       5.194       67.055       0.4         NMI Holdings, Inc. 'A'       4.544       123.097       0.80         Northwest Natural Holding Co.       2.93       112.152       0.70         NOW, Inc.       10.893       129.300       0.90         NCE Corp.       744       61.112       0.40         Oceaneering International, Inc.       2.424       109.207       0.70         Ontion Incrvation, Inc.       2.824       91.366       0.80         Option Care Health, Inc.       2.824       91.366       0.60         Owens & Minor, Inc.       2.073       105.205       0.70         Park Holdings, Inc.       2.073       105.205       0.70         Park Holdings, Inc.       2.073       105.205       0.70         Park Holdings, Inc.       3.125       0.80       0.80         Perdoceo Education Corp.       6.179       76.125       0.50         Phibro Animal Health Corp. 'A'       8.126       139.395       0.80         Phibro Animal Health Corp. 'A'       8.126       13.818       10.60	· · · ·			0,72
Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.         5.194         67.055         6.4           NIM Holdings, Inc. A'         4.544         120.097         6.0           Northwest Natural Holding Co.         2.939         112.152         6.7           NOW, Inc.         10.893         129.300         0.80           NVE Corp.         744         61.112         0.4           Oceaneering International, Inc.         1.096         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         1.086         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.6           Owens & Minor, Inc.         4.844         79.925         0.7           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Palomar Holdings, Inc.         2.197         74.125         0.6           Perdoces Education Corp.         2.187         74.25         0.6           Perdoces Education Corp.         4.974         63.518         0.4           Phidomart Lithum, Inc.         3.812         79.861         0.5           PotatchDeltic Corp.         1.78         81.611         0.5           PotatchDeltic Corp.         1.786         115.210         0.8				0,94
NMI Holdings, Inc. 'A'       4.544       12.307       0.8         Northwest Natural Holding Co.       2.339       112.152       0.7         NOW, Inc.       10.883       129.300       0.5         NVE Corp.       744       61.112       0.40         Oceaneering International, Inc.       1.066       138.487       0.65         Omnicell, Inc.       1.066       138.487       0.65         Option Care Health, Inc.       2.824       91.356       0.65         Oytion Care Health, Inc.       2.073       105.205       0.7         Park Hotels & Resorts, Inc.       6.179       76.125       0.55         Palomar Holdings, Inc. 'A'       2.327       124.564       0.85         Park Hotels & Resorts, Inc.       6.179       76.125       0.55         Park Hotels & Resorts, Inc.       2.327       124.564       0.85         Park Hotels & Resorts, Inc.       4.974       63.518       0.47         Park Hotels & Resorts, Inc.       1.216       43.275       0.55         Park Hotels & Resorts, Inc.       1.216       43.275       0.35         Phitor Animal Health Corp. 'A'       1.216       43.275       0.35         Phitor Animal Health Corp. A'       3.812 <td< td=""><td>N-able, Inc.</td><td>5.526</td><td>71.285</td><td>0,50</td></td<>	N-able, Inc.	5.526	71.285	0,50
Northwest Natural Holding Co.         2.939         112.152         0.7           NOW, Inc.         10.893         129.300         0.9           NVE Corp.         744         16.112         0.4           Coeaneering International, Inc.         4.246         109.207         0.7           Omnicell, Inc.         1.169         52.652         0.3           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.60           Owens & Minor, Inc.         2.073         105.205         0.7           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         6.179         76.125         0.5           Palomar Holdings, Inc. 'A'         4.974         63.518         0.4           Perdoceo Education Corp.         8.126         138.955         0.5           Perdoceo Education Corp.         4.974         63.518         0.4           Phidoron Lithium, Inc.         1.216         48.27         0.3           Portacto Education Corp.         1.78         81.61         0.5           Primorics Linc.         3.812         12.20         0.6           Primorics Services Corp.         5.81         112.720         0.8 <t< td=""><td>Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.</td><td>5.194</td><td>67.055</td><td>0,47</td></t<>	Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.	5.194	67.055	0,47
NOW, Inc.       10.883       129.300       0.8         NVE Corp.       744       61.112       0.4         Oceaneering International, Inc.       11.69       52.652       0.3         Omnicell, Inc.       1.086       138.487       0.9         Onto Innovation, Inc.       2.024       91.356       0.60         Oytino Care Health, Inc.       2.024       91.356       0.60         Owens & Minor, Inc.       2.073       105.205       0.7         Palomar Holdings, Inc.       2.071       105.205       0.7         Park Hotels & Resorts, Inc.       2.073       105.205       0.7         Park Hotels & Resorts, Inc.       2.071       176.125       0.6         Perdoceo Education Corp.       8.126       138.955       0.9         Pitor Animal Health Corp. 'A'       4.374       63.518       0.4         Pitor Animal Health Corp. 'A'       3.812       79.861       0.4         Pitor Animal Health Corp. 'A'       3.812       79.861       0.6         Pottach Deltic Corp.       1.798       81.611       0.5         Primoris Services Corp.       3.520       115.210       0.8         Primor Water Corp.       1.689       93.114       0.6		4.544	123.097	0,87
NVE Corp.         744         61.112         0.4           Oceaneering International, Inc.         1.09         52.652         0.3           Omnicell, Inc.         1.086         138.487         0.9           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.6           Owens & Minor, Inc.         4.864         78.925         0.7           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.327         124.564         0.6           Perdocee Education Corp.         8.126         138.955         0.6           Phibro Animal Health Corp. 'A'         4.974         63.518         0.4           Piedmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Piedmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Piedmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pimori Services Corp.         3.812         79.861         0.6           Primori Services Corp.         5.81         112.720         0.8           Primori Services Corp.         3.52         15.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.669         93.114         0.6	Northwest Natural Holding Co.	2.939	112.152	0,79
Oceaneering International, Inc.         4.246         109.207         0.7           Omnicell, Inc.         1.069         52.652         0.3           Onto Innovatio, Inc.         2.824         91.356         0.6           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.6           Owens & Minor, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         6.179         76.125         0.5           Perdoces Cducation Corp.         8.126         138.955         0.6           Pridoces Cducation Corp.         4.974         63.518         0.4           Piedmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           Poindarc Corp.         1.798         81.611         0.5           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         4.544         71.795         0.5           Resideo Technologies, Inc.         1.366         67.249         0.4           Reibler Septorain Permian, Inc.         2.644         78.013         0.5 </td <td>NOW, Inc.</td> <td>10.893</td> <td>129.300</td> <td>0,91</td>	NOW, Inc.	10.893	129.300	0,91
Omnicell, Inc.         1.169         52.652         0.33           Onto Innovation, Inc.         1.086         13.847         0.90           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.66           Owens & Minor, Inc.         4.884         78.925         0.57           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.327         124.564         0.8           Perdoceo Education Corp.         8.126         138.955         0.9           Phibro Animal Health Corp. 'A'         6.3.518         0.4           Pidemont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           PottachDeltic Corp.         6.074         83.821         0.5           Primerica, Inc.         3.520         115.210         0.8           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         7.786         7.786         0.5           Resideo Technologies, Inc.         7.786         7.24.576         0.8	NVE Corp.	744	61.112	0,43
Onto Innovation, Inc.         1.086         138.487         0.90           Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.60           Owens & Minor, Inc.         2.873         105.205         0.70           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.70           Park Hotels & Resorts, Inc.         6.179         76.125         0.55           PBF Energy, Inc. 'A'         2.327         124.564         0.80           Perdocec Education Corp.         8.126         138.955         0.90           Phitor Animal Health Corp. 'A'         6.3518         0.44         0.474         63.518         0.44           Pidemont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.35         0.45         0.45           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.55         0.55         0.55           Primor Water Corp.         501         112.720         0.8         0.45         0.45         0.45           Primor Water Corp.         6.074         8.3821         0.55         0.55         0.55         0.55           QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.45         0.45         0.45         0.45         0.55         0.55	Oceaneering International, Inc.	4.246	109.207	0,77
Option Care Health, Inc.         2.824         91.356         0.6           Owens & Minor, Inc.         4.884         78.925         0.6           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         6.179         76.125         0.6           PBF Energy, Inc. 'A'         2.327         124.564         0.8           Perdoceo Education Corp.         8.126         138.955         0.9           Phibro Animal Health Corp. 'A'         63.518         0.4           Pidomart Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           Primerica, Inc.         581         112.720         0.8           Primo Water Corp.         5.31         115.210         0.8           Primorius Services Corp.         3.50         115.210         0.8           Ocroup, Inc.         1.366         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         7.766         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         7.766         124.576         0.8           Riley Ex	Omnicell, Inc.	1.169	52.652	0,37
Owens & Minor, Inc.         4.884         78.925         0.5           Palomar Holdings, Inc.         2.073         105.205         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         6.179         76.125         0.7           Park Hotels & Resorts, Inc.         2.327         124.564         0.8           Perdoceo Education Corp.         8.126         138.955         0.9           Phibro Animal Health Corp. 'A'         4.974         63.518         0.4           Piedoceo Education Corp.         1.216         48.275         0.3           Pidmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           PottatchDeltic Corp.         1.798         81.611         0.5           Primoris Services Corp.         3.820         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         6.074         83.821         0.5           Resideo Technologies, Inc.         7.786         124.576         0.8           Resideo Technologies, Inc.         7.786         124.576         0.8           Resideo Technologies, Inc.         7.786         124.576         0.8           Rover Group, Inc.         553         72.703 <td< td=""><td>Onto Innovation, Inc.</td><td>1.086</td><td>138.487</td><td>0,98</td></td<>	Onto Innovation, Inc.	1.086	138.487	0,98
Palomar Holdings, Inc.       2.073       105.205       0,7         Park Hotels & Resorts, Inc.       6.179       76.125       0,5         PBF Energy, Inc. 'A'       2.327       124.564       0,8         Perdoceo Education Corp.       8.126       138.955       0,9         Phibro Animal Health Corp. 'A'       4.974       63.518       0,4         Piedmont Lithium, Inc.       1.216       48.275       0,3         Pylmouth Industrial REIT, Inc.       3.812       79.861       0,5         Pottacto-Deltic Corp.       1.798       81.611       0,5         Primoris Services Corp.       581       112.720       0,8         QCR Holdings, Inc.       581       112.720       0,8         QCR Holdings, Inc.       1.669       93.114       0,6         Resideo Technologies, Inc.       7.766       124.576       0,5         Revideo Technologies, Inc.       7.766       124.576       0,5         Rover Grop., Inc.       7.766       124.576       0,5         Rover Grop., Inc.       7.766       124.576       0,6         Rover Grop., Inc.       7.73       0,5       0,6         Rover Grop., Inc.       10.650       66.669       0,4	Option Care Health, Inc.	2.824	91.356	0,65
Park Hotels & Resorts, Inc.       6.179       76.125       0.5         PBE Energy, Inc. 'A'       2.327       124.564       0.8         Perdoceo Education Corp.       8.126       138.955       0.9         Phibro Animal Health Corp. 'A'       4.974       63.518       0.4         Piedmont Lithium, Inc.       1.216       48.275       0.3         Pymouth Industrial REIT, Inc.       3.812       79.861       0.5         Primerica, Inc.       6.074       83.821       0.5         Primor Water Corp.       6.074       83.821       0.5         Primor Water Corp.       6.074       83.821       0.5         Primor Water Corp.       3.50       115.210       0.8         QCR Holdings, Inc.       1.669       93.114       0.6         Resideo Technologies, Inc.       1.669       93.114       0.6         Resideo Technologies, Inc.       2.454       78.013       0.5         Rover Group, Inc.       7.786       124.576       0.8         Rover Group, Inc.       2.626       107.20       0.7         Rover Group, Inc.       1.0650       66.669       0.4         Rush Enterprises, Inc. 'A'       2.262       107.20       0.7		4.884		0,56
PBF Energy, Inc. 'A'         2.327         124.564         0.8           Perdoceo Education Corp.         8.126         138.955         0.9           Phibro Animal Heath Corp. 'A'         4.974         63.518         0.4           Piedoneo Education Corp.         1.216         48.275         0.3           Piedonot Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Pymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           PotlatchDeltic Corp.         1.798         81.611         0.5           Primerica, Inc.         581         112.720         0.8           Primoris Services Corp.         6.074         83.821         0.5           QCR Holdings, Inc.         1.669         93.114         0.6           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         7.786         124.576         0.5           Rever Group, Inc.         7.786         124.576         0.6           Royer Scorp.         2.553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryde	Palomar Holdings, Inc.	2.073		0,74
Perdoce Education Corp.         8.126         138.955         0.9           Phibro Animal Health Corp. 'A'         4.974         63.518         0.4           Piedmont Lithium, Inc.         1.216         48.275         0.3           Plymouth Industrial REIT, Inc.         3.812         79.861         0.5           PotlatchDeltic Corp.         1.798         81.611         0.5           Primerica, Inc.         581         112.720         0.8           Primo Water Corp.         6.074         83.821         0.5           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.366         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         1.669         93.114         0.6           Rever Group, Inc.         7.766         124.576         0.8           Ropers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.5           Skyline Champi	Park Hotels & Resorts, Inc.	6.179	76.125	0,54
Phibro Animal Health Corp. 'A'       4.974       63.518       0.4         Piedmont Lithium, Inc.       1.216       48.275       0.3         Plymouth Industrial REIT, Inc.       3.812       79.861       0.5         PotlatchDeltic Corp.       1.798       81.611       0.5         Primerica, Inc.       581       112.720       0.8         Primo Water Corp.       6.074       83.821       0.5         Primo Water Corp.       3.500       115.210       0.8         QCR Holdings, Inc.       1.386       67.249       0.4         Rambus, Inc.       1.669       93.114       0.6         Resideo Technologies, Inc.       7.786       124.576       0.5         REV Group, Inc.       7.786       124.576       0.5         Regers Corp.       553       72.703       0.5         Rover Group, Inc.       10.650       66.669       0.4         Rush Enterprises, Inc. 'A'       2.626       107.220       0.7         Ryder System, Inc.       1.284       137.324       0.9         Syline Champion Corp.       1.213       72.667       0.9         Syline Champion Corp.       3.422       0.5       0.5         Solaris Olifield Infrastructu				0,88
Piedmont Lithium, Inc.       1.216       48.275       0.3         Plymouth Industrial REIT, Inc.       3.812       79.861       0.5         PotlatchDeltic Corp.       1.798       81.611       0.5         Primerica, Inc.       581       112.700       0.8         Primov Mater Corp.       6.074       83.821       0.5         Primov Mater Corp.       6.074       83.821       0.5         QCR Holdings, Inc.       1.386       67.249       0.4         Rambus, Inc.       1.669       93.114       0.6         Resideo Technologies, Inc.       45.44       71.795       0.5         REV Group, Inc.       7.786       124.576       0.8         Riley Exploration Permian, Inc.       2.454       78.013       0.5         Rogers Corp.       553       72.703       0.5         Rush Enterprises, Inc. 'A'       2.626       107.220       0.7         Ryder System, Inc.       1.284       137.324       0.9         Skyline Champion Corp.       1.284       137.324       0.9         Skyline Champion Corp.       3.422       135.682       0.9         Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'       6.537       69.684       0.4 <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,98</td>				0,98
Plymouth Industrial REIT, Inc.       3.812       79.861       0.5         PotlatchDeltic Corp.       1.798       81.611       0.5         Primerica, Inc.       581       112.720       0.8         Primori Services Corp.       6.074       83.821       0.5         QCR Holdings, Inc.       1.386       67.249       0.4         Rambus, Inc.       1.669       93.114       0.6         Resideo Technologies, Inc.       4.544       71.795       0.5         REV Group, Inc.       7.786       124.576       0.8         Riley Exploration Permian, Inc.       2.454       78.013       0.5         Rover Group, Inc.       10.650       66.669       0.4         Rush Enterprises, Inc. 'A'       2.626       107.220       0.7         Ryder System, Inc.       1.284       137.324       0.9         Skyline Champion Corp.       1.131       72.067       0.5         Skyline Champion Corp.       3.422       135.682       0.9         Skyline Champion Corp.       3.422       135.682       0.4         Skyline Champion Corp.       3.637       69.684       0.4         Skolaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'       6.537       69.684       0.4				0,45
PotlatchDeltic Corp.         1.798         81.611         0.5           Primerica, Inc.         581         112.720         0.8           Primo Water Corp.         6.074         83.821         0.5           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.5           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Royer Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Rover Group, Inc.         53         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.131         72.067         0.5           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,34
Primerica, Inc.         581         112.720         0.8           Primo Water Corp.         6.074         83.821         0.5           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.5           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.6           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rogers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         12.84         137.324         0.9           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.9           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,56
Primo Water Corp.         6.074         83.821         0.5           Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.6           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rover Group, Inc.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,58
Primoris Services Corp.         3.520         115.210         0.8           QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         7.786         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.65           Rogers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.42         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         3.422         135.682         0.9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,80
QCR Holdings, Inc.         1.386         67.249         0.4           Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.5           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rover Group, Inc.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         55           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,59
Rambus, Inc.         1.669         93.114         0.6           Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.5           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rover Group, Inc.         53         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,81
Resideo Technologies, Inc.         4.544         71.795         0.5           REV Group, Inc.         7.786         124.576         0.8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rogers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,48
REV Group, Inc.         7.786         124.576         0,8           Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0,5           Rogers Corp.         553         72.703         0,5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0,4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0,7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0,9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0,9           SM Energy Co.         3.422         135.682         0,9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0,4				0,66
Riley Exploration Permian, Inc.         2.454         78.013         0.5           Rogers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.9           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,51
Rogers Corp.         553         72.703         0.5           Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,88
Rover Group, Inc.         10.650         66.669         0.4           Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0.7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,55
Rush Enterprises, Inc. 'A'         2.626         107.220         0,7           Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0,9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0,5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0,9           Solaris Olifield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0,4				0,51
Ryder System, Inc.         1.284         137.324         0.9           Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4	•			0,47
Skyline Champion Corp.         1.131         72.067         0.5           SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4	•			0,76
SM Energy Co.         3.422         135.682         0.9           Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A'         6.537         69.684         0.4				0,97
Solaris Oilfield Infrastructure, Inc. 'A' 69.684 0,4				0,51
				0,96
Squarespace, Inc. 'A' 3.334 96.586 0,6				0,49
	Squarespace, Inc. 'A'	3.334	96.586	0,68

## Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) US Smaller Companies Anlagenaufstellung zum 30. September 2023 (Fortsetzung)

Wertpapierbezeichnung	Stück/ Nennwert	Marktwert in USD	% des Nettover- mögens
Standard Motor Products, Inc.	2.757	92.690	0,66
Stifel Financial Corp.	1.146	70.410	0,50
Summit Materials, Inc. 'A'	2.609	81.244	0,57
Synaptics, Inc.	1.100	98.384	0,70
Tactile Systems Technology, Inc.	5.459	76.699	0,54
Tanger Factory Outlet Centers REIT, Inc.	6.336	143.194	1,01
Tenable Holdings, Inc.	2.003	89.734	0,63
Tennant Co.	1.042	77.264	0,55
Thermon Group Holdings, Inc.	3.063	84.141	0,59
Tri Pointe Homes, Inc.	3.596	98.351	0,70
TrueBlue, Inc.	5.053	74.128	0,52
Under Armour, Inc. 'A'	12.596	86.283	0,61
Upwork, Inc.	5.288	60.072	0,42
Vanda Pharmaceuticals, Inc.	8.146	35.191	0,25
Veracyte, Inc.	2.846	63.551	0,45
Vericel Corp.	2.619	87.789	0,62
Vishay Precision Group, Inc.	2.343	78.678	0,56
Vital Farms, Inc.	6.042	69.966	0,49
W&T Offshore, Inc.	19.585	85.782	0,61
World Fuel Services Corp.	2.701	60.583	0,43
Yelp, Inc.	2.169	90.209	0,64
Zuora, Inc. 'A'	10.598	87.328	0,62
		13.332.502	94,19
ANTEILE GESAMT		13.956.098	98,60
ZUM AMTLICHEN BÖRSENHANDEL ZUGELASSENE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT NOT ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE INSGESAMT	ERTE	13.956.098	98,60
ANLAGEN INSGESAMT		13.956.098	98,60
SONSTIGE AKTIVA / (PASSIVA)		198.116	1,40
GESAMTES NETTOVERMÖGEN		14.154.214	100,00

# Columbia Threadneedle (Lux) III – CT (Lux) US Smaller Companies Aufteilung des Fondsvermögens nach Branchen zum 30. September 2023

Branche	% des Netto- vermögens
Luftfahrt und Verteidigung	0,42
Pipelines	0,48
Landwirtschaft	0,49
Elektrische Geräte	0,61
Elektrische Komponenten und Zubehör	0,67
Kosmetika/Körperpflegeprodukte	0,68
Freizeit und Tourismus	1,01
Metalle und Bergbau	1,25
Telekommunikation	1,40
Bau- und Ingenieurswesen	1,75
Vertrieb und Großhandel	1,82
Wohnungsbauunternehmen	1,90
Automobilzulieferer	1,99
Nahrungsmittel und Getränke	2,06
Einzelhandel	2,14
Chemikalien	2,25
Baustoffe	2,66
Verschiedene Unternehmen des verarbeitenden Gewerbes	2,75
Computer	2,87
Internet	3,38
Biotechnologie	3,73
Transport und Verkehr	3,85
Arzneimittel	4,23
Gewerbliche Dienstleistungen	4,49
Maschinenbau	4,54
Immobilien	4,63
Software	5,43
Gesundheitswesen	5,93
Versicherungen	5,99
Halbleiter	6,57
Finanzdienstleistungen	7,12
Öl und Gas	9,51
Anlagen insgesamt	98,60

Sonstige Aktiva / (Passiva)	1,40
Gesamtes Nettovermögen	100,00

## Columbia Threadneedle (Lux) III Konsolidierte Zusammensetzung des Nettovermögens zum 30. September 2023

	Erläuterungen	CT (Lux) Diversified Growth EUR	CT (Lux) Euro Anleihe EUR	CT (Lux) European Growth & Income EUR	CT (Lux) European Smaller Cap EUR
AKTIVA					
Wertpapierbestand zum Marktwert Einstandskosten	2	102.495.139 104.760.225	85.849.991 93.650.849	36.516.413 28.882.744	7.162.447 6.867.044
Optionen	2	421.263	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten	2	305.285	74.603	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus					
Devisenterminkontrakten	2	174.231	-	-	2
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2	1.174.009	-	-	-
Kosten von Swap-Kontrakten		-	-	-	-
Anlagenverkäufe		-	9.941.657	382.860	12.363
Forderungen aus Zeichnungen		70	-	30	-
Dividenden- und Zinsforderungen		137.275	625.226	150.816	23.768
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	-	-	-	-
Sonstige Aktiva	2	128	-	-	62
Bankguthaben:					
Zahlungsmittel und Bankeinlagen	2	2.909.500	2.279.936	438.501	70.856
Guthaben bei Brokern		1.741.930	139.820	-	-
Aktiva insgesamt		109.358.830	98.911.233	37.488.620	7.269.498
24.001/4					
PASSIVA	2	101 015			
Optionen Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten	2	101.015 323.263	- 57.709	-	-
Nicht realisierter Verlust aus	2	323.263 1.131.669	57.709	-	50
Devisenterminkontrakten	2	1.131.009	-	-	50
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2	50.038	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		42.021	254.921	21.080	-
Zahlungen über Swap-Kontrakte abgerechnet		-	-	-	-
Erworbene Kapitalanlagen		-	12.419.660	382.860	-
Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	4	70.641	53.695	97.461	18.246
Zinsverbindlichkeiten		-	-	-	-
Aufwendungen und Steuern		130.100	41.220	47.736	29.717
	2	2	-	92	4
Banküberziehungskredite					
Banküberziehungskredite Verbindlichkeiten gegenüber Brokern		419.997	20.624	-	-
5		419.997 <b>2.268.746</b>	20.624 <b>12.847.829</b>	549.229	48.017
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern					
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern Passiva insgesamt	15	2.268.746	12.847.829	549.229	

## Konsolidierte Zusammensetzung des Nettofondsvermögens (Fortsetzung) zum 30. September 2023

		CT (Lux) Global Absolute Return Bond	Convertible Bond	Smaller Cap Equity	Total Return Bond
	Erläuterungen	EUR	EUR	USD	EUR
AKTIVA	0	400,000,040	00 540 000	0.000.040	07 004 400
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	168.329.619	29.519.396	3.938.016	27.334.186
Einstandskosten		175.266.764	30.242.999	3.722.326	29.286.397
Optionen	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus					
Terminkontrakten	2	963.323	-	-	162.608
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	2	120 527	5.339		66.622
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2	430.527 2.056.176	5.559	-	1.139.444
Kosten von Swap-Kontrakten	Z	2.030.170	-	-	872.121
Anlagenverkäufe		326.170	-		072.121
Forderungen aus Zeichnungen			2	1.125	-
Dividenden- und Zinsforderungen		2.467.709	184.425	7.572	396.401
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	255.236	-	-	-
Sonstige Aktiva	2	-	55	-	-
Ponkouth chone					
Bankguthaben:	0	2 604 442	70.057	04 567	2 110 060
Zahlungsmittel und Bankeinlagen Guthaben bei Brokern	2	3.604.412 2.418.126	73.257	81.567	2.110.069
			-	-	685.065
Aktiva insgesamt		180.851.298	29.782.474	4.028.280	32.766.516
PASSIVA					
Optionen	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus	-				
Terminkontrakten	2	618.865	-	-	199.044
Nicht realisierter Verlust aus					
Devisenterminkontrakten	2	1.479.555	46.325	-	251.590
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2	4.179.358	-	-	2.429.991
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		-	20.641	-	-
Zahlungen über Swap-Kontrakte		004.044			
abgerechnet		301.614	-	-	-
Erworbene Kapitalanlagen Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr der		1.351.468	-	-	112.894
Verwaltungsgesellschaft	4	88.494	48.364	9.005	25.662
Zinsverbindlichkeiten	Т		31	-	- 20.002
Aufwendungen und Steuern		160.114	82.818	27.334	74.183
Banküberziehungskredite	2	36.915	93.029	-	5.547
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern		300.492	-	-	88.182
Passiva insgesamt		8.516.875	291.208	36.339	3.187.093
NETTOFONDSVERMÖGEN		172.334.423	29.491.266	3.991.941	29.579.423
Swing-Pricing-Effekt	15	-	-	-	-
Nettofondsvermögen gesamt (nach Swing					
Pricing)	15	172.334.423	29.491.266	3.991.941	29.579.423

## Konsolidierte Zusammensetzung des Nettofondsvermögens (Fortsetzung) zum 30. September 2023

	Erläuterungen	Euro Corporate Anleihe	CT (Lux) Responsible Global Emerging Aktienmärkte USD	Responsible	CT (Lux) SDG Engagement Global Equity USD
AKTIVA	Enduterungen	LOIN	000	Lon	000
Wertpapierbestand zum					
Marktwert	2	42.706.284	340.654.961	739.681.425	1.038.033.351
Einstandskosten		47.873.040	371.726.636	637.054.375	1.079.319.600
Optionen	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten	2	40.436	-	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	2	16.040	-	-	2.841.963
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2		_		_
Kosten von Swap-Kontrakten	2	_	_	_	-
Anlagenverkäufe		_	2.456.241	547.038	5.467.751
Forderungen aus Zeichnungen Dividenden- und		-	437.775	471.290	813.786
Zinsforderungen		478.748	855.783	554.010	1.073.509
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4		202.209	351.138	75.372
Sonstige Aktiva	2		- 202.203	2.112	-
Bankguthaben:					
Zahlungsmittel und					
Bankeinlagen	2		938.753	7.327.186	288.447
Guthaben bei Brokern		248.000	-	-	12.360.000
Aktiva insgesamt		44.241.982	345.545.722	748.934.199	1.060.954.179
PASSIVA					
Optionen	2	-	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten	2	81.780	-	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	2	67.715	-	-	1.303.915
Nicht realisierter Verlust aus					
Swaps Verbindlichkeiten aus	2	-	-	-	-
Rücknahmen		1.189	258.969	559.370	1.315.598
Zahlungen über Swap- Kontrakte abgerechnet		-	_	_	-
Erworbene Kapitalanlagen		-	1.898.962	120.393	4.228.538
Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr der				0.000	
Verwaltungsgesellschaft	4	20.660	561.233	1.176.479	1.014.499
Zinsverbindlichkeiten		-	-	-	173
Aufwendungen und Steuern		57.938	433.597	737.735	890.582
Banküberziehungskredite	2	-	309	526	4.302
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern		28.632	-	-	-
Passiva insgesamt		257.914	3.153.070	2.594.503	8.757.607
NETTOFONDSVERMÖGEN		43.984.068	342.392.652	746.339.696	1.052.196.572
Swing-Pricing-Effekt	15	-	-	-	-
Nettofondsvermögen gesamt		40.004.000	240 000 050	746 000 000	1 050 400 570
(nach Swing Pricing)	15	43.984.068	342.392.652	140.339.696	1.052.196.572

## Konsolidierte Zusammensetzung des Nettofondsvermögens (Fortsetzung)

zum 30. September 2023

	Erläuterungen	CT (Lux) Sustainable CT Global Equity Enhanced Income* USD	(Lux) Sustainable C Multi-Asset Income EUR	T (Lux) Sustainable Opportunities European Equity EUR	
AKTIVA					
Wertpapierbestand zum	_				
Marktwert	2	408.743.383	63.161.158		13.956.098
Einstandskosten		417.899.000	67.350.710	12.398.548	12.881.907
Optionen	2	-	258.194	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten	2	128.480	186.706	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus	2	120.400	100.700		
Devisenterminkontrakten	2	24.139	239.331	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus	0	-	-	-	-
Swaps Kastan yan Swan Kantraktan	2				
Kosten von Swap-Kontrakten Anlagenverkäufe		-	-	-	-
Forderungen aus Zeichnungen	1	1.611.705	72	32.196	3.275
Dividenden- und					
Zinsforderungen		658.283	347.694	30.618	3.572
Verzicht auf	4	15 007	-	47.010	-
Anlageverwaltungsgebühren Sonstige Aktiva	4	15.807 3.564		47.010	
Conolige / Intiva	2	0.004			
Bankguthaben:					
Zahlungsmittel und	_				
Bankeinlagen	2	17.780.270	563.078	285.672	275.862
Guthaben bei Brokern	<del>,</del>	4.431.191	771.231	-	-
Aktiva insgesamt		433.396.822	65.527.464	13.818.931	14.238.807
PASSIVA					
Optionen	2	1.228.023	61.913	-	-
Nicht realisierter Verlust aus	_				
Terminkontrakten	2	-	124.200	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	2	2 407	602.265		
Nicht realisierter Verlust aus	2	3.197	603.265	-	-
Swaps	2	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus					
Rücknahmen		602.537	145.921	33.752	13.084
Zahlungen über Swap- Kontrakte abgerechnet		-	-	-	-
Erworbene Kapitalanlagen		-	98.975	-	_
Anlageverwaltungsgebühr und			00.070		
Gebühr der					
Verwaltungsgesellschaft	4	24.177	142.545	35.986	37.700
Zinsverbindlichkeiten		-	- 103.730	-	-
Aufwendungen und Steuern Banküberziehungskredite	2	44.022 507	103.730	33.506	33.809
Verbindlichkeiten gegenüber	2	945.599	305.489	-	-
Brokern					
Passiva insgesamt		2.848.062	1.586.039	103.244	84.593
NETTOFONDSVERMÖGEN		430.548.760	63.941.425	13.715.687	14.154.214
NETTOFONDSVERMÖGEN Swing-Pricing-Effekt Nettofondsvermögen gesamt	15 15	<b>430.548.760</b> - 430.548.760	<b>63.941.425</b> - 63.941.425	-	<b>14.154.214</b> - 14.154.214

\* Siehe Anhang I.

## Konsolidierte Zusammensetzung des Nettofondsvermögens (Fortsetzung) zum 30. September 2023

	3	Konsolidiert zum 0. September 2023 30	Konsolidiert zum 0. September 2022	
	Erläuterungen	EUR	EUR	
AKTIVA				
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	3.021.327.773	3.763.514.593	
Einstandskosten		3.014.554.024	4.048.759.704	
Optionen	2	679.457	-	
Nicht realisierter Gewinn aus Terminkontrakten Nicht realisierter Gewinn aus Devisen-	2	1.854.312	8.701.504	
termingeschäften	2	3.639.154	23.299.675	
Nicht realisierter Gewinn aus Swaps	2	4.369.629	12.519.881	
Kosten von Swap-Kontrakten		872.121	10.611.882	
Anlagenverkäufe		18.694.378	67.429.634	
Forderungen aus Zeichnungen		3.212.199	3.161.129	
Dividenden- und Zinsforderungen		7.851.206	8.715.952	
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	930.492	1.194.352	
Sonstige Aktiva	2	5.723	91.602	
Bankguthaben:				
Zahlungsmittel und Bankeinlagen	2	38.705.282	71.014.046	
Guthaben bei Brokern		21.863.620	39.018.488	
Aktiva insgesamt		3.124.005.346	4.009.272.738	
PASSIVA				
Optionen	2	1.322.808	-	
Nicht realisierter Verlust aus Terminkontrakten	2	1.404.861	2.236.702	
Nicht realisierter Verlust aus Devisen-	E E	1.404.001	2.200.702	
termingeschäften	2	4.814.749	11.636.108	
Nicht realisierter Verlust aus Swaps	2	6.659.387	29.704.132	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	E E	3.147.549	99.868.896	
Zahlungen über Swap-Kontrakte abgerechnet		301.614		
Erworbene Kapitalanlagen		20.273.735	3.917.197	
Anlageverwaltungsgebühr und		20121 011 00	0.011101	
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	4	3.333.476	2.413.056	
Zinsverbindlichkeiten		194		
Aufwendungen und Steuern		2.848.827	4.040.855	
Banküberziehungskredite	2	140.950	11.808.846	
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	-	2.056.544	10.870.645	
Passiva insgesamt		46.304.694	176.496.437	
NETTOFONDSVERMÖGEN		3.077.700.652	3.832.776.301	
Swing-Pricing-Effekt	15	0	(755.316)	
Nettofondsvermögen gesamt (nach Swing Pricing)	15	3.077.700.652	3.832.020.985	

	Erläuterungen	CT (Lux) Diversified Growth EUR	CT (Lux) Euro Anleihe EUR	CT (Lux) European Growth & Income EUR	European Smaller Cap
ERTRÄGE					
Dividenden (abzüglich Quellensteuer)	2	1.730.658	-	1.019.997	150.578
Zinsen (abzüglich Quellensteuer)	2	445.781	2.361.865	3.350	1.584
Zinsen aus Bankguthaben	2	172.889	11.511	-	-
Erträge aus Wertpapierleihe	2	32.195	2.034	7.202	11.344
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	-	-	-	-
Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	2	-	75.206	-	-
Sonstige Erträge		3.394	360	34	226
Erträge insgesamt	· · ·	2.384.917	2.450.976	1.030.583	163.732
AUFWENDUNGEN					
Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr der					
Verwaltungsgesellschaft	4.7	(389.727)	(399.151)	(560.182)	( )
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	5	(287.646)	(107.260)	(39.173)	(26.135)
Honorare für Wirtschaftsprüfung, Steuer- und		(00.007)	(0.400)	(45.040)	(4.440)
Rechtsberatung	0	(28.627)	(9.129)	(15.919)	, ,
Taxe d'abonnement	8	(17.698)	(13.423)	(18.490)	(3.726)
Bankzinsen und -gebühren	6	-	-	- (1 002)	-
Honorare der Verwaltungsratsmitglieder	9	(3.241) (53.517)	(3.033)	(1.092)	
Vertriebsgebühren Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	9	(241.166)	-	(18.432)	(3.878)
Sonstige Aufwendungen	2	(48.155)	(46.386)	(22.489)	(3.026)
Aufwendungen insgesamt		(1.069.777)	(578.382)	(675.777)	
Netto-Ausgleichsrechnung	3	(30.066)	(696.695)	(8.219)	. ,
Nettoerträge aus Wertpapieranlagen		1.285.074	1.175.899	346.587	
Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus					
Wertpapierverkäufen Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wechselkursen und		12.873.664	(12.237.012)	1.356.209	186.162
Devisenterminkontrakten Realisierter Nettogewinn/		4.653.204	(421)	33.039	(60.051)
(-verlust) aus Optionen		245.922	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus Futures- Kontrakten Realisierter Nettogewinn/		(1.071.424)	(254.261)	-	-
(-verlust) aus Swap- Kontrakten		(343.551)	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr		17.642.889	(11.315.795)	1.735.835	139.864

	Erläuterungen	CT (Lux) Diversified Growth EUR		CT (Lux) European Growth & Income EUR	European Smaller Cap
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Anlagen	2	(9.853.388)	16.776.860	5.134.836	759.982
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Devisentermingeschäften Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	(1.747.375)	-	-	1.499
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Optionen Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	(13.584)	-	-	-
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Terminkontrakten Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	(1.450.942)	(280.709)	-	-
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Swap-Kontrakten Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	1.531.018	-	-	-
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Fremdwährungen	2	9.010	(1.017)	3.178	7.344
Nettoerträge/(-verluste) aus Anlagen im Geschäftsjahr insgesamt		6.117.628	5.179.339	6.873.849	908.689
Zeichnungen von Anteilen	3	5.850.415	6.745.006	2.305.554	243.841
Rücknahmen von Anteilen	3	(9.658.418)	(121.511.432)	(3.582.388)	(1.114.100)
Gezahlte Dividenden	14	-	-	(429.934)	(1.529)
Finanzierungskosten insgesamt		(3.808.003)	(114.766.426)	(1.706.768)	(871.788)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (vor Rücknahme des Swing Pricing)		104.780.459	195.650.491	31.772.310	7.184.580
Rücknahme des Swing Pricing		-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (nach Rücknahme des Swing Pricing)		104.780.459	195.650.491	31.772.310	7.184.580
Währungsberichtigung		-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres		107.090.084	86.063.404	36.939.391	7.221.481
Swing Pricing	15	-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres (nach Swing Pricing)	15	107.090.084	86.063.404	36.939.391	7.221.481

	Erläuterungen	CT (Lux) Global Absolute Return Anleihe EUR	CT (Lux) Global Convertible Anleihe EUR	CT (Lux) Global ( Smaller Cap Aktien USD	CT (Lux) Global Total Return Anleihe EUR
ERTRÄGE					
Dividenden (abzüglich Quellensteuer)	2	-	2.923	71.853	-
Zinsen (abzüglich Quellensteuer)	2	4.925.606	249.017	1.194	2.380.119
Zinsen aus Bankguthaben	2	75.883	-	-	28.392
Erträge aus Wertpapierleihe	2	4.455	-	-	2.337
Verzicht auf	_				
Anlageverwaltungsgebühren	4	255.236	-	-	-
Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	2	346.360	-	-	10.423
Sonstige Erträge		40.365	2.074	16.085	134
Erträge insgesamt		5.647.905	254.014	89.132	2.421.405
AUFWENDUNGEN					
Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr					
der Verwaltungsgesellschaft	4. 7	(447.150)	(332.711)	(54.695)	(325.013)
Verwaltungs- und					
Verwahrstellengebühren	5	(250.640)	(61.121)	(11.734)	(166.873)
Honorare für Wirtschaftsprüfung,		(10.000)			(10.0.1.1)
Steuer- und Rechtsberatung		(16.609)	(29.502)	-	(13.944)
Taxe d'abonnement	8	(16.553)	(15.849)	(1.608)	(6.236)
Bankzinsen und -gebühren		-	-	-	-
Honorare der Verwaltungsratsmitglieder		(2.396)	(947)	(112)	(1.254)
Vertriebsgebühren	9	(79.311)	(17.798)	(2.135)	(38.188)
Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	2	-	(181.153)	-	-
Sonstige Aufwendungen		(68.791)	(35.476)	(1.992)	(29.668)
Aufwendungen insgesamt		(881.450)	(674.557)	(72.276)	(581.176)
Netto-Ausgleichsrechnung	3	400.867	75.919	990	(1.098.883)
Nettoerträge aus Wertpapieranlagen		5.167.322	(344.624)	17.846	741.346
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)					
aus Veräußerungen von Anlagen		(10.778.532)	(1.303.285)	155.620	(3.472.103)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		,	,		,
aus Fremdwährungen und					
Devisenterminkontrakten		(11.354.043)	588.045	(51.187)	(476.582)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)					
aus Optionskontrakten		560.724	-	-	567.251
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)					
aus Terminkontrakten		1.014.116	-	-	(1.076.554)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten		(1.373.198)	-	-	(588.766)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr		(16.763.611)	(1.059.864)	122.279	(4.305.408)

	Erläuterungen	CT (Lux) Global Absolute Return Anleihe EUR	Convertible	CT (Lux) Global C Smaller Cap Aktien USD	T (Lux) Global Total Return Anleihe EUR
	Enauterungen	LOIX	LOK	000	LOIX
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Anlagen	2	16.167.285	2.013.119	533.261	6.473.812
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Devisentermingeschäften	2	(6.353.335)	335.923	-	(297.158)
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Optionen	2	-	-	-	-
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Terminkontrakten	2	(2.572.277)	_	_	(263.414)
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Swap-Kontrakten	2	12.237.789	-	_	1.125.686
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Fremdwährungen	2	1.661.938	(465)	2.367	25.657
Nettoerträge/(-verluste) aus Anlagen im Geschäftsjahr insgesamt		4.377.789	1.288.713	657.907	2.759.175
Zeichnungen von Anteilen	3	136.961.888	334.545	155.617	4.338.071
Rücknahmen von Anteilen	3	(157.834.134)	(15.195.386)	(713.609)	(73.924.825)
Gezahlte Dividenden	14	-	-	-	(5.281)
Finanzierungskosten insgesamt		(20.872.246)	(14.860.841)	(557.992)	(69.592.035)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (vor Rücknahme des Swing Pricing)		188.073.564	43.063.394	3.892.026	96.412.283
Rücknahme des Swing Pricing		755.316	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (nach Rücknahme des Swing Pricing)		188.828.880	43.063.394	3.892.026	96.412.283
Währungsberichtigung		-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres		172.334.423	29.491.266	3.991.941	29.579.423
Swing Pricing	15	-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres (nach Swing Pricing)	) 15	172.334.423	29.491.266	3.991.941	29.579.423

	Erläuterungen	CT (Lux) Plus Ⅱ <sup>*</sup> EUR	CT (Lux) Responsible Euro Corporate Anleihe EUR	CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity USD	Responsible
ERTRÄGE					
Dividenden (abzüglich					
Quellensteuer)	2	-	-	7.012.613	14.686.880
Zinsen (abzüglich Quellensteuer)	2	-	1.552.221	-	30.735
Zinsen aus Bankguthaben	2	-	6.431	-	-
Erträge aus Wertpapierleihe	2	-	1.186	3.640	-
Verzicht auf					
Anlageverwaltungsgebühren	4	-	-	202.209	351.138
Netto-Abschreibung / Netto-					
Zuwachs	2	-	-	-	-
Sonstige Erträge		-	2.757	6.673	1.944
Erträge insgesamt		-	1.562.595	7.225.135	15.070.697
AUFWENDUNGEN					
Anlageverwaltungsgebühr und					
Gebühr der		<i>(</i> )	(	(	<i></i>
Verwaltungsgesellschaft	4.7	(22.554)	(144.566)	(3.999.670)	(10.079.308)
Verwaltungs- und	r	(47 740)	(00, 40.4)	(540.000)	(070 700)
Verwahrstellengebühren	5	(17.713)	(86.484)	(512.666)	(872.789)
Honorare für Wirtschaftsprüfung, Steuer- und Rechtsberatung		(691)	(8.731)	(109.312)	(182.463)
Taxe d'abonnement	8	(455)	(29.013)	(181.037)	( )
Bankzinsen und -gebühren	0	(1.537)	(20.010)	(1.101.285)	
Honorare der		(1.557)		(1.101.200)	
Verwaltungsratsmitglieder	6	(147)	(1.557)	(8.613)	(23.801)
Vertriebsgebühren	9	-	(41.449)	(207.778)	```
Netto-Abschreibung / Netto-			( - )	( /	(,
Zuwachs	2	-	(137.139)	-	-
Sonstige Aufwendungen		(32.659)	(43.718)	(217.795)	(597.911)
Aufwendungen insgesamt		(75.756)	(492.657)	(6.338.156)	(12.645.591)
Netto-Ausgleichsrechnung	3	4.775	(489.815)	335.249	(1.293.067)
Nettoerträge aus Wertpapieranlagen		(70.981)	580.123	1.222.228	1.132.039
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Veräußerungen von Anlagen		(2.994.395)	(8.562.392)	(21.501.016)	108.010.055
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)					
aus Fremdwährungen und			4 404 000	(40, 740, 700)	10 077 000
Devisenterminkontrakten		-	1.491.836	(18.710.798)	12.877.880
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Terminkontrakten			105.508		
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		-	103.306	-	-
aus Swap-Kontrakten		-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust für das Geschäftsjahr	)	(3.065.376)	(6.384.925)	(38.989.586)	122.019.974

\*Siehe Anhang I.

### Columbia Threadneedle (Lux) III Konsolidierte Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nottofondsvormägen (Fortsotzung)

Nettofondsvermögen (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Erläuterungen	CT (Lux) Plus II <sup>°</sup> EUR	CT (Lux) Responsible Euro Corporate Anleihe EUR	CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity USD	CT (Lux) Responsible Global Equity EUR
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/ (Wertminderungen) aus Anlagen	2	3.215.543	17.791.215	107.362.676	(74.149.364)
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/ (Wertminderungen) aus Devisentermingeschäften Nettoveränderung bei nicht	2	-	(1.022.625)	-	-
realisierten Wertsteigerungen/ (Wertminderungen) aus Optionen	2	-	-	-	-
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/ (Wertminderungen) aus Terminkontrakten Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/	2	-	(326.008)	-	-
(Wertminderungen) aus Swap- Kontrakten Nettoveränderung bei nicht	2	-	-	-	-
realisierten Wertsteigerungen/ (Wertminderungen) aus Fremdwährungen	2	-	5.397	103.888	35.534
Nettoerträge/(-verluste) aus Anlagen im Geschäftsjahr					
insgesamt		150.167	10.063.054	68.476.978	47.906.144
Zeichnungen von Anteilen	3	-	3.682.977	131.007.155	317.860.751
Rücknahmen von Anteilen	3	(48.812.825)	(105.548.315)	(311.732.040)	(874.982.192)
Gezahlte Dividenden	14	-	(978.503)	(171.106)	(2.197.070)
Finanzierungskosten insgesamt		(48.812.825)	(102.843.841)	(180.895.991)	(559.318.511)
Nettovermögen zu Beginn des					
Geschäftsjahres (vor Rücknahme des Swing Pricing)		48.662.658	136.764.855	454.811.665	1.257.752.063
Rücknahme des Swing Pricing		-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (nach		40.000.050		454 044 005	4 057 750 000
Rücknahme des Swing Pricing)		48.662.658	136.764.855	454.811.665	1.257.752.063
Währungsberichtigung		-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres		-	43.984.068	342.392.652	746.339.696
Swing Pricing	15	-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres					
(nach Swing Pricing)	15	-	43.984.068	342.392.652	746.339.696

<sup>\*</sup>Siehe Anhang I.

## Columbia Threadneedle (Lux) III Konsolidierte Ergebnisrechnung und Veränderungen im

Nettofondsvermögen (Fortsetzung) Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Erläuterungen	CT (Lux) SDG Engagement Global Equity USD	CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income <sup>*</sup> USD	CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income EUR	CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity EUR
ERTRÄGE					
Dividenden (abzüglich Quellensteuer)	2	17.346.517	670.006	896.404	440.284
Zinsen (abzüglich Quellensteuer)	2	-	506	808.275	2.017
Zinsen aus Bankguthaben	2	614.423	43	59.106	-
Erträge aus Wertpapierleihe	2	1.476	-	400	3.551
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	75.372	15.807	-	47.010
Netto-Abschreibung / Netto- Zuwachs	2	-	-	123.472	-
Sonstige Erträge		1.076	-	27	183
Erträge insgesamt		18.038.864	686.362	1.887.684	493.045
AUFWENDUNGEN					
Anlageverwaltungsgebühr und					
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	4. 7	(6.205.895)	(24.176)	(923.129)	(222.920)
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	5	(918.749)	(4.496)	(211.948)	(34.053)
Honorare für Wirtschaftsprüfung, Steuer- und Rechtsberatung		(137.307)	-	(15.928)	(11.940)
Taxe d'abonnement	8	(132.237)	(35.310)	(35.012)	(8.272)
Bankzinsen und -gebühren		(294.291)	-	-	-
Honorare der Verwaltungsratsmitglieder	6	(25.602)	-	(1.991)	(391)
Vertriebsgebühren	9	(572.526)	(2.717)	(36.457)	(8.975)
Netto-Abschreibung / Netto- Zuwachs	2	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen		(585.433)	(3.678)	(58.939)	(33.678)
Aufwendungen insgesamt		(8.872.040)	(70.377)	(1.283.404)	(320.229)
Netto-Ausgleichsrechnung	3	(317.179)	1.357.858	(38.475)	(33.148)
Nettoerträge aus Wertpapieranlagen		8.849.645	1.973.843	565.805	139.668
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen Realisierter Nettogewinn/(-verlust)		(52.372.658)	(3.091.027)	(2.666.413)	581.845
aus Fremdwährungen und Devisenterminkontrakten		11.526.097	489.187	1.262.289	49.884
Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus Optionskontrakten		-	1.490	150.727	-
Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus Futures-Kontrakten Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus Swap-Kontrakten		-	(2.366.773)	(368.443)	-
Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) für das Geschäftsjahr		(31.996.916)	(2.993.280)	(1.056.035)	771.397

\*Siehe Anhang I.

	Erläuterungen	CT (Lux) SDG Engagement Global Equity USD	CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income USD	CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income EUR	CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity EUR
Nettoveränderung bei nicht					
realisierten Wertsteigerungen /					
(Wertminderungen) aus Anlagen Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /	2	192.395.864	(9.155.617)	767.896	1.807.301
(Wertminderungen) aus Devisen- Devisentermingeschäften	2	(3.510.221)	20.942	(75.436)	_
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /	L	(0.010.221)	20.042	(10.400)	
(Wertminderungen) aus Optionskontrakten	2	-	24.977	(8.325)	-
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /					
(Wertminderungen) aus Terminkontrakten	2	-	128.480	(1.243.352)	-
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /					
(Wertminderungen) aus Swap- Kontrakten	2	-	-	-	-
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /					
(Wertminderungen) auf Fremdwährungen	2	567.545	(550)	9.582	727
Nettoerträge/(-verluste) aus					
Anlagen im Geschäftsjahr insgesamt		157.456.272	(11.975.048)	(1.605.670)	2.579.425
Zeichnungen von Anteilen	3	140.672.369	440.057.277	262.724	2.063.995
Rücknahmen von Anteilen Gezahlte Dividenden	3 14	(369.080.291) (366.892)	2.466.531	(8.678.848) (2.087.612)	(8.526.982) (64.550)
Finanzierungskosten	14	(300.032)		(2.007.012)	(04.000)
insgesamt		(228.774.814)	442.523.808	(10.503.736)	(6.527.537)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahrs					
(vor Rücknahme des Swing Pricing)		1.123.515.114	-	76.050.831	17.663.799
Rücknahme des Swing Pricing		-	-	-	-
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahrs					
(nach Rücknahme des Swing Pricing)		1.123.515.114	-	76.050.831	17.663.799
Währungsberichtigung		-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres		1.052.196.572	430.548.760	63.941.425	13.715.687
Swing Pricing	15	-	-	-	-
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres (nach Swing Pricing)	15	1.052.196.572	430.548.760	63.941.425	13.715.687
Pricing)	15	1.052.196.572	430.548.760	63.941.425	13.715.687

<sup>\*</sup>Siehe Anhang I.

	Erläuterungen	CT (Lux) US Smaller Companies USD	Konsolidiert 2023 EUR	Konsolidiert 2022 EUR
ERTRÄGE				
Dividenden (abzüglich Quellensteuer)	2	126.651	42.577.627	54.973.632
Zinsen (abzüglich Quellensteuer)	2	2.596	12.764.597	22.068.527
Zinsen aus Bankguthaben	2	-	930.249	55.872
Erträge aus Wertpapierleihe	2	-	69.500	47.649
Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren	4	-	928.424	1.141.555
Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	2	-	555.461	-
Sonstige Erträge		-	73.841	401.078
Erträge insgesamt		129.247	57.899.699	78.688.313
AUFWENDUNGEN				
Anlageverwaltungsgebühr und Gebühr der				
Verwaltungsgesellschaft	4.7	(221.182)	(23.805.647)	(33.641.942)
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	5	(39.343)	(3.555.827)	(5.026.810)
Honorare für Wirtschaftsprüfung, Steuer-				
und Rechtsberatung		(7.502)	(575.830)	(628.597)
Taxe d'abonnement	8	(7.219)	(799.651)	(1.086.020)
Bankzinsen und -gebühren		-	(1.309.834)	(1.355.679)
Honorare der Verwaltungsratsmitglieder	6	(408)	(72.623)	(66.912)
Vertriebsgebühren	9	(7.289)	(1.630.344)	(2.342.333)
Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs	2	-	(559.458)	(3.364.668)
Sonstige Aufwendungen		(9.143)	(1.787.777)	(1.977.202)
Aufwendungen insgesamt		(292.086)	(34.096.991)	(49.490.163)
Netto-Ausgleichsrechnung	3	3.553	(1.910.917)	(12.271.539)
Nettoerträge aus Wertpapieranlagen		(159.286)	21.891.791	16.926.611
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen und		350.468	9.316.912	60.438.904
Devisenterminkontrakten		-	2.740.318	(39.776.761)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Optionskontrakten		-	1.526.021	251.070
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures-Kontrakten		-	(3.869.813)	59.081.961
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten		-	(2.305.515)	(6.948.349)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) für das Geschäftsjahr		191.182	29.299.714	89.973.436

	Erläuterungen	CT (Lux) US Smaller Companies USD	Konsolidiert 2023 EUR	Konsolidiert 2022 EUR
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Anlagen Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen /	2	1.774.841	261.497.466	(1.149.325.625)
(Wertminderungen) aus Devisenterminkontrakten Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	-	(12.429.566)	16.182.897
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Optionen Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	-	1.506	(205.229)
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Terminkontrakten Nettoveränderung bei nicht realisierten	2	-	(6.016.257)	2.597.058
Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Swap-Kontrakten	2	-	14.894.493	(10.764.570)
Nettoveränderung bei nicht realisierten Wertsteigerungen/(Wertminderungen) aus Fremdwährungen	2	-	2.388.030	(2.769.420)
Nettoerträge/(-verluste) aus Anlagen im Geschäftsjahr insgesamt		1.966.023	289.635.386	(1.054.311.453)
Zeichnungen von Anteilen	3	229.370	1.148.235.458	1.620.199.935
Rücknahmen von Anteilen	3	(877.980)	(2.066.783.950)	(2.498.326.608)
Gezahlte Dividenden	14	-	(6.268.831)	(6.420.617)
Finanzierungskosten insgesamt		(648.610)	(924.817.323)	(884.547.290)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (vor Rücknahme des Swing Pricing)		12.836.801	3.832.020.985	5.458.158.378
Rücknahme des Swing Pricing		-	755.316	2.026.621
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres (nach Rücknahme des Swing Pricing)		12.836.801	3.832.776.301	5.460.184.999
Währungsberichtigung		-	(119.893.712)	311.450.045
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres		14.154.214	3.077.700.652	3.832.776.301
Swing Pricing	15	-	-	(755.316)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres (nach Swing Pricing)	15	14.154.214	3.077.700.652	3.832.020.985

### Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss

zum 30. September 2023

#### 1. Columbia Threadneedle (Lux) III, (DER "FONDS")

Der Fonds ist eine Kapitalanlagegesellschaft mit variablem Grundkapital (Société d'Investissement à Capital Variable, SICAV) und erfüllt die Voraussetzungen für eine luxemburgische Investmentgesellschaft. Der Fonds ist nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg als Organismus für gemeinsame Anlagen gemäß Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner geänderten Fassung (das "Gesetz") eingetragen.

Carne Global Fund Managers (Luxembourg) S.A. wurde vom Verwaltungsrat des Fonds im Rahmen eines Vertrags vom 1. Oktober 2021 zur Verwaltungsgesellschaft (die "Verwaltungsgesellschaft") ernannt. Die Liste der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Investmentfonds ist auf Anfrage am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine nach luxemburgischem Recht errichtete Société Anonyme mit der Registernummer B 148258, die als Verwaltungsgesellschaft für in Luxemburg zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 zugelassen ist. Die Verwaltungsgesellschaft agiert als OGAW-Verwaltungsgesellschaft für mehrere in Luxemburg zugelassene OGAW. Sie fungiert auch als Verwalter alternativer Investmentfonds. Der eingetragene Sitz der Verwaltungsgesellschaft befindet sich in 3, rue Jean Piet, L-2350 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.

Der Verwaltungsrat des Fonds (der "Verwaltungsrat" oder jeweils ein "Verwaltungsratsmitglied") hat den Verhaltenskodex der ALFI übernommen, der die Grundsätze der guten Unternehmensführung beinhaltet, und ist der Auffassung, dass der Fonds im Geschäftsjahr zum 30. September 2023 die Verhaltensregeln in allen wesentlichen Punkten beachtet hat.

#### 2. WESENTLICHE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

#### Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss wurde gemäß den Bilanzierungsvorschriften der luxemburgischen Aufsichtsbehörden und den luxemburgischen allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung ("GAAP") erstellt.

#### Konsolidierter Abschluss

Der konsolidierte Abschluss wurde in Euro, der funktionalen Währung des Fonds, vorgelegt. Bei Portfolios, die auf eine andere Währung als den Euro lauten, wurde für die Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen der durchschnittliche Wechselkurs verwendet. Für die Zusammensetzung des Nettofondsvermögens wurde der zum Berichtsdatum geltende Wechselkurs verwendet.

#### Anlagen

Gemäß dem Verkaufsprospekt und zum Zwecke der Berechnung des Nettoinventarwerts, der Zeichnungen und Rücknahmen zugrunde liegt, werden die börsennotierten und die an einem anderen geregelten Markt gehandelten Anlagen auf Grundlage der zuletzt verfügbaren Kurse am 30. September 2023 bewertet.

Wertpapiere, die nicht börsennotiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, Wertpapiere, die so notiert oder gehandelt werden, deren letzter Verkaufskurs jedoch nicht verfügbar ist, und Wertpapiere, deren letzter Verkaufskurs nicht repräsentativ für den angemessenen Marktwert ist, werden auf der Grundlage vereinbarter Preise und des realistischerweise zu erwartenden und mit Vorsicht und in gutem Glauben bestimmten Veräußerungswertes durch den Verwaltungsrat auf den Rat des Anlageverwalters hin bewertet. Käufe und Verkäufe von Anlagen werden am Handelstag verbucht. Gewinne oder Verluste aus Verkäufen von Anlagen werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises berechnet und enthalten Transaktionskosten.

#### Erträge aus Anlagen

Dividenden werden dem Einkommen abzüglich nicht erstattungsfähiger Quellensteuern an dem Datum gutgeschrieben, an dem die betreffenden Wertpapiere "ex-Dividende" erklärt werden.

#### Fremdwährungsumrechnung

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die Berichtswährungen des Portfolios lauten, wurden zu den am 30. September 2023 geltenden Wechselkursen umgerechnet. Die Kosten für Investitionen, Erträge und Aufwendungen, die auf andere Währungen als die Berichtswährung der Portfolios lauten, wurden zu den am Transaktionstag geltenden Wechselkursen umgerechnet. Währungsgewinne bzw. -verluste aus der Umrechnung von Devisen werden bei der Bestimmung des Betriebsergebnisses berücksichtigt. Der durchschnittliche USD/EUR-Wechselkurs während des Geschäftsjahres betrug 0,937460. Der USD/EUR-Wechselkurs zum 30. September 2023 betrug 0,944510.

#### Portfolioübergreifende Anlagen

Zum 30. September 2023 gab es keine übergreifenden Anlagen.

#### Terminkontrakte auf Wertpapiere und Indizes

Beim Abschluss von Termingeschäften erfolgen Einschusszahlungen, die in bar oder in Form von Wertpapieren geleistet werden. In dem Jahr, in dem ein Terminkontrakt offensteht, werden Wertveränderungen des Kontrakts als nicht realisierte Gewinne oder Verluste täglich nach der Marktbewertungsmethode ausgewiesen, sodass der Marktwert des Kontrakts am Ende des jeweiligen Handelstags widergespiegelt wird. Je nachdem, ob nicht realisierte Verluste oder Gewinne entstanden sind, werden Nachschusszahlungen geleistet oder entgegengenommen. Wenn der Kontrakt glattgestellt wird, verbucht der Fonds einen realisierten Gewinn oder Verlust in Höhe der Differenz zwischen den Erlösen aus der Glattstellungstransaktion (oder deren Kosten) und dem Einstandspreis des Fonds.

zum 30. September 2023

#### Devisenterminkontrakte

Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten entspricht der Differenz zwischen dem Preis des Kontrakts und dem Preis, zu dem der Kontrakt glattgestellt wird. Der realisierte Gewinn oder Verlust umfasst auch Nettogewinne oder -verluste aus Devisenterminkontrakten, die durch andere Kontrakte mit dem gleichen Kontrahenten ausgeglichen wurden.

#### Gekaufte und verkaufte Optionen

Die für gekaufte Optionen gezahlte Prämie wird als Anlage erfasst und anschließend an den aktuellen Marktwert der Option angepasst. Gezahlte Prämien für den Kauf nicht ausgeübter verfallender Optionen werden am Fälligkeitstermin als realisierte Verluste behandelt. Bei Ausübung einer gekauften Put-Option wird zur Ermittlung eines vom betreffenden Portfolio gegebenenfalls realisierten Gewinns oder Verlusts die Prämie von den Erlösen aus dem Verkauf der zugrunde liegenden Wertpapiere, Fremdwährungs- oder Indexpositionen abgezogen. Bei Ausübung einer gekauften Kaufoption erhöht die Prämie die Kostenbasis der vom Portfolio erworbenen Wertpapiere, Fremdwährungs- oder Indexpositionen.

Bei einer gezeichneten Option wird ein Betrag in Höhe der vom betreffenden Portfolio empfangenen Prämie als Verbindlichkeit ausgewiesen und anschließend an den laufenden Marktwert der verkauften Option angepasst. Empfangene Prämien für nicht ausgeübte verfallende verkaufte Optionen werden vom betreffenden Portfolio am Fälligkeitstermin als realisierte Gewinne behandelt. Wird eine verkaufte Kauf-Option ausgeübt, wird die Prämie zur Ermittlung eines vom betreffenden Portfolio gegebenenfalls realisierten Gewinns oder Verlusts den Erlösen aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers zugeschlagen. Wird eine verkaufte Verkaufsoption ausgeübt, verringert die Prämie die Kostenbasis des vom betreffenden Portfolio gekauften Wertpapiers.

#### Future-Style-Optionen

Bei Optionen auf Futures ist keine Premium Margin erforderlich, da eine tägliche Gewinn- und Verlustanpassung (Nachschusszahlung) nach der sogenannten Marktbewertungsmethode erfolgt. Der Gewinn einer Vertragspartei ist der Verlust der anderen Partei. Die daraus resultierenden Gewinne und Verluste werden im Rahmen des Marktbewertungsverfahrens täglich dem entsprechenden Konto belastet bzw. gutgeschrieben. Die endgültige Bewertung erfolgt zum Schlussabrechnungskurs, entweder zum Ablaufdatum der Option oder zum Tag der Ausübung.

#### Swapkontrakte

Der Fonds kann Swaps eingehen, bei denen der Fonds und die Gegenpartei den Tausch von Zahlungsströmen (periodisch während der gesamten Dauer des Vertrags) vereinbaren, wobei eine oder beide Parteien die Erträge aus Wertpapieren, Indizes, Rohstoffen oder anderen Instrumenten auf einen vereinbarten Nennbetrag zahlt bzw. zahlen. Die betreffenden Indizes umfassen u. a. Währungen, Zinssätze, Preise und Gesamtrenditen auf Zins-, Renten- und Aktienindizes. Swaps werden zu ihrem beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage der zugrunde liegenden Wertpapiere (zum Geschäftsschluss oder innerhalb eines Tages) sowie der Merkmale der zugrunde liegenden Verpflichtungen bewertet.

#### Barmittel und Barmitteläquivalente

Zahlungsmittel und andere liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls zuzüglich aufgelaufener Zinsen, bewertet. Auf Überziehungskredite fallen ebenfalls Zinsen an. Alle Bankguthaben werden entweder bei State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, oder als täglich fällige Einlagen bei dritten Instituten, die vom Verwaltungsrat genehmigt wurden, oder direkt bei Unterverwahrstellen gehalten. Die Barsicherheiten im Zusammenhang mit den Terminkontrakten, Swaps, Devisentermingeschäften und Optionen sind in der Nettovermögensaufstellung unter "Guthaben bei Brokern" und "Verbindlichkeiten gegenüber Brokern" ausgewiesen.

#### Erträge und Forderungen aus Wertpapierleihgeschäften

Der Fonds kann die Wertpapiere seines Portfolios an spezialisierte Banken und Kreditinstitute und andere erstklassige Finanzinstitute sowie an hoch qualifizierte eingetragene Broker/Händler oder über anerkannte Clearinginstitute wie Clearstream oder Euroclear verleihen, sofern die Bestimmungen im CSSF-Rundschreiben 08/356 eingehalten werden. Die Wertpapierleihe ist ständig durch anerkennungsfähige Sicherheiten gedeckt, die jeweils von der CSSF zugelassen werden. Die Sicherheiten müssen während der gesamten Laufzeit des Leihgeschäfts mindestens dem Wert der globalen Bewertung der verliehenen Wertpapiere entsprechen. Jeder Kontrahent verfügt über ein branchenübliches Bonitätsrating, das für den Anlageverwalter im Hinblick auf die zum jeweiligen Zeitpunkt herrschenden Marktbedingungen akzeptabel ist.

Gesamtbetrag der "Erträge aus Wertpapierleihgeschäften": 69.500 EUR

Gesamtbetrag der "Forderungen aus Wertpapierleihgeschäften": 2.112 EUR

Zum 30. September 2023 ist der Gesamtbetrag der "Forderungen aus Wertpapierleihgeschäften" in den "sonstigen Aktiva" enthalten.

#### Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs

Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs beinhaltet die Abschreibung und den Zuwachs von Agios/Disagios sowohl von lang- als auch kurzfristigen festverzinslichen Wertpapieren. Zinserträge (abzüglich nicht erstattungsfähiger Quellensteuern) laufen täglich auf und beinhalten die Abschreibung von Aufschlägen und den Zuwachs von Abschlägen. Alle Komponenten werden saldiert und in der Gewinn- und Verlustrechnung als positive Summe unter der Ertragsposition "Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs" und als negative Summe unter der Aufwandsposition "Netto-Abschreibung / Netto-Zuwachs" ausgewiesen. Die Netto-Abschreibungen/Netto-Zuwächse werden auf linearer Basis berechnet.

zum 30. September 2023

#### 3. AUSGLEICH

Der Fonds befolgt die als "Ausgleich" bezeichnete Buchführungspraxis, bei der ein Teil des Ausgabe- und Rücknahmepreises, der auf Anteilsbasis aufgelaufene ausschüttbare Anlageerträge (ohne Berücksichtigung von Kapitalerträgen oder -verlusten) darstellt, dem ausschüttbaren Ertrag zugeschlagen oder belastet wird. Die Beträge, die diesem Ertragsausgleichskonto zuzurechnen sind, werden im Rahmen der Zeichnungserlöse für die Anteile des Fonds oder im Rahmen der Zahlungen für zurückgenommene Anteile des Fonds und im Nettoausgleich, im Abschnitt "Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen" ausgewiesen.

#### 4. ANLAGEVERWALTUNGSGEBÜHREN

Der Fonds hat mit der Verwaltungsgesellschaft und Columbia Threadneedle Management Limited ("CTML") einen Vertrag geschlossen, wonach CTML zum Anlageverwalter des Fonds ernannt wird und dafür eine monatliche Gebühr erhält, die auf den durchschnittlichen Nettoinventarwert jedes der folgenden, von ihm verwalteten Portfolios im vorhergehenden Monat nach folgenden Sätzen berechnet wird:

Portfolio	Anlageverwaltungsgebühren pro Jahr
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	1,500 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - Euro	1,500 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	1,500 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	0,200 %
CT (Lux) Euro Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,250 %
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	1,500 %
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	1,500 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro	1,500 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	0,750 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	0,750 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	0,750 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged)	0,200 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,400 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged)	0,400 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	0,400 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - USD (Hedged)	0,400 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged)	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - GBP	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond Hong Kong - Anteile Klasse A - USD	1,000 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - CHF (Hedged)	0,650 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro	0,650 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)	0,650 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged)	0,650 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	0,650 % 1,500 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Antelle Klasse A Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Antelle Klasse A Acc - USD	1,500 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Antelle Klasse A - 00D	0,750 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,400 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	0,400 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged)	0,400 %
CT (Lux) Plus II - Anteile Klasse I Acc - Euro*	0,250 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	0,200 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse I - Euro	0,250 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,250 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,500 %

# Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) zum 30. September 2023

#### Portfolio

Anlageverwaltungsgebühren pro Jahr

	1
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A ACC - 03D	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A COD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Rasse FAcc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Riasse FAcc - CHF	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Inc - USD	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - SEK	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - Euro	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Inc - Euro	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Inc - USD	1,500 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XP Inc - Euro	0,750 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR Inc - Euro	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	1,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	1,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP (Hedged)	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	0,750 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	1,400 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - USD	1,400 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - CHF (Hedged)	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - Euro (Hedged)	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - GBP (Hedged)	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - USD (Hedged)	0,500 %
Crictary Cool Engagement Clobal Equity Antonio Hiddeo Ar Abb (Clobaged)	0,000 /0

# Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung) zum 30. September 2023

Portfolio	Anlageverwaltungsgebühren pro Jahr
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Portfolio - CHF (Hedged)	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	0,500 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	0,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc Portfolio - CHF (Hedged)*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc Portfolio - Euro (Hedged)*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - USD*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Inc Portfolio - CHF (Hedged)*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Inc Portfolio - Euro (Hedged)*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Inc - Euro*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Inc - USD*	1,500 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc Portfolio - Euro (Hedged)*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - USD*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Inc Portfolio - Euro (Hedged)*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Inc - Euro*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Inc - USD*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Acc - Euro*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Inc - Euro*	0,750 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP Inc Portfolio - CHF (Hedged)*	0,400 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP Inc Portfolio - Euro (Hedged)*	0,400 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP Inc - USD*	0,400 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc Portfolio - CHF (Hedged)*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc Portfolio - Euro (Hedged)*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - USD*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Inc Portfolio - CHF (Hedged)*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Inc Portfolio - Euro (Hedged)*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Inc Portfolio - GBP (Hedged)*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Inc - USD*	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,250 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged) CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Inc - Euro	1,250 %
	1,250 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Acc - Euro CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Inc - Euro	0,400 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Antelle Klasse F Inc - Euro	0,400 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Antelle Klasse I Acc - Euro	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse Thic - Euro	0,600 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R Acc - Euro	0,600 % 0,600 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset income - Antelle Masse R inc - Euro CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Antelle Klasse A Acc - Euro	1,250 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	1,250 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse F Acc - Euro	0,200 %
ST LEAN SASSAINAND OPPORTUNITO EUROPOUL EURIT - AITONO NIGOU F AUG - EUR	0,200 /0

zum 30. September 2023

Anlageverwaltungsgebühren pro Jahr

CT (Lux) US Smaller Companies - Anteile Klasse A - USD

1,500 %

\*Siehe Anhang I.

Portfolio

CTML ist ein in England gegründetes Unternehmen und untersteht der Aufsicht der Financial Conduct Authority ("FCA").

Für den CT (Lux) Global Convertible Bond hat CTML die Verwaltungsaufgaben an Columbia Threadneedle Netherlands B.V. übertragen.

Für den CT (Lux) US Smaller Companies hat CTML die Verwaltungsaufgaben an Columbia Management Investment Advisers, LLC übertragen.

Für Anteile der Klasse X und der Klasse L (sofern vorhanden) ist keine Anlageverwaltungsgebühr zu zahlen.

Der/die Anlageverwalter hat/haben nach eigenem Ermessen die Aufwendungen für einige Anteilsklassen begrenzt. In Fällen, in denen die Aufwendungen die Obergrenze überschreiten, erstattet/erstatten der/die Anlageverwalter den Fonds. Die dem Fonds zurückerstatteten Beträge sind in der Nettovermögensaufstellung und in der Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen unter "Verzicht auf Anlageverwaltungsgebühren" ausgewiesen.

#### 5. VERWALTUNGS- UND VERWAHRSTELLENGEBÜHREN

State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, (die "Verwahrstelle") hat Anspruch auf vom Fonds zu zahlende Gebühren, die täglich auflaufen und monatlich rückwirkend zu zahlen sind. Die Gebühren belaufen sich auf bis zu 0,50 % der verwahrten Vermögenswerte zuzüglich einer Transaktionsgebühr für ihre Funktion als Verwahrstelle des Fonds. Die tatsächliche Höhe der für die Verwahrungsdienste zu entrichtenden Gebühren und Transaktionsentgelte variiert je nach Land. Darüber hinaus wird State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, für ihre Tätigkeit als Register-, Transfer-, Domizil-, Zahl- und Verwaltungsstelle des Fonds Anspruch auf Gebühren in Höhe von bis zu 0,045 % des bestehenden Nettoinventarwerts zuzüglich einer Transaktionsgebühr haben.

Außerdem ist State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, berechtigt, Gebühren auf den Fonds abzuwälzen, die von externen Kursanbietern berechnet werden, wenn die Kosten der Erlangung der Kurse vom Anbieter nicht im festen Standard-Prozentsatz von State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, für die Fondsbuchhaltung enthalten sind.

#### 6. VERGÜTUNG DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER

Jedes Verwaltungsratsmitglied des Fonds hat Anspruch auf eine Vergütung für seine Dienstleistungen, die zum jeweiligen Zeitpunkt durch die Hauptversammlung des Fonds festgelegt wird. Diejenigen Verwaltungsratsmitglieder des Fonds, die Angestellte von Columbia Threadneedle Management Limited (der Muttergesellschaft des Anlageverwalters) oder einer seiner Tochtergesellschaften sind, verzichten auf ihre Vergütungen für die Ausübung ihrer Verpflichtungen als Verwaltungsratsmitglied des Fonds. Die Verwaltungsratsgebühren sind an die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder zu zahlen und auf Basis ihres durchschnittlichen Nettovermögens auf die Portfolios aufzuteilen. Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 hat der Vorsitzende Patrick Johns Anspruch auf eine Gebühr von 27.000 EUR pro Jahr. Die Verwaltungsratsmitglieder Jacques Elvinger und Ailbhe Jennings haben Anspruch auf eine Gebühr von 22.000 EUR pro Jahr. Darüber hinaus können jedem Verwaltungsratsmitglied angemessene Aufwendungen erstattet werden, die im Zusammenhang mit den Sitzungen des Verwaltungsrats oder anderweitig im Zusammenhang mit den Geschäften des Fonds ordnungsgemäß angefallen sind.

#### 7. VERWALTUNGSGESELLSCHAFTSGEBÜHR

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine jährliche Verwaltungsgesellschaftsgebühr, die aus dem Vermögen des Fonds zu entrichten ist und bis maximal 0,02 % des Nettoinventarwerts (auf einer gleitenden Skala, je nach Größe des Portfolios) beträgt, ohne Mindestgebühr.

#### 8. BESTEUERUNG

Der Fonds unterliegt in Luxemburg nicht der Besteuerung seines Einkommens oder seiner Gewinne. Jedoch unterliegt der Fonds in Luxemburg einer Bezugssteuer (*Taxe d'abonnement*) von 0,05 % pro Jahr auf sein Nettovermögen, die vierteljährlich entrichtet und auf der Basis des Nettogesamtvermögens des Fonds zum Ende des betreffenden Quartals errechnet wird. Der Steuersatz der jährlichen Bezugssteuer ermäßigt sich auf 0,01 % pro Jahr für die Portfolios, die gemäß Artikel 174 des Gesetzes ausschließlich in Geldmarktinstrumente entsprechend der Definition in der großherzoglichen Verordnung vom 14. April 2003 anlegen, und in Bezug auf Anteilsklassen, die nur an institutionelle Anleger verkauft und von institutionellen Anlegern gehalten werden. Auf die Ausgabe von Anteilen des Fonds ist in Luxemburg weder eine Stempelsteuer noch eine andere Abgabe zu zahlen.

Vom Fonds vereinnahmte Zins- und Dividendenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. Der Fonds kann darüber hinaus bezüglich realisierter oder nicht realisierter Kapitalwertsteigerungen seiner Vermögenswerte in den Ursprungsländern steuerpflichtig sein.

Ausschüttungen durch den Fonds unterliegen in Luxemburg keiner Quellensteuer.

Der Fonds unterliegt nicht der Vermögensteuer.

Dividenden- und Zinserträge werden in der konsolidierten Ergebnisrechnung und Veränderungen im Nettofondsvermögen netto ausgewiesen.

zum 30. September 2023

Ab dem 1. April 2007 sind die in Artikel 44, 1, d) des luxemburgischen Mehrwertsteuergesetzes genannten Anlagevehikel (SICAV, SICAF und Verwaltungsgesellschaften von FCP) als steuerpflichtige Personen für Mehrwertsteuerzwecke einzutragen. Als steuerpflichtige Personen für Mehrwertsteuerzwecke müssen diese Anlagevehikel die im luxemburgischen Mehrwertsteuergesetz vorgesehenen Standardpflichten erfüllen, wie die Eintragung für Mehrwertsteuerzwecke, die Einhaltung des Mehrwertsteuergesetzes und die Zahlung der Mehrwertsteuer, die für Dienstleistungen fällig wird, bei denen der Empfänger der Steuerschuldner ist.

Anleger werden darauf hingewiesen, dass im Vereinigten Königreich ein Gesetz für Offshore-Fonds verabschiedet wurde, das für britische Anleger gilt, die in Offshore-Fonds anlegen. Der Verwaltungsrat hat von der britischen Steuerbehörde den Status als Meldefonds für die nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen erhalten.

zum 30. September 2023

Die folgenden Anteilsklassen waren in dem Antrag enthalten (zum 30. September 2023):

CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged) CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - GBP CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse Hong Kong A - USD CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse L - Euro CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - USD CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A - USD CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I Acc - GBP CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged) CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A - USD CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - CHF CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse X - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XP Inc - Euro CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD

zum 30. September 2023



Die Verwaltungsräte beabsichtigen, den jährlichen Anlegerbericht etwa ab dem 31. März jeden Jahres über die <u>CT-Website</u> zu publizieren. (Diese Information ist ungeprüft.)

#### 9. GESCHÄFTE MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

Für bestimmte Anteilsklassen kann CTML Anspruch auf eine Platzierungs- und/oder Einführungsgebühr von höchstens 5 % des Zeichnungswertes der Anteile des Fonds haben. Ein Teil dieser Gebühr kann an Wertpapiermakler oder andere zugelassene Vermittler weitergegeben werden.

Patrick Johns (Vorsitzender) ist ein nicht der Geschäftsführung angehöriger Berater für Columbia Threadneedle Investments.

Jacques Elvinger, ein Mitglied des Verwaltungsrats des Fonds, ist ein Partner der Luxemburger Anwaltskanzlei Elvinger, Hoss & Prussen, société anonyme. Herr Elvinger ist seit 1984 Avocat à la Cour in Luxemburg.

zum 30. September 2023

Ailbhe Jennings, ein Verwaltungsratsmitglied des Fonds, ist nicht geschäftsführender Berater von Columbia Threadneedle Investments, einer Tochtergesellschaft von Columbia Threadneedle Management Limited.

Rogier van Harten, Verwaltungsratsmitglied des Fonds, ist Head of Institutional Distribution for Continental Europe bei Columbia Threadneedle Netherlands B.V, einer Tochtergesellschaft von Columbia Threadneedle Investments.

Tina Watts, ein Verwaltungsratsmitglied des Fonds, ist EMEA Head of Fund Services & CASS bei Columbia Threadneedle Investments.

Der Fonds hat einen Agenturvertrag über die Verleihung von Wertpapieren gegen eine Leihgebühr abgeschlossen. Im Berichtsjahr erhielt State Street Bank International GmbH (Niederlassung London) 13.900 EUR als Wertpapierleihbeauftragter. Die Anlageverwalter erhielten für die Kontrolle und Überwachung des Wertpapierleihprogramms 9.267 EUR.

Den folgenden Portfolios wurden keine Marketingkosten oder Vertriebsgebühren in Rechnung gestellt:

CT (Lux) Euro Bond CT (Lux) Plus II\*

\* Siehe Anhang I.

Alle Kosten, die gegebenenfalls im Zusammenhang mit diesen Portfolios/Anteilsklassen entstehen, werden von CTML getragen.

CTML kann bestimmte Kosten im Zusammenhang mit der Vermarktung des Fonds auf den Fonds abwälzen. In einer Rechnungsperiode können bis zu 0,025 % des Nettoinventarwerts des Fonds oder des/der jeweiligen Portfolios berechnet werden.

CTML kann ferner eine Gebühr für den Fonds zur Deckung der Vertriebskosten des Fonds in den verschiedenen Hoheitsgebieten erheben, in denen er registriert ist. In einer Rechnungsperiode dürfen höchstens 0,05 % des Nettoinventarwerts des Fonds oder des/der jeweiligen Portfolios berechnet werden.

Den Hongkonger Anteilsklassen eines Portfolios werden keine Marketingkosten oder Vertriebsgebühren in Rechnung gestellt. Alle Kosten, die gegebenenfalls im Zusammenhang mit dem Vertrieb der Hongkonger Anteilsklassen entstehen, werden von CTML getragen.

CTML hat Anspruch auf eine jährliche Servicegebühr von 0,015 % der Aktien- und Anleihenanlagen der Portfolios unter Verwendung seiner "Responsible Engagement Overlay"-Dienstleistungen wie im Verkaufsprospekt beschrieben. Diese Dienstleistung wird den Hongkonger Anteilsklassen jedes Portfolios nicht in Rechnung gestellt.

#### **10. VERÄNDERUNGEN IM VERMÖGEN**

Eine Aufstellung, aus der sich die gesamten Käufe und Veräußerungen in Bezug auf jedes Portfolio im Berichtsjahr ergeben, ist auf Anfrage am eingetragenen Sitz des Fonds sowie beim Registerführer, bei der Verwaltungs- oder Verwahrstelle oder bei der Zahlstelle des jeweiligen Landes erhältlich.

#### 11. PERFORMANCEVERGÜTUNG

Während des Geschäftsjahres wurde für die Portfolios keine Performancevergütung erhoben.

#### 12. SOFT-COMMISSION-VEREINBARUNGEN UND ÄHNLICHE VEREINBARUNGEN

Seit der Umsetzung der MiFID II im Januar 2018 wurden alle von den Teams im Bereich EMEA in Anspruch genommenen externen Investmentanalysen direkt von Columbia Threadneedle Investments bezahlt. Die Verwendung von Provisionsteilungsvereinbarungen wurde Ende Dezember 2017 eingestellt. Seitdem fallen in den Kundenportfolios nur noch ausführungsbezogene Provisionskosten an.

#### **13. WERTPAPIERLEIHE**

Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird auf einem angemessenen Niveau gehalten. Der Fonds ist berechtigt, die Rückgabe von verliehenen Wertpapieren zu fordern, um seine Rücknahmeverpflichtungen erfüllen zu können. Es wird sichergestellt, dass die Wertpapierleihgeschäfte nicht die Verwaltung des Fondsvermögens gemäß der Anlagepolitik gefährden.

Die Erträge aus Wertpapierleihprogramm sind in der Ergebnisrechnung und den Veränderungen im Nettofondsvermögen nach Gebühren ausgewiesen.

State Street Bank International GmbH, Niederlassung London erhält als mit der Wertpapierleihe beauftragte Stelle eine Gebühr in Höhe von 15 % für ihre Dienstleistungen. Der Anlageverwalter erhält in seiner Eigenschaft als Koordinator der Wertpapierleihgeschäfte des Fonds eine Verwaltungsgebühr in Höhe von 10 % zur Deckung der Betriebskosten. Es gibt keine verborgenen Erträge. Dementsprechend erhält der Fonds 75 % des Bruttoertrags aus Wertpapierleihgeschäften. Es ist die Politik des Anlageverwalters, alle Erträge abzüglich der direkten und indirekten Betriebskosten wieder im Fonds anzulegen.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

zum 30. September 2023

Die nachstehende Tabelle zeigt den Marktwert der verliehenen Wertpapiere sowie den Marktwert der zum 30. September 2023 gehaltenen Sicherheiten. Die zu diesem Zeitpunkt gehaltenen Sicherheiten entsprachen einer Deckung von 104,00 %.

Portfolio	Marktwert der verliehenen Wertpapiere in EUR	Marktwert der gehaltenen Sicherheiten in EUR	Art der gehaltenen Sicherheiten
CT (Lux) Diversified Growth	3.314.067	3.485.574	Staatsanleihen
CT (Lux) European Growth & Income	158.350	172.437	Staatsanleihen
CT (Lux) European Smaller Cap	783.443	839.845	Staatsanleihen
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	3.160.158	3.225.853	Staatsanleihen
CT (Lux) Global Total Return Bond	648.958	662.459	Staatsanleihen
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	943.155	962.653	Staatsanleihen
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	5.758.920	6.051.888	Staatsanleihen
	14.767.051	15.400.709	

Die Kontrahenten bei Wertpapieren waren: Barclays Capital Securities Ltd., BNP Paribas Arbitrage SNC, Citigroup Global Markets Ltd., Goldman Sachs International, HSBC Bank Plc., JP Morgan Securities Plc., Macquaire Bank Limited, Merrill Lynch International, Morgan Stanley & Co. International Plc. und Societe Generale S.A.

# 14. AUSSCHÜTTUNG VON DIVIDENDEN

Während des Berichtszeitraums zahlte der CT Sustainable Multi-Asset Income Fund, dessen Ex-Dividendentag der 13. Dezember 2022 war, am 15. Dezember 2022 die folgenden Dividenden an die Anteilsinhaber aus.

Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Dividende pro Anteil	An die Anteilsinhaber ausgeschüttete Dividenden
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	13,8800	1.138.989
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	Euro	0,1000	10
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	Euro	15,7100	5.546
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,1000	451

In dem zum 30. September 2023 endenden Geschäftsjahr wurden die Dividenden mit Ex-Dividendentag am 17. Januar 2023 wie folgt am 31. Januar 2023 an die Anteilsinhaber ausgezahlt:

			An die Anteilsinhaber
Bezeichnung der Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Dividende pro Anteil	ausgeschüttete Dividenden
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	0,2465	39.193
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	GBP	0,2716	344.873
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	Euro	0,0740	446
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,0360	1.083
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged)	USD	0,1933	5.704
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	Euro	0,0590	543.778
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged)	GBP	0,0988	382.402
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	Euro	0,0895	705.429
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	GBP	0,0436	4.812
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	USD	0,7790	9.416
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	GBP	0,0220	8.398
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,0146	73.315
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR - Euro	Euro	0,0380	869.036
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	GBP	0,0434	129.671
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	CHF	0,0951	25.465
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)	CHF	0,0975	58.117
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	0,2723	0
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse ID Acc - Euro	Euro	0,0000	64.550

# Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

zum 30. September 2023

In dem zum 30. September 2023 endenden Geschäftsjahr wurden die Dividenden mit Ex-Dividendentag am 20. Januar 2023 wie folgt am 31. Januar 2023 an die Anteilsinhaber ausgezahlt:

	Währung der		An die Anteilsinhaber usgeschüttete
Bezeichnung der Anteilsklasse	Anteilsklasse	pro Anteil	Dividenden
CT (Lux) Responsible Global Emerging Market Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	0,0347	171.106
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	GBP	0,0467	17.865
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,1004	505.315
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	GBP	0,0314	94.143

In dem zum 30. September 2023 endenden Geschäftsjahr wurden die Dividenden mit Ex-Dividendentag am 27. Juni 2023 wie folgt am 29. Juni 2023 an die Anteilsinhaber ausgezahlt:

	Währung der	Dividende	An die Anteilsinhaber ausgeschüttete
Bezeichnung der Anteilsklasse	Anteilsklasse	pro Anteil	Dividenden
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	12,0600	77.730
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	Euro	0,1200	104
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	Euro	13,7400	353
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,1200	2.722

Für alle ausschüttenden Anteilsklassen, die für den Status als Meldefonds registriert sind, sollen 100 % der für das Portfolio oder die ausschüttenden Klassen anfallenden meldepflichtigen Erträge ausgeschüttet werden (die in Übereinstimmung mit der Definition von meldepflichtigen Erträgen in den United Kingdom Offshore Funds [Tax] Regulations 2009 in ihrer jeweils gültigen Fassung berechnet werden). Dies kann jedoch nicht garantiert werden. Es ist möglich, dass der Verwaltungsrat in bestimmten Fällen der Ansicht ist, dass die zur Ausschüttung verfügbaren Beträge so gering sind, dass eine Ausschüttung wirtschaftlich nicht sinnvoll ist. Wenn Anteilsklassen nicht den Status eines britischen Meldefonds haben, legt der Verwaltungsrat eine alternative Basis für die Ermittlung einer Dividende fest.

Der Verwaltungsrat kann beschließen, einmal im Jahr oder häufiger Dividenden an die Anteilsinhaber auszuschütten, jedoch unter der Bedingung, dass das gesamte Nettovermögen des Fonds infolge dieser Ausschüttungen nicht unter den nach Luxemburger Recht erforderlichen Mindestwert fällt.

## **15. SWING PRICING**

Unter bestimmten Umständen (beispielsweise bei großem Handelsvolumen) können sich die Investitions- und/oder Deinvestitionskosten negativ auf die Beteiligungen der Anteilsinhaber an einem Portfolio auswirken. Zur Verhinderung dieses Effekts, der als "Verwässerung" bezeichnet wird, kann der Verwaltungsrat festlegen, dass eine "Swing Pricing"-Methode angewendet wird, die es ermöglicht, den Nettoinventarwert pro Anteil nach oben oder unten um Handels- und sonstige Kosten sowie Steuerabgaben anzupassen, die im Rahmen des wirksamen Kaufs oder Verkaufs von Vermögenswerten des entsprechenden Portfolios anfallen, falls die Nettokapitalaktivität infolge der gesamten Geschäfte innerhalb dieses Portfolios an einem bestimmten Bewertungstag einen von Zeit zu Zeit durch den Verwaltungsrat festgesetzten Grenzwert (der "Grenzwert") überschreitet.

### **Beschreibung der Swing-Pricing-Methode:**

Falls die Nettokapitalaktivität an einem bestimmten Bewertungstag zu einem Aktivaabgang/-zugang führt, der oberhalb des Grenzwerts für das entsprechende Portfolio liegt, wird der Nettoinventarwert, auf dessen Grundlage alle Zeichnungs-, Rücknahmeoder Umtauschvorgänge für dieses Portfolio erfolgen, um den Swing-Faktor, der vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgesetzt wird, nach oben/unten korrigiert.

Der Swing-Faktor beträgt nicht mehr als 2 % des Nettoinventarwerts pro Anteil des entsprechenden Portfolios. Darüber hinaus nutzt die Verwaltungsstelle zum Zwecke der Berechnung der Ausgaben eines Portfolios auf der Grundlage des Nettoinventarwerts des entsprechenden Portfolios (einschließlich ggf. anfallender Erfolgsgebühr wie im Prospekt beschrieben) auch weiterhin den Nettoinventarwert ohne Swing-Korrektur.

Der Swing-Pricing-Mechanismus wurde während des Geschäftsjahres bei allen Teilfonds angewendet.

# **16. TRANSAKTIONSKOSTEN**

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 sind für die folgenden Teilfonds des Columbia Threadneedle (Lux) III folgende Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf und der Veräußerung von übertragbaren Wertpapieren angefallen:

Portfolio	Währung des Portfolios	Transaktionskosten
CT (Lux) Diversified Growth	EUR	62.714
CT (Lux) Euro Bond	EUR	0
CT (Lux) European Growth & Income	EUR	18.802
CT (Lux) European Smaller Cap	EUR	4.008
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	EUR	0

# Columbia Threadneedle (Lux) III Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

zum 30. September 2023

Portfolio	Währung des Portfolios	Transaktionskosten
CT (Lux) Global Convertible Bond	EUR	6
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity	USD	1.363
CT (Lux) Global Total Return Bond	EUR	0
CT (Lux) Plus II	EUR	14.868
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	EUR	0
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	USD	626.453
CT (Lux) Responsible Global Equity	EUR	529.680
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity	USD	638.331
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income *	USD	483.217
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income	EUR	27.102
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity	EUR	5.249
CT (Lux) US Smaller Companies	USD	11.032

<sup>\*</sup>Siehe Anhang I.

Diese Transaktionskosten entsprechen den Maklergebühren und sind im Abschnitt "Wertpapierbestand zu Einstandskosten" in der Aufstellung des Nettovermögens des Finanzberichts sowie jeweils in den Abschnitten "Realisierter Nettogewinn / -verlust aus Wertpapierverkäufen" und "Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Anlagen" in der Ergebnisrechnung und den Veränderungen im Nettofondsvermögen enthalten.

## 17. Bedeutendes Ereignis

### Auswirkungen des Russland-Ukraine-Konflikts

Die Ereignisse, die zu Beginn des Jahres 2022 in der Ukraine ihren Anfang nahmen, dauern an und haben Wertpapiere beeinträchtigt, die mit Unternehmen in Verbindung stehen, die in Russland ansässig oder mit diesem Land verbunden sind und/oder an Börsen in Russland notiert sind, beispielsweise der Moskauer Börse ("russische Wertpapiere").

Der CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity hält eine Anlage, Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC, die in Russland engagiert ist. Dieser Titel machte 0,63 % des CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity aus, bevor er im März 2022 auf null herabgeschrieben wurde. Dieses Wertpapier wird zum 30. September 2023 weiterhin mit null bewertet.

Zu den Russland auferlegten Sanktionen gehören sektorbezogene Finanz- und Anlagebeschränkungen, durch die bestimmte Aktivitäten eingeschränkt sind. Dazu gehören Beschränkungen für den Handel mit übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten. Der Verwaltungsrat hat State Street als Verwaltungsstelle mit der weltweiten Überwachung der Sanktionsaktivitäten beauftragt, um deren Einhaltung durch die Portfolios zu gewährleisten. Die Verwaltungsstelle überwacht weiterhin die Anlegerbasis in Bezug auf Sanktionen. Wenn sanktionierte Anleger identifiziert werden, informiert die Verwaltungsstelle den Verwaltungsrat, den Geldwäschebeauftragten der Gesellschaft, den Manager und den Anlageverwalter und sorgt für Abhilfe gemäß den entsprechenden Richtlinien und Verfahren.

# **18. EREIGNISSE NACH DEM ABSCHLUSSSTICHTAG**

Es sind keine nachfolgenden Ereignisse geplant.

## **19. MITTEILUNG AN DIE ANLEGER**

Die Angaben im Rahmen der Offenlegungsverordnung sind im Anhang zu den Jahresabschlüssen zu finden.

## 20. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Verwaltungsrat hat den Jahresabschluss am 22. Januar 2024 genehmigt.

## 21. NEUVERÖFFENTLICHUNG DES JAHRESABSCHLUSSES

Am 30. Januar 2024 genehmigte der Verwaltungsrat die Neuveröffentlichung des Jahresabschlusses für das zum 30. September 2023 beendete Geschäftsjahr, um die regelmäßigen Angaben gemäß der Offenlegungsverordnung für den Teilfonds CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity Fund in Anhang II, "Regelmäßige Angaben gemäß Offenlegungsverordnung (ungeprüft)", auf den Seiten 173 bis 247 des vorliegenden Berichts aufzunehmen. Dieser neue Abschluss ersetzt den zuvor vom Verwaltungsrat am 22. Januar 2022 genehmigten Abschluss.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Zusätzliche Erläuterungen (ungeprüfte Abschnitte)

zum 30. September 2023

# **1. SOZIAL VERANTWORTLICHES INVESTIEREN**

CTML ist davon überzeugt, dass Anleger sich in zunehmendem Maße für ökologische, gesellschaftliche und führungsbezogene Themen (ESG) interessieren, und dass diese sich wesentlich auf die Unternehmen, in die wir investieren, auswirken können. Dementsprechend hat der Fonds CTML damit beauftragt, mit den von den Portfolios gehaltenen Unternehmen zusammenzuarbeiten, um die ESG-Performance zu verbessern und den Wert der Anlagen zu schützen. Der Responsible Engagement Overlay-Service, der unter der Marke reo® angeboten wird, zielt darauf ab, Unternehmen zu einem verantwortungsvolleren Verhalten in Bezug auf Unternehmensführung, soziale und ökologische Praktiken anzuhalten, und zwar in einer Weise, die mit den Werten der Aktionäre vereinbar ist. Das Ziel von reo® besteht darin, die Beteiligungsunternehmen zu einer Verbesserung ihrer Geschäftsleistung durch die Einführung besserer Verfahren in den Bereichen Unternehmensführung, Soziales und Umwelt anzuhalten. reo® ist nicht dazu gedacht, Stellung zur Angemessenheit dessen zu nehmen, was ein Beteiligungsunternehmen tu oder nicht tut, und führt nicht dazu, dass ein erheblicher Einfluss auf die Geschäftsführung dieser Unternehmenausgeübt wird. Bei reo® geht es darum, die Fähigkeit von CTML in seiner Rolle als Verwalter des Fonds- und Anleihenportfolios in Aktien und Unternehmensnehmensführung, Soziales und Umweltbelange zu fördern. Aus Sicht von CTML kann reo® zum Geschäftserfolg und damit zum Wert der Unternehmen, in denen angelegt wird, beitragen, was letzlich den Wert der Anlagen des Fonds steigert. Weitere Informationen zu reo® und den Unternehmen, zu denen Kontakt anhand des reo®-Service aufrecht erhalten wird, finden Sie unter <u>www.columbiathreadneedle.com</u>.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Risikomanagement, Vergütung und für PEA zulässige Vermögenswerte (ungeprüft)

# RISIKOMANAGEMENT Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos

### **Commitment-Ansatz**

Die folgenden Portfolios verwenden zur Beobachtung und Messung ihres Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz:

- CT (Lux) European Growth & Income
- CT (Lux) European Smaller Companies
- CT (Lux) Global Convertible Bond
- CT (Lux) Global Smaller Companies Equity
- CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond
- CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity
- CT (Lux) Responsible Global Equity
- CT (Lux) SDG Engagement Global Equity
- CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity
- CT (Lux) US Smaller Companies

# VaR-Ansatz

Die folgenden Portfolios verwenden zur Beobachtung und Messung ihres Gesamtrisikos einen absoluten Value-at-Risk-Ansatz ("VaR"):

CT (Lux) Diversified Growth

CT (Lux) Global Absolute Return Bond

CT (Lux) Global Total Return Bond

CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income

Die VaR-Zahlen wurden auf der Grundlage der folgenden Eingabedaten und des folgenden Konfidenzintervalls berechnet:

Konfidenzintervall	99 %
Analysezeitraum	Ein Monat (20 Tage)
Zeitreihenerweiterung	1 Jahr
METHODOLOGIE	Absoluter VaR
VaR-Methode	Historische Simulation
CSSF-Limit	20 %

Die Nutzung des VaR vom 01. Oktober 2022 bis 30. September 2023 stellte sich wie folgt dar:

CT (Lux) Diversified Growth	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	3,02 %	15,12 %
Maximum	8,48 %	42,40 %
Durchschnitt	4,60 %	22,99 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 117,63 %.

CT (Lux) Global Absolute Return Bond	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	0,95 %	4,74 %
Maximum	5,09 %	25,45 %
Durchschnitt	2,81 %	14,03 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 288,93 %.

CT (Lux) Global Total Return Bond	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	1,04 %	5,20 %
Maximum	5,89 %	29,45 %
Durchschnitt	3,33 %	16,66 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 310,72 %.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Risikomanagement, Vergütung und für PEA zulässige Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	3,08 %	15,40 %
Maximum	5,13 %	25,65 %
Durchschnitt	4,44 %	22,22 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 89,08 %.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Risikomanagement, Vergütung und für PEA zulässige Vermögenswerte (ungeprüft) (Fortsetzung)

Das folgende Portfolio verwendet zur Beobachtung und Messung seines Gesamtrisikos einen relativen Value-at-Risk-Ansatz ("VaR"):

CT (Lux) Euro Bond

CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income

Die VaR-Zahlen wurden auf der Grundlage der folgenden Eingabedaten und des folgenden Konfidenzintervalls berechnet:

Konfidenzintervall	99 %
Analysezeitraum	Ein Monat (20 Tage)
Zeitreihenerweiterung	1 Jahr
METHODOLOGIE	Relativer VaR
VaR-Methode	Historische Simulation
CSSF-Limit	200 %

Die Nutzung des VaR vom 01. Oktober 2022 bis 30. September 2023 stellte sich wie folgt dar:

CT (Lux) Euro Bond	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	62,65 %	31,32 %
Maximum	100,57 %	50,28 %
Durchschnitt	86,57 %	43,29 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 22,26 %.

CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income	VaR-Werte	Auslastung des VaR-Limits
Minimum	99,72 %	49,86 %
Maximum	155,92 %	77,96 %
Durchschnitt	138,74 %	69,37 %

Der durchschnittliche verwendete Hebel betrug der Berechnung mit der Summe der Nominalwerte zufolge 20,80 %.

# Columbia Threadneedle (Lux) III **Vergütung (ungeprüft)**

## VERGÜTUNGSPOLITIK

### Carne Global Fund Managers (Luxembourg) S.A.

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik (die "Vergütungspolitik") erarbeitet und umgesetzt, die den Bestimmungen zu Vergütungen in der europäischen Richtlinie 2009/65/EG ("OGAW-Richtlinie") in der jeweils gültigen Fassung, geändert durch Richtlinie 2014/91/EU ("OGAW-V-Richtlinie"), gemäß deren Umsetzung in Luxemburg durch das Gesetz vom 10. Mai 2016 (das "Gesetz von 2016") entspricht.

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungspolitik und -praxis erarbeitet und umgesetzt, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement des Fonds vereinbar und diesem förderlich sind, die nicht zum Eingehen von Risiken ermutigen, welche nicht mit dem Risikoprofil bzw. den Regeln des Fonds vereinbar sind, und die die Verwaltungsgesellschaft nicht daran hindern, pflichtgemäß im besten Interesse des Fonds und letztlich seiner Anleger zu handeln.

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Erarbeitung, Umsetzung und regelmäßige Überprüfung der Vergütungspolitik. Bei der Überprüfung der Vergütungspolitik berücksichtigt der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft, ob die Vergütungs-Struktur bestimmungsgemäß funktioniert, und stellt sicher, dass das Risikoprofil und die langfristigen Ziele des Fonds angemessen widergespiegelt werden. Es wurden während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik vorgenommen und keine Unregelmäßigkeiten aufgedeckt. Die aktuelle Version der Vergütungspolitik ist auf der Website der Verwaltungsgesellschaft verfügbar.

# Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter des OGAW, der dem COLUMBIA THREADNEEDLE (LUX) III zum 31. Dezember 2022<sup>1</sup> zuzurechnen ist.

Der Anteil der Gesamtvergütung, der auf Columbia Threadneedle (Lux) III entfällt, wurde anteilig auf der Grundlage des verwalteten Vermögens und der Anzahl der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds berechnet.

Unternehmen der CT Group	Anzahl der Empfänger	Summe Vergütung (in EUR) <sup>2</sup>	Feste Vergütung (EUR)	Variable Vergütung (EUR)
An identifizierte Mitarbeiter <sup>3</sup> durch die Verwaltungsgesellschaft während des Geschäftsjahres gezahlte Gesamtvergütung	26	4.219.616	104.523	49.493

<sup>1</sup>Der 31. Dezember ist das Ende des Geschäftsjahres der Verwaltungsgesellschaft

<sup>2</sup>Gesamtvergütung = Summe der festen und variablen Vergütung, die während des Geschäftsjahres der Verwaltungsgesellschaft an identifizierte Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft gezahlt wurde

<sup>3</sup>Identifizierte Mitarbeiter = Chief Business Development Officer, Senior Business Development Officer, verantwortliche Person für die Funktion "Permanent Risk", Responsable du Contrôle von Carne, Conducting Officers der Gesellschaft, Head of Legal, Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, Mitglieder des Anlageausschusses und Mitglieder des Bewertungsausschusses.

Der Chief Executive Officer und Country Head von Luxemburg sowie der Head of Compliance sind ebenfalls Conducting Officers und werden daher zu den Conducting Officers in Fußnote 3 gezählt.

### CT Group (die nachfolgende Erläuterung bezieht sich ausschließlich auf die CT Group)

Gemäß der OGAW-V-Richtlinie haben die Anlageverwalter des Fonds eine Vergütungspolitik verabschiedet, die mit den für OGAW-Verwaltungsgesellschaften geltenden Vergütungsgrundsätzen übereinstimmt und mit der Vergütungspolitik von Columbia Threadneedle Investments (EMEA) in Einklang steht. Die Größe der CT Group (die "Gruppe") und der Umfang der von ihr verwalteten Mittel, die interne Organisation und die Art, der Umfang und die Komplexität ihrer Aktivitäten wurden bei dieser Offenlegung berücksichtigt.

### Vergütungsbericht

Dieser Abschnitt des Jahresberichts wurde gemäß Artikel 14a(4) der Richtlinie 2009/65/EG in der durch die Richtlinie 2014/91/EU (die "OGAW-V-Richtlinie") geänderten Fassung und dem Handbuch der Financial Conduct Authority (SYSC 19E: OGAW-Vergütungskodex) erstellt.

Gemäß der OGAW-V-Richtlinie haben die Anlageverwalter eine Vergütungspolitik verabschiedet, die mit den für OGAW-Verwaltungsgesellschaften geltenden Vergütungsgrundsätzen übereinstimmt und mit der Vergütungspolitik von Columbia Threadneedle Asset Management (EMEA) in Einklang steht. Die Größe der CT Group (die "Gruppe") und der Umfang der von ihr verwalteten Mittel, die interne Organisation und die Art, der Umfang und die Komplexität ihrer Aktivitäten wurden bei dieser Offenlegung berücksichtigt.

### Vergütungspolitik

Der Zweck der Vergütungspolitik der Gruppe ist eine Beschreibung der Vergütungsgrundsätze und -praktiken innerhalb der Gruppe, um darzulegen, dass diese Grundsätze und Praktiken

- (a) mit einem soliden und effizienten Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind;
- (b) der Geschäftsstrategie, den Zielen, Werten und Interessen der Gruppe entsprechen;

(c) im Vergleich zur Anlagepolitik der betreffenden Teilfonds der Gruppe keine übermäßige Risikobereitschaft fördern;

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergütung (ungeprüft) (Fortsetzung)

(d) einen Rahmen für die Vergütung schaffen, um die Mitarbeiter, für welche die Vergütungspolitik gilt (einschließlich der Verwaltungsratsmitglieder), zu gewinnen, zu halten und zu motivieren, damit die Ziele der Gruppe erreicht werden;
(e) gewährleisten, dass alle relevanten Interessenkonflikte stets auf angemessene Weise gelöst werden können.

### Entscheidungsfindung und Governance

Der Verwaltungsrat (der Verwaltungsrat der Gruppe) ist verantwortlich für die Vergütungspolitik der Gruppe und für die Festlegung der Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder der Gruppe und anderer Mitarbeiter, die berufliche Tätigkeiten für die Gruppe ausführen. Der Verwaltungsrat der Gruppe hat die Verantwortung für die Einhaltung einer konformen Vergütungspolitik an den Risiko- und Vergütungsausschuss (der "Ausschuss") von Columbia Threadneedle Investments (vormals BMO Asset Management (Holdings) plc) übertragen. Der Ausschuss umfasst ausschließlich nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder von Columbia Threadneedle Investments. Der Verwaltungsrat der Gruppe hat die für alle Mitglieder der Gruppe ("Columbia Threadneedle Investments (EMEA)") für dieses Geschäftsjahr geltende Vergütungspolitik eingeführt, die vom Ausschuss regelmäßig (mindestens einmal jährlich) überprüft und genehmigt wird. Der Ausschuss ist für die Umsetzung der Vergütungspolitik und für die Überwachung gemäß den OGAW-Richtlinien verantwortlich. Der Verwaltungsrat der Gruppe ist der Ansicht, dass die Mitglieder des Ausschusses über angemessene Fachkenntnisse im Bereich Risikomanagement und Vergütung verfügen, um diese Überprüfung durchzuführen.

### Gültigkeitsbereich

Die Vergütungspolitik, die auch die Einhaltung der OGAW-V-Vorschriften berücksichtigt, gilt für Mitarbeiter, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Gruppe oder der von ihr verwalteten Fonds haben ("identifizierte Mitarbeiter") und somit für:

- (a) die Geschäftsleitung;
- (b) Risikoträger;
- (c) Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen; und

(d) Mitarbeiter, die sich aufgrund ihrer Gesamtvergütung in derselben Einkommensstufe befinden wie die Geschäftsleitung, und Risikoträger, deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Gesellschaft haben.

Die Liste der identifizierten Mitarbeiter und die obigen Auswahlkriterien werden regelmäßig (mindestens einmal jährlich) vom Ausschuss überprüft. Des Weiteren erfolgt eine formelle Überprüfung bei wesentlichen organisatorischen Änderungen und Änderungen der Vergütungsvorschriften, denen die Gruppe unterliegt.

### Verknüpfung von Vergütung und Leistung

Die Vergütungspolitik der Gesellschaft ist Teil des Rahmenwerks von Columbia Threadneedle Investments (EMEA) zur Förderung eines soliden Vergütungsmanagements, das darauf abzielt, den Mitarbeitern eine Gesamtvergütung zu bieten, die durch die Performance des Unternehmens, des Geschäfts-/Aufgabenbereichs und die individuelle Leistung gerechtfertigt und mit den Wettbewerbern am Markt vergleichbar ist und gleichzeitig mit einem soliden und effektiven Risikomanagement und der Erzielung fairer Ergebnisse für alle Kunden vereinbar ist und diese fördert. Zweck der Vergütungspolitik ist es, die Erreichung der Geschäftsziele und Unternehmenswerte der Gesellschaft zu erleichtern, wobei der Schwerpunkt auf den Kunden liegt, und gleichzeitig sicherzustellen, dass Columbia Threadneedle Investments (EMEA) in der Lage ist, das für die Erreichung dieser übermäßige oder unangemessene Risiken zu schaffen.

Bei der Festlegung der Vergütungshöhe werden die folgenden Komponenten und Grundsätze in das Vergütungsmanagement einbezogen:

- Die feste Vergütung wird unter Berücksichtigung von Faktoren wie den Anforderungen der jeweiligen Position und der Erfahrung, dem Fachwissen und den Aufgaben des Mitarbeiters und der festen Vergütung für vergleichbare Positionen festgelegt. Die feste Vergütung wird unter Bezugnahme auf die Marktdaten in einer Höhe festgelegt, die ausreichend ist, um hochkarätige Mitarbeiter anzuziehen und eine vollständig flexible Vergütungspolitik zu ermöglichen (einschließlich der Möglichkeit, dass ein Mitarbeiter in einem bestimmten Jahr eine reduzierte oder keine variable Vergütung erhält). Das Gleichgewicht zwischen fester und variabler Vergütung wird vom Ausschuss überwacht.
- Die variable Vergütung wird jährlich unter Berücksichtigung der finanziellen und nichtfinanziellen Performance der Gesellschaft festgelegt. Die Praktiken externer Wettbewerber werden in die Finanzierungsprüfung einbezogen, um sicherzustellen, dass die Vergütungsmöglichkeiten in den Märkten, in denen die Gruppe tätig ist, angemessen berücksichtigt und Loyalitätsrisiken effektiv gesteuert werden. Die Anreizfinanzierung wird unter Berücksichtigung der aktuellen und prognostizierten wirtschaftlichen Situation und der Risiken entwickelt, unterstützt durch die Beiträge des Audit and Compliance Committees von Columbia Threadneedle Investments (EMEA). Dabei wird sichergestellt, dass Risikoanpassungen sowie qualitative und quantitative Erwägungen, z. B. Kosten und Quantität des Kapitals und der Liquidität, aktiv als Finanzierungsanpassungen berücksichtigt werden. Der Ausschuss stellt sicher, dass die Auszahlung der Leistungsprämien nicht über Mittel oder Verfahren erfolgt, die es ermöglichen, die Auflagen geltender Gesetze und/oder Verordnungen im Hinblick auf die Vergütung zu umgehen.
- Die variable Vergütung wird dem jeweiligen Geschäftsbereich unter Berücksichtigung folgender Kriterien zugeordnet:
  - dem Beitrag des betreffenden Geschäftsbereichs oder der Einheit zur Performance der Gesellschaft;
  - der Leistung des Geschäftsbereichs in Bezug auf vorgegebene Ziele und Vorgaben, einschließlich der Einhaltung der Risikomanagementpflichten; und

# Columbia Threadneedle (Lux) III Vergütung (ungeprüft) (Fortsetzung)

• Angaben zur Bezahlung bei den Wettbewerbern.

Die individuellen Prämienzuweisungen erfolgen unter Bezugnahme auf die individuelle Leistung während des Leistungsjahres im Hinblick auf die vorab vereinbarten Ziele und die Bewertung der Marktvergleichbarkeit. Die Leistung wird in Bezug auf die vorab vereinbarten Ziele, unter anderem finanzielle und nicht-finanzielle Ziele (einschließlich der Erreichung fairer Kundenergebnisse) und der Einhaltung der Richtlinien und Verfahren der CT Group, der Risikomanagement- und Compliance-Anforderungen sowie des Verhaltenskodex von CT beurteilt. Die Leistungsbeurteilung der identifizierten Mitarbeiter berücksichtigt die mehrjährige Leistung entsprechend der Laufzeit der von der Gruppe verwalteten Fonds.

 Anwendung der im Handbook der Financial Conduct Authority (SYSC 19E: UCITS Remuneration Code) enthaltenen Regeln für den Zahlungsprozess, mit Ausnahme der Nichtanwendung auf Individual- oder Gruppenebene, die durch eine jährliche Proportionalitätsbewertung bestimmt wird.

# Quantitative Offenlegung der Vergütungen

Die von Columbia Threadneedle Management Limited an ihre Mitarbeiter gezahlte Gesamtvergütung beträgt null, da alle Mitarbeiter des OGAW bei anderen Unternehmen von Columbia Threadneedle Investments (EMEA) beschäftigt sind.

Die folgende Tabelle gibt einen Überblick über die Gesamtvergütung der identifizierten Mitarbeiter des OGAW in Bezug auf den Teil ihrer Vergütung, der ihren Aufgaben für den OGAW zugeordnet wird. Eine Aufteilung der Vergütung auf einzelne identifizierte Mitarbeiter, die an einem bestimmten OGAW-Fonds arbeiten, ist nicht möglich. Daher werden die Zahlen für die Verwaltungsgesellschaft des OGAW zusammengefasst.

Columbia Threadneedle Fund Management Limited	Mitarbeiterstand	Feste Vergütung (Mio. GBP)	Variable Vergütung (Mio. GBP)	Gesamtvergütung (Mio. GBP)
Vergütung der identifizierten Mitarbeiter des OGAW, davon:	35	0,49	1,15	1,64
Geschäftsleitung	12	0,17	0,37	0,54
Andere unter den Kodex fallende Mitarbeiter	23	0,32	0,78	1,10

### Erläuterungen zur quantitativen Offenlegung der Vergütungen

Die ausgewiesene Gesamtvergütung ist die Summe aus Gehalt, Barbonus, abgegrenztem Jahresbonus, Wert der gewährten langfristigen Leistungsprämien im Hinblick auf die Leistung im Berichtsjahr, zuzüglich des Wertes eventueller Barzuschüsse.

Zur "Geschäftsleitung" gehören laut Definition in dieser Tabelle der Verwaltungsrat des OGAW, geschäftsführende und nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder sowie Mitglieder des Group Management Teams von Columbia Threadneedle Investments. "Andere unter den Kodex fallende Mitarbeiter" sind alle anderen unter den Kodex fallenden identifizierten Mitarbeiter in Geschäftsfeldern, internen Kontrollfunktionen und Unternehmensfunktionen.

Die Offenlegung für die identifizierten Mitarbeiter stellt die Gesamtvergütung derjenigen Mitarbeiter dar, die ganz oder teilweise an den Aktivitäten der OGAW-Fonds beteiligt sind, aufgeteilt nach dem für den OGAW maßgeblichen Zeitaufwand oder dem auf den OGAW entfallenden Betrag auf Basis des verwalteten Vermögens.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Portfolioumschlag (ungeprüft)

Der Portfolioumschlag für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 wurde nach folgender Formel berechnet:

(Summe Käufe + Summe Verkäufe) - (Summe Zeichnungen + Summe Rücknahmen)

Portfolioumschlag =

Durchschnittliches Nettovermögen des Portfolios

x 100

Portfolio	Portfoliowährung	Nettogesamtvermögen im Jahresdurchschnitt	Portfolioumschlag zum 30. September 2023 (annualisiert) %
CT (Lux) Diversified Growth	Euro	106.929.117	126,59 %
CT (Lux) Euro Bond	Euro	150.424.234	171,08 %
CT (Lux) European Growth & Income	Euro	36.847.190	33,79 %
CT (Lux) European Smaller Cap	Euro	7.793.929	40,62 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	Euro	156.904.259	4,07 %
CT (Lux) Global Convertible Bond	Euro	36.685.741	69,83 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity	USD	4.288.231	29,64 %
CT (Lux) Global Total Return Bond	Euro	78.702.404	60,60 %
CT (Lux) Plus II *	Euro	40.956.400	0,00 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	Euro	85.319.806	9,68 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	USD	419.273.018	(3,23)%
CT (Lux) Responsible Global Equity	Euro	1.203.078.247	20,59 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity	USD	1.151.076.974	12,49 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income *	USD	4.740.074	(486,28)%
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income	Euro	73.397.286	85,40 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity	Euro	18.098.954	(6,28)%
CT (Lux) US Smaller Companies	USD	14.614.896	98,15 %

\* Siehe Anhang I.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Gesamtkostenquote (ungeprüft)

Der Portfolioumschlag wird folgendermaßen berechnet:

# Betriebliche Aufwendungen insgesamt in der Währung der Anteilsklasse

Gesamtkostenquote =

Durchschnittliches Vermögen des Portfolios in der Währung der Anteilsklasse

x 100

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Gesamtkostenquote zum 30. September 2023 (annualisiert) %
	_	
CT (Lux) Diversified Growth – Anteile Klasse A – Euro	Euro	1,94 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	GBP	1,96 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	1,51 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	GBP	0,58 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse X - Euro	Euro	0,41 %
CT (Lux) Euro Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	0,39 %
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	1,84 %
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	GBP	1,83 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro	Euro	2,04 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	2,02 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	Euro	1,23 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro CHF	1,44 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)		1,23 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	Euro	1,30 %
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro GBP	1,27 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged) CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	0,32 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged)	GBP	0,47 % 0,52 %
	JPY	0,52 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged) CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - USD (Hedged)	USD	0,55 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)	CHF	1,49 %
	CHF	1,49 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged) CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro	Euro	1,31 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)	Euro	1,47 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	Euro	1,47 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - GBP	GBP	1,47 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CD CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged)	USD	1,49 %
CT (Lux) Global Convertible Bond Hong Kong - Anteile Klasse A - USD	USD	1,40 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - CHF (Hedged)	CHF	1,15 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	1,10 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)	Euro	0,84 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged)	Euro	1,08 %
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro	Euro	1,12 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,50 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	1,48 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	1,58 %
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I Acc - GBP	GBP	0,70 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	0,76 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	JPY	0,81 %
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged)	USD	0,86 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	Euro	0,48 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse I - Euro	Euro	0,42 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	0,46 %
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged)	GBP	0,25 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF	CHF	1,62 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,83 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	1,82 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	1,83 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	CHF	0,92 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	1,04 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	1,04 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - CHF	CHF	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	Euro	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	0,93 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF	CHF	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	1,00 %

# Columbia Threadneedle (Lux) III Gesamtkostenquote (ungeprüft) (Fortsetzung)

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Gesamtkostenquote zum 30. September 2023 (annualisiert) %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	1,72 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	1,54 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	Euro USD	0,86 % 0,99 %
CT (Lux) Responsible Global Energing Markets Equity - Anterie Rasse XR Acc - 05D	Euro	1,77 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,76 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - SEK	SEK	1,78 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD	USD	1,77 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	USD	1,78 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	CHF	0,99 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	Euro	0,99 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	0,94 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	GBP	0,99 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	USD	0,82 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	1,00 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	Euro GBP	0,97 % 0,97 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Rasse P - GBF	USD	0,97 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	Euro	0,96 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	1,01 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	1,01 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse X - Euro	Euro	0,08 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	1,61 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - Euro	Euro	1,61 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - USD	USD	1,57 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XP - Euro	Euro	0,92 %
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR - Euro	Euro	0,85 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,75 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged) CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	Euro USD	1,72 % 1,75 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - 65D	Euro	0,94 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	USD	0,95 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	USD	0,95 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	CHF	1,06 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	0,95 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	GBP	1,00 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	GBP	1,00 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP (Hedged)	GBP	1,04 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	USD	1,02 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse X Inc - USD*	USD	0,29 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	Euro	1,64 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - USD CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	USD CHF	1,64 % 0,70 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CH	CHF	0,70 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - CHF (Hedged)	CHF	0,72 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - Euro (Hedged)	Euro	0,72 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - GBP (Hedged)	GBP	0,72 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - USD (Hedged)	USD	0,71 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	Euro	0,72 %
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	0,74 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)*	CHF	1,82 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)*	CHF	1,82 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro*	Euro	1,61 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)*	Euro	1,82 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro*	Euro	1,61 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)*	Euro	2,18 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - USD*	USD	1,60 %

# Columbia Threadneedle (Lux) III Gesamtkostenquote (ungeprüft) (Fortsetzung)

Portfolio	Währung der Anteilsklasse	Gesamtkostenquote zum 30. September 2023 (annualisiert) %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - USD*	USD	1,60 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro*	Euro	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)*	Euro	1,07 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro*	Euro	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro (Hedged)*	Euro	1,07 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - USD*	USD	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - USD*	USD	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R - Euro*	Euro	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Acc - Euro*	Euro	0,85 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - USD*	USD	0,87 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)*	CHF	0,70 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - Euro (Hedged)*	Euro	0,70 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - USD*	USD	1,02 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - CHF (Hedged)*	CHF	0,90 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - CHF (Hedged)*	CHF	0,90 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - Euro (Hedged)*	Euro	0,90 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - Euro (Hedged)*	Euro	0,90 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - GBP (Hedged)*	GBP	0,90 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - USD*	USD	0,87 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	Euro	1,77 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,77 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	1,76 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	Euro	0,62 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	0,61 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	Euro	1,09 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I Acc - Euro	Euro	0,94 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	Euro	1,12 %
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	1,12 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A - Euro	Euro	1,55 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	Euro	1,55 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse F Acc - Euro	Euro	0,42 %
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	Euro	0,99 %
CT (Lux) US Smaller Companies - Anteile Klasse A - USD	USD	2,00 %

\*Siehe Anhang I.

Performancegebühren werden nicht erhoben und sind daher nicht in der Gesamtkostenquote enthalten.

Bei Anteilsklassen, die während des Geschäftsjahres aufgelegt wurden (siehe Anhang I), wurden die bis zum Ende des Geschäftsjahres aufgelaufenen Betriebskosten annualisiert, um die Vergleichbarkeit der Schätzungen der TER für die Anteilsklasse zu gewährleisten.

Anteilsklassen mit einem synthetischen TER-Element	Währung der Anteilsklasse	Gesamtkostenquote des Zielfonds zum 30. September 2023 (annualisiert) %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - Euro	Euro	0,08 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	GBP	0,08 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	SEK	0,08 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	GBP	0,08 %
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse X - Euro	Euro	0,08 %

Zusätzliche Informationen:

Anleger in der Schweiz erhalten die Fondsdokumente wie den Verkaufsprospekt, die KIID, die Satzung sowie die Halbjahres- und Jahresberichte, die Liste der Käufe und Verkäufe während des Rechnungslegungszeitraum und weitere Informationen kostenlos beim Vertreter in der Schweiz.

Die Gesamtkostenquote und der Portfolioumschlag wurden gemäß den Leitlinien der Swiss Funds & Asset Management Association vom 16. Mai 2008 berechnet.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Performancedaten (ungeprüft)

Die Performanceangaben werden auf Grundlage der Veränderungen des Nettoinventarwerts pro Anteil im Verlauf des Berichtszeitraums berechnet. Die Performancezahlen in den Marktberichten der Anlageverwalter beruhen auf Gesamtperformancezahlen einschließlich Ausschüttungen und können von den unten angegebenen Zahlen abweichen.

Portfolio	30. September 2023 %	30. September 2022 %	30. September 2021 %
	/0	/0	/0
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - Euro	4,59	(11,57)	9,76
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A - GBP (Hedged)	6,08	(10,71)	10,15
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	5,17	(11,04)	10,02
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse F - GBP (Hedged)	7,46	(9,49)	11,75
CT (Lux) Diversified Growth - Anteile Klasse X - Euro	6,13	(10,17)	11,45
CT (Lux) Euro Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	(2,55)	(15,91)	(1,84)
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - Euro	20,62	(12,78)	24,79
CT (Lux) European Growth & Income - Anteile Klasse A - GBP	19,06	(10,90)	18,21
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A - Euro	12,21	(35,94)	38,04
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse A Acc - Euro	12,28	(35,34)	37,97
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I - Euro	12,61	(35,86)	39,08
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse I Acc - Euro	13,20	(34,84)	39,07
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	11,24	(35,00)	38,57
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R - Euro	12,72	(35,88)	39,07
CT (Lux) European Smaller Cap - Anteile Klasse R Acc - Euro	13,07	(34,84)	39,08
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse F Acc - GBP (Hedged)	3,29	(6,61)	3,76
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	1,75	(7,71)	3,34
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - GBP (Hedged)	3,07	(7,00)	3,63
CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged) CT (Lux) Global Absolute Return Bond - Anteile Klasse I Acc - USD (Hedged)	(1,23) 3,86	(7,68)	3,46 3,83
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)	2,35	(6,85) (19,01)	9,00
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged)	2,35	(18,86)	8,92
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro	0,62	(13,75)	9,41
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)	4,00	(20,85)	8,48
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	4,05	(18,65)	9,27
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A - GBP	(0,58)	(12,35)	3,66
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse A Acc - USD (Hedged)	6,64	(17,34)	10,29
CT (Lux) Global Convertible Bond Hong Kong - Anteile Klasse A - USD	8,84	(26,83)	8,52
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - CHF (Hedged)	2,55	(18,59)	9,41
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro	1,01	(12,40)	10,41
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)	4,68	(19,39)	9,37
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse P - Euro (Hedged)	4,49	(19,85)	9,38
CT (Lux) Global Convertible Bond - Anteile Klasse R - Euro	0,96	(12,57)	10,32
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	8,15	(16,76)	36,95
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A - USD	16,89	(29,63)	35,26
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	16,83	(29,65)	35,15
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I Acc - GBP	7,74	(14,46)	30,53
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse I - USD	K. A.	K. A.	36,10
CT (Lux) Global Smaller Cap Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	K. A.	K. A.	30,60
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - Euro	1,52	(11,35)	4,03
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I Acc - JPY (Hedged)	(1,36)	(11,03)	4,49
CT (Lux) Global Total Return Bond - Anteile Klasse I - USD (Hedged) CT (Lux) Plus II - Anteile Klasse I Acc - Euro*	1,91 K. A.	(11,48) (6,05)	3,31 26,95
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse F - Euro	3,25	(15,69)	0,57
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse I - Euro	3,78	(15,41)	0,95
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse R Acc - Euro	3,88	(15,45)	0,95
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond - Anteile Klasse X - GBP (Hedged)	4,45	(14,61)	(0,10)
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - CHF	4,47	(28,07)	16,52
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	3,11	(18,77)	16,24
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A - USD	11,43	(31,32)	14,75
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	11,59	(31,31)	15,14
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	5,12	(27,35)	17,87
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	3,80	(17,95)	17,31
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	12,45	(30,75)	16,08
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - CHF	5,00	(27,51)	17,72
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	3,91	(17,91)	17,22
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	12,53	(30,55)	16,30
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF	5,13	(27,58)	17,83

# Columbia Threadneedle (Lux) III Performancedaten (ungeprüft) (Fortsetzung)

Portfolio	30. September 2023 %	30. September 2022 %	30. September 2021 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	3,84	(17,97)	17,31
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	2,68	(16,18)	10,74
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	12,55	(30,76)	16,16
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse X Acc - USD	K. A.	K. A.	17,02
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	3,30	(21,10)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XA - USD	11,92	(31,20)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	3,66	(20,70)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	12,59	(30,90)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - Euro	2,94	(13,61)	26,30
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	2,96	(13,62)	26,39
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - SEK	8,92	(7,40)	21,99
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A - USD	11,13	(26,94)	24,85
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	11,31	(27,05)	24,92
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - CHF	4,24	(22,29)	27,89
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - Euro	3,49	(13,00)	27,11
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	3,77	(12,94)	27,30
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - GBP	2,31	(11,07)	20,64
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I - USD	7,67	(26,53)	25,80
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	12,24	(26,32)	25,77
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - Euro	3,78	(12,97)	27,37
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P - GBP	2,07	(11,24)	20,41
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	12,13	(26,41)	25,77
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R - Euro	3,33	(13,02)	27,11
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	3,70	(12,95)	27,25
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	12,09	(26,41)	25,76
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse X - Euro	4,70	(12,91)	27,20
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	3,23	(19,40)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - Euro	3,23	(19,40)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XA - USD	11,52	(29,70)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XP - Euro	3,82	(18,90)	K. A.
CT (Lux) Responsible Global Equity - Anteile Klasse XR - Euro	3,45	(18,90)	K. A.
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	2,53	(15,16)	37,17
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged)	7,51	(22,77)	33,80
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse A Acc - USD	10,64	(28,19)	35,66
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - Euro	3,30	(14,32)	38,36
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse I Acc - USD	11,60	(27,63)	36,72
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse P Acc - USD	11,68	(27,68)	37,30
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - CHF (Hedged)	6,56	(23,05)	1,10
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	3,38	(14,40)	38,15
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R - GBP	1,59	(12,86)	30,86
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP	1,97	(12,60)	31,05
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - GBP (Hedged)	9,52	(21,38)	1,50
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse R Acc - USD	11,49	(27,64)	37,10
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse X Inc - USD*	(8,10)	K. A.	K. A.
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - Euro	2,51	(14,91)	37,50
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XA Acc - USD	10,81	(28,16)	35,71
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF	3,07	(24,05)	38,45
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)	6,18	(23,49)	34,44
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - CHF (Hedged)	6,94	(22,88)	35,01
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - Euro (Hedged)	8,53	(22,04)	35,40
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - GBP (Hedged)	9,78	(21,23)	35,36
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XP Acc - USD (Hedged)	11,16	(21,68)	36,70
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - Euro	3,57	(14,11)	38,43
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity - Anteile Klasse XR Acc - USD	11,75	(27,44)	36,96
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - CHF (Hedged)*	(4,80)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - CHF (Hedged) $^{\star}$	(4,80)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro*	(3,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - Euro (Hedged)*	(4,70)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro*	(3,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - Euro (Hedged) $^{\star}$	(4,70)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A - USD*	(6,40)	K. A.	K. A.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Performancedaten (ungeprüft) (Fortsetzung)

Portfolio	30. September 2023 %	30. September 2022 %	30. September 2021 %
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse A Acc - USD*	(6,40)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro*	(3,20)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - Euro (Hedged)*	(4,60)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro*	(3,20)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - Euro (Hedged)*	(4,60)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I - USD*	(6,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse I Acc - USD*	(6,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R - Euro*	(3,20)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse R Acc - Euro*	(3,20)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - USD*	(6,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - CHF (Hedged)*	(4,60)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - Euro (Hedged)*	(4,50)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XP - USD*	(6,20)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - CHF (Hedged)*	(4,70)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - CHF (Hedged)*	(4,70)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR Acc - Euro (Hedged)*	(4,50)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - Euro (Hedged)*	(4,50)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - GBP (Hedged)*	(4,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income - Anteile Klasse XR - USD*	(6,30)	K. A.	K. A.
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - CHF	K. A.	K. A.	10,48
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A - Euro	(5,77)	(14,99)	6,76
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - Euro	(2,63)	(12,30)	9,82
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse A Acc - SEK (Hedged)	(2,60)	(12,22)	10,02
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F - Euro	(3,46)	(12,37)	10,10
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse F Acc - Euro	(1,49)	(11,01)	11,34
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I - Euro	(5,12)	(14,39)	7,51
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse I Acc - Euro	(1,69)	(11,41)	11,00
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R - Euro	(4,07)	(13,00)	9,82
CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income - Anteile Klasse R Acc - Euro	(1,99)	(11,78)	10,63
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A - Euro	14,22	(20,17)	28,01
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse A Acc - Euro	15,53	(20,03)	27,88
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse F Acc - Euro	16,71	(19,24)	29,42
CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity - Anteile Klasse R Acc - Euro	16,11	(19,57)	15,00
CT (Lux) US Smaller Companies - Anteile Klasse A - USD	15,33	(21,37)	54,10

\* Siehe Anhang I.

Die vergangene Performance ist kein Indikator für die derzeitige oder künftige Performance. In den Performanceangaben sind die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

### Allgemeine Angaben

Die folgende Tabelle zeigt den Marktwert der verliehenen Wertpapiere im Verhältnis zu den gesamten verleihbaren Vermögenswerten und des Nettovermögens des betreffenden Portfolios sowie den Wert der Total Return Swaps ("TRS") im Verhältnis zum Nettovermögen des Portfolios zum 30. September 2023. Die gesamten verleihbaren Vermögenswerte repräsentieren den Gesamtmarktwert des Wertpapierportfolios zum Berichtsdatum, ohne Derivate. Der Wert der TRS basiert auf dem nicht realisierten Gewinn/(Verlust) auf absoluter Basis.

		Verliehene Wertpapiere				TRS
Portfolio	Portfoliowährung	Marktwert der verliehenen Wertpapiere	% der verleihbaren Vermögens- werte	% des Nettover- mögens	Nicht realisierter Gewinn/ Verlust	% des Nettover- mögens
CT (Lux) Diversified Growth	EUR	3.314.067	3,23 %	3,09 %	1.123.970	1,05 %
CT (Lux) European Growth & Income	EUR	158.350	0,43 %	0,43 %	-	-
CT (Lux) European Smaller Cap	EUR	783.443	10,94 %	10,85 %	-	-
CT (Lux) Global Absolute Return Bond	EUR	3.160.158	1,86 %	1,83 %	-	-
CT (Lux) Global Total Return Bond	EUR	648.958	2,37 %	2,19 %	-	-
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond	EUR	943.155	2,21 %	2,14 %	-	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	USD	5.758.920	1,69 %	1,68 %	-	-

### Angaben zur Konzentration

Die folgende Tabelle zeigt die zehn größten Emittenten nach dem Marktwert der von der von dem jeweiligen Portfolio im Rahmen von Sicherungsübereignungsarrangements erhaltenen unbaren Sicherheiten für alle Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS) zum 30. September 2023:

		Marktwert der unbaren	Marktwert der unbaren Sicherheiten für OTC-	% des Nettover-
Emittent der unbaren Sicherheit	Portfoliowährung	Sicherheiten	Derivatgeschäfte	mögens
CT (Lux) Diversified Growth				
Kanada	EUR	219.272	-	0,20 %
Bundesrepublik Deutschland	EUR	580.681	1.512.144	1,95 %
Republik Frankreich	EUR	806.129	298.403	1,03 %
Königreich Belgien	EUR	499.232	-	0,47 %
Königreich der Niederlande	EUR	30.123	-	0,03 %
Königreich Schweden	EUR	116.624	-	0,11 %
Vereinigtes Königreich	EUR	603.452	-	0,56 %
USA	EUR	630.061	347.893	0,91 %
Summe	EUR	3.485.574	2.158.440	5,26 %
CT (Lux) European Growth & Income				
Kanada	EUR	5.496	-	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland	EUR	6.484	-	0,02 %
Republik Frankreich	EUR	99.333	-	0,27 %
Königreich der Niederlande	EUR	13.977	-	0,04 %
USA	EUR	47.147	-	0,13 %
Summe	EUR	172.437	-	0,47 %
CT (Lux) European Smaller Cap				
Kanada	EUR	38.535	-	0,53 %
Bundesrepublik Deutschland	EUR	89.244	-	1,24 %
Republik Frankreich	EUR	173.966	-	2,41 %
Königreich Belgien	EUR	45.085	-	0,62 %
Königreich der Niederlande	EUR	67.093	-	0,93 %
Königreich Schweden	EUR	21.367	-	0,30 %
Republik Österreich	EUR	6.674	-	0,09 %
Vereinigtes Königreich	EUR	63.440	-	0,88 %
USA	EUR	334.441	-	4,63 %
Summe	EUR	839.845	-	11,63 %
CT (Lux) Global Absolute Return Bond				
Kanada	EUR	167.314	-	0,10 %
Republik Frankreich	EUR	1.058.442	-	0,61 %
Königreich der Niederlande	EUR	143.415	-	0,08 %
USA	EUR	1.856.682	-	1,08 %
Summe	EUR	3.225.853	-	1,87 %
CT (Lux) Global Total Return Bond				.,,v
Kanada	EUR	31.372	-	0,11 %
Republik Frankreich	EUR	220.649	-	0,75 %
Königreich der Niederlande	EUR	26.890	-	0,09 %
USA	EUR	383.548		1,30 %
Summe	EUR	662.459		2,25 %

Emittent der unbaren Sicherheit	Portfoliowährung	Marktwert der unbaren Sicherheiten	Marktwert der unbaren Sicherheiten für OTC- Derivatgeschäfte	% des Nettover- mögens
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond				
Kanada	EUR	91.545	-	0,21 %
Republik Frankreich	EUR	270.057		0,61 %
Königreich der Niederlande	EUR	78.469		0,18 %
USA	EUR	522.582	-	1,19 %
Summe	EUR	962.653		2,19 %
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity				
Bundesrepublik Deutschland	USD	1.237.984	-	0,36 %
Republik Frankreich	USD	1.859.897	-	0,54 %
Königreich Belgien	USD	6.864	-	0,00 %
Vereinigtes Königreich	USD	1.656.191		0,48 %
USA	USD	1.290.952		0,38 %
Summe	USD	6.051.888		1,76 %

Die folgende Tabelle zeigt den Marktwert der verliehenen Wertpapiere und den nicht realisierten Wert der TRS auf absoluter Basis, aufgeschlüsselt nach Kontrahenten, zum 30. September 2023:

	Gründungsland des		Marktwert der verliehenen	TRS Nicht realisierter
Kontrahent	Kontrahenten	Portfoliowährung	Wertpapiere	Gewinn/Verlust
CT (Lux) Diversified Growth				
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	EUR	725.644	-
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	EUR	613.213	861.371
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	EUR	462.851	-
HSBC Bank Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	647.982	-
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	236.836	262.599
Societe Generale S.A.	Vereinigtes Königreich	EUR	627.541	-
Summe		EUR	3.314.067	1.123.970
CT (Lux) European Growth & Income				
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	67.690	-
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	EUR	90.660	-
Summe		EUR	158.350	-
CT (Lux) European Smaller Cap				
Barclays Capital Securities Ltd.	Vereinigtes Königreich	EUR	198.414	-
BNP Paribas Arbitrage SNC	Republik Frankreich	EUR	91.193	-
Citigroup Global Markets Ltd.	Vereinigtes Königreich	EUR	16.239	-
HSBC Bank Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	89.647	-
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	99.569	-
Merrill Lynch International	Vereinigtes Königreich	EUR	70.673	-
Societe Generale S.A.	Republik Frankreich	EUR	9.926	-
Morgan Stanley & Co. International Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	117.218	-
Macquarie Bank Limited	Australien	EUR	90.564	-
Summe		EUR	783.443	-
CT (Lux) Global Absolute Return Bond				
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	EUR	2.691.486	-
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	468.672	-
Summe		EUR	3.160.158	-
CT (Lux) Global Total Return Bond				
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	EUR	561.082	-
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	87.876	-
Summe	0 0	EUR	648.958	
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond				
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	EUR	686.723	-
JP Morgan Securities Plc.	Vereinigtes Königreich	EUR	256.432	-
Summe		EUR	943.155	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity	,			
Goldman Sachs International	Vereinigtes Königreich	USD	5.758.920	-
Summe		USD	5.758.920	

## Aggregierte Transaktionsdaten

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und der Qualität der von den jeweiligen Portfolios erhaltenen und gestellten unbaren Sicherheiten in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS) zum 30. September 2023:

		Marktwert der erhalten	en unbaren Sicherheiten	Marktwert der gestellten unbaren Sicherheiten
Unbare Sicherheit	Portfoliowährung	Verliehene Wertpapiere	OTC-Derivatgeschäfte	OTC-Derivatgeschäfte
CT (Lux) Diversified Growth				
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	3.485.574	2.158.440	-
Summe	EUR	3.485.574	2.158.440	-
CT (Lux) European Growth & Income				
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	172.437	-	-
Summe	EUR	172.437	-	-
CT (Lux) European Smaller Cap				
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	839.845	-	-
Summe	EUR	839.845	-	-
CT (Lux) Global Absolute Return Bond				
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	3.225.853	-	3.100.096
Summe	EUR	3.225.853	-	3.100.096
CT (Lux) Global Total Return Bond				
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	662.459	-	619.469
Summe	EUR	662.459	-	619.469
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bor	nd			
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade	EUR	962.653	-	-
Summe	EUR	962.653	-	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Ma	arkets Equity			
Festverzinsliche Anlagen				
Investment Grade USD		6.051.888	-	-
Summe	USD	6.051.888	-	-

Investment-Grade-Wertpapiere werden von einem Emittenten begeben, der über ein Mindestrating von "Investment Grade" von mindestens einer weltweit anerkannten Ratingagentur verfügt (Standard & Poor's, Moody's oder Fitch, wie im Prospekt definiert).

Die folgende Tabelle enthält eine Währungsanalyse der von den jeweiligen Portfolios erhaltenen und gestellten baren und unbaren Sicherheiten in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS) zum 30. September 2023:

Withour	Destfelieurikeure	Marktwert der erhaltenen Barsicherheiten	Marktwert der gestellten Barsicherheiten	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der gestellten unbaren Sicherheiten
Währung CT (Lux) Diversified Growth	Portfoliowährung	Barsicherneiten	Barsicherneiten	Sicherneiten	Sicherheiten
Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte					
EUR	EUR			4.074.605	
GBP	EUR	-	-	603.452	-
USD	EUR	-	-	630.061	-
		-	-		-
CAD	EUR	-	-	219.272	-
SEK	EUR	-	-	116.624	-
Summe	EUR	-	-	5.644.014	-
CT (Lux) European Growth & Income					
Wertpapierleihgeschäfte					
EUR	EUR	-	-	119.794	-
USD	EUR	-	-	47.147	-
CAD	EUR	-	-	5.496	-
Summe	EUR	-	-	172.437	-
CT (Lux) European Smaller Cap					
Wertpapierleihgeschäfte					
EUR	EUR	-	-	382.062	-
GBP	EUR	-	-	63.440	-
USD	EUR	-	-	334.441	-
CAD	EUR	-	-	38.535	-
SEK	EUR	-	-	21.367	-
Summe	EUR			839.845	-

Währung	Portfoliowährung	Marktwert der erhaltenen Barsicherheiten	Marktwert der gestellten Barsicherheiten	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der gestellten unbaren Sicherheiten
CT (Lux) Global Absolute Return Bond					
Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte					
EUR	EUR	-	-	1.201.857	3.100.096
USD	EUR	-	-	1.856.682	-
CAD	EUR	-	-	167.314	-
Summe	EUR	-	-	3.225.853	3.100.096
CT (Lux) Global Total Return Bond					
Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte					
EUR	EUR	-	-	247.539	619.469
USD	EUR	-	-	383.548	-
CAD	EUR	-	-	31.372	-
Summe	EUR	-	-	662.459	619.469
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond					
Wertpapierleihgeschäfte					
EUR	EUR	-	-	348.526	-
USD	EUR	-	-	522.582	-
CAD	EUR	-	-	91.545	-
Summe	EUR	-	-	962.653	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity					
Wertpapierleihgeschäfte					
EUR	USD	-	-	3.104.745	-
GBP	USD	-	-	1.656.191	-
USD	USD	-	-	1.290.952	-
Summe	USD	-	-	6.051.888	-

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit der von den jeweiligen Portfolios erhaltenen und gestellten Sicherheiten in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS) zum 30. September 2023:

		Verliehene Wertpapiere		OTC-Derivatgeschäfte		
Laufzeit	Portfoliowährung	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der erhaltenen Barsicher- heiten	Marktwert der gestellten Barsicher- heiten	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der gestellten unbaren Sicherheiten
CT (Lux) Diversified Growth						
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	479.948	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	3.005.626	-	-	2.158.440	-
Offen	EUR	-	-	-	-	-
Summe	EUR	3.485.574	-	-	2.158.440	-
CT (Lux) European Growth & Income		•	· · ·			-
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	1.921	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	1.971	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	168.545	-	-	-	-
Offen	EUR	-	-	-	-	-
Summe	EUR	172.437	-	-	-	-
CT (Lux) European Smaller Cap						
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	330	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	27.613	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	811.902	-	-	-	-
Offen	EUR	-	-	-	-	-
Summe	EUR	839.845	-	-	-	-

		Verliehene Wertpapiere		OTC-Derivatgeschäfte	
Laufzeit	Portfoliowährung	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der erhaltenen Barsicher- heiten	Marktwert der erhaltenen unbaren Sicherheiten	Marktwert der gestellten unbaren Sicherheiten
CT (Lux) Global Absolute Return Bond					
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	167.315	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	3.058.538	-	-	3.100.096
Offen	EUR	-	-	-	-
Summe	EUR	3.225.853	-	-	3.100.096
CT (Lux) Global Total Return Bond					
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	31.372	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	631.087	-	-	619.469
Offen	EUR	-	-	-	-
Summe	EUR	662.459	-	-	619.469
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond					
Weniger als ein Tag	EUR	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	72.950	-	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	889.703	-	-	-
Offen	EUR	-	-	-	-
Summe	EUR	962.653	-	-	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity					
Weniger als ein Tag	USD	-	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	USD	-	-	-	-
Eine Woche bis einen Monat	USD	-	-	-	-
Ein bis drei Monate	USD	-	-	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	USD	-	-	-	-
Mehr als ein Jahr	USD	6.051.888	-	-	-
Offen	USD	0.001.000	_	-	_
Summe	USD	6.051.888	-		

Bei unbaren Sicherheiten basiert die obige Laufzeitanalyse auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin des als Sicherheit erhaltenen Wertpapiers.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Laufzeit der verliehenen Wertpapiere und der ausstehenden TRS zum 30. September 2023:

		Verliehene Wertpapiere	TRS
Laufzeit	Portfoliowährung	Marktwert der verliehenen Wertpapiere	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
CT (Lux) Diversified Growth			
Weniger als ein Tag	EUR	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	1.123.970
Mehr als ein Jahr	EUR	-	-
Offen	EUR	3.314.067	-
Summe	EUR	3.314.067	1.123.970
CT (Lux) European Growth & Income			
Weniger als ein Tag	EUR	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	-	-
Offen	EUR	158.350	-
Summe	EUR	158.350	

		Verliehene Wertpapiere	TRS
Laufzeit	– Portfoliowährung	Marktwert der verliehenen Wertpapiere	Nicht realisierter Gewinn/Verlust
CT (Lux) European Smaller Cap			
Weniger als ein Tag	EUR		-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	-	-
Offen	EUR	783.443	-
Summe	EUR	783.443	-
CT (Lux) Global Absolute Return Bond			
Weniger als ein Tag	EUR	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	3.160.158	-
Offen	EUR	-	-
Summe	EUR	3.160.158	-
CT (Lux) Global Total Return Bond			
Weniger als ein Tag	EUR	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	648.958	-
Offen	EUR		-
Summe	EUR	648.958	-
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond			
Weniger als ein Tag	EUR	-	-
Ein Tag bis eine Woche	EUR	-	-
Eine Woche bis einen Monat	EUR	-	-
Ein bis drei Monate	EUR	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	EUR	-	-
Mehr als ein Jahr	EUR	943.115	-
Offen	EUR	-	-
Summe	EUR	943.155	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging M			
Weniger als ein Tag	USD	-	-
Ein Tag bis eine Woche	USD	-	-
Eine Woche bis einen Monat	USD	-	-
Ein bis drei Monate	USD	-	-
Drei Monate bis zu einem Jahr	USD	-	-
Mehr als ein Jahr	USD	-	-
Offen	USD	5.758.920	-

Die obige Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der verliehenen Wertpapiere und des entsprechenden TRS-Geschäfts.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der erhaltenen unbaren Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Geschäfte nach Clearing-Mechanismus, unter Angabe des Dreiparteien- oder bilateralen Vertreters zum 30. September 2023:

	Erhaltene unbare Sicherheiten für verliehene Wertpapiere	OTC Erhaltene unbare Sicherheiten
Dreiparteien		
JP Morgan Chase Bank	2.461.547	-
Bank of New York	11.998.515	-
Summe	14.460.062	-
Bilateral	940.647	2.158.440

Daten zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Zum 30. September 2023 wurde keine der für OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS) erhaltenen Barsicherheiten reinvestiert. Bei Wertpapierleihgeschäften akzeptiert der Fonds keine Barsicherheiten im Rahmen des Wertpapierleihprogramms.

Im Rahmen von Sicherungsübereignungsarrangements für Wertpapierleihgeschäfte und außerbörsliche Derivategeschäfte erhaltene unbare Sicherheiten können nicht verkauft, reinvestiert oder verpfändet werden.

# Verwahrung von Sicherheiten

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Beträge der von den Portfolios erhaltenen unbaren Sicherheiten in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte und OTC-Derivatgeschäfte (einschließlich TRS), die von der Verwahrstelle der Fonds (oder deren Beauftragten) bzw. einer externen Verwahrstelle gehalten werden, zum 30. September 2023:

		Marktwert der	erhaltenen unbaren Sicherheiter
Verwahrstelle	Portfoliowährung	Verliehene Wertpapiere	OTC-Derivatgeschäfte
CT (Lux) Diversified Growth			
Bank of New York	EUR	1.608.010	-
JP Morgan Chase Bank	EUR	1.502.133	-
State Street Bank Luxembourg S.C.A.	EUR	375.431	2.158.440
Summe	EUR	3.485.574	2.158.440
CT (Lux) European Growth & Income			
JP Morgan Chase Bank	EUR	39.934	-
State Street Bank Luxembourg S.C.A.	EUR	132.503	-
Summe	EUR	172.437	-
CT (Lux) European Smaller Cap			
Bank of New York	EUR	316.890	-
JP Morgan Chase Bank	EUR	90.242	-
State Street Bank Luxembourg S.C.A.	EUR	432.713	-
Summe	EUR	839.845	-
CT (Lux) Global Absolute Return Bond			
Bank of New York	EUR	2.747.809	-
JP Morgan Chase Bank	EUR	478.044	-
Summe	EUR	3.225.853	-
CT (Lux) Global Total Return Bond			
Bank of New York	EUR	572.825	-
JP Morgan Chase Bank	EUR	89.634	-
Summe	EUR	662.459	-
CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond			
Bank of New York	EUR	701.093	-
JP Morgan Chase Bank	EUR	261.560	-
Summe	EUR	962.653	-
CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity			
Bank of New York	USD	6.051.888	-
Summe	USD	6.051.888	-

### Angaben zu Rendite und Kosten

Die Aufschlüsselung von Rendite und Kosten nach Portfolio in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte ist in den Erläuterung dargelegt. Bitte beachten Sie den Abschnitt "Wertpapierleihgeschäfte".

Alle Renditen aus OTC-Derivategeschäften (einschließlich TRS) fließen dem Portfolio zu und unterliegen keiner Gewinnaufteilungsvereinbarung mit dem Portfoliomanager oder einem anderen Dritten.

Die Transaktionskosten für TRS sind nicht gesondert identifizierbar. Die Transaktionskosten für diese Anlagen sind im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und Teil der Brutto-Anlageperformance des jeweiligen Portfolios. Die Renditen werden während des Berichtszeitraums als realisierte Gewinne und Veränderung der nicht realisierten Werterhöhungen aus Swap-Kontrakten behandelt.

# Columbia Threadneedle (Lux) III Verwaltung des Fonds

### EINGETRAGENER SITZ

49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

### VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Carne Global Fund Managers (Luxembourg) S.A. 3, rue Jean Piret L-2350 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

# ANLAGEVERWALTER

Columbia Threadneedle Management Limited (bis 10. Dezember 2023) Exchange House, Primrose Street London EC2A 2NY Vereinigtes Königreich (seit 11. Dezember 2023) Cannon place, 78 Cannon Street London EC4N 6AG Vereinigtes Königreich Zugelassen und beaufsichtigt von der britischen Financial Conduct Authority (FCA).

Columbia Threadneedle Netherlands B.V. Jachthavenweg 109-E 1081 KM Amsterdam Niederlande

Columbia Management Investment Advisers, LLC 290 Congress Street Boston, Massachusetts 02110 USA registrierte Gesellschaft.

Columbia Threadneedle (EM) Investments Limited 95, Wigmore Street London W1K 1FD Vereinigtes Königreich

# VERWAHRSTELLE, REGISTERFÜHRER, TRANSFERSTELLE, DOMIZILSTELLE, ZAHL- UND VERWALTUNGSSTELLE IN LUXEMBURG

State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg 49, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

### NOTIERUNGSSTELLE

BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg 33, rue de Gasperich L-5826 Hesperange Großherzogtum Luxemburg

### WIRTSCHAFTSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative 2, rue Gerhard Mercator L-2182 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

## RECHTSBERATER

Elvinger Hoss Prussen, société anonyme 2, Place Winston Churchill L-1340 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg

## INFORMATIONS- UND ZAHLSTELLE IN DEUTSCHLAND

CACEIS Bank Deutschland GmbH Lilienthalallee 34-36 D-80939 München Deutschland

# Columbia Threadneedle (Lux) III Verwaltung des Fonds (Fortsetzung)

# INFORMATIONS- UND ZAHLSTELLE IN FRANKREICH

CACEIS BANK 1/3, Place Valhubert F-75013 Paris Frankreich

# INFORMATIONS- UND FACILITY-AGENT IN IRLAND

Bridge Consulting Limited 33 Sir John Rogerson's Quay Dublin 2 Irland

# INFORMATIONS- UND ZAHLSTELLE IN ÖSTERREICH

UniCredit Bank Austria AG Schottengasse 6-8 1010 Wien Österreich

# VERTRETER IN DER SCHWEIZ

Carnegie Fund Services S.A. 11, Rue du Général-Dufour 1204 Genf Schweiz

# ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ

Banque Cantonale de Genève 17, quai de l'Ile 1204 Genf Schweiz

### VERTRETER IN SPANIEN

Allfunds Bank S.A. C/Estafeta nº6 (La Moraleja) Complejo Plaza de la Fuete – Edificio 3 E-28109 Alcobendas – Madrid Spanien

# ZAHLSTELLEN IN ITALIEN

Allfunds Bank S.A., Zweigniederlassung Mailand Via Santa Margherita, 7 I-20121 Mailand Italien

# INFORMATIONS- UND ZAHLSTELLE IN BELGIEN

BNP Paribas Securities Services S.C.A. Niederlassung Brüssel Boulevard Louis Schmidt, 2 1040 Brüssel Belgien

# Columbia Threadneedle (Lux) III Anhang I – Auflegung und Schließung von Portfolios und Anteilsklassen

zum 30. September 2023

# Während des Geschäftsjahres wurde folgendes Portfolio aufgelegt: Portfolio Währung Auflegungsdatum CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income EUR 3. August 2023 Während des Berichtsjahrs wurde folgendes Portfolio geschlossen: Portfolio Schließdatum CT (Lux) Plus II EUR 13. Dezember 2022 Während des Geschäftsjahrs wurden folgende Klassen aufgelegt: Portfolio Währung Portfolio Währung der Währung Auflegungsdatum CT (Lux) SDG Engagement Global Equity Anteile Klasse X (Hedged) - USD USD 26. Juli 2023 CT (Lux) SDG Engagement Global Equity Anteile Klasse A Acc Portfolio (Hedged) - CHF CHF 2. August 2023 Enhanced Income CT (Lux) Sustainable Global Equity Anteile Klasse A Acc - Euro EUR 2. August 2023 Enhanced Income CT (Lux) Sustainable Global Equity Anteile Klasse A Acc - USD USD 2. August 2023 Enhanced Income CT (Lux) Sustainable Global Equity Anteile Klasse A Acc - USD USD 2. August 2023 Enhanced Income CT (Lux) Sustainable Global Equity Anteile Klasse A Acc - USD USD 2. August 2023 Enhanced Income CT (Lux) Sustai

Portfolio	Währung der	Währung	Auflegungsdatum
CT (Lux) SDG Engagement Global Equity	Anteile Klasse X (Hedged) - USD	USD	26. Juli 2023
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Acc Portfolio (Hedged) - CHF	CHF	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Acc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Acc - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Acc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Inc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Inc Portfolio (Hedged) - CHF	CHF	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Inc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse A Inc - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I Acc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I Inc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I Inc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I Acc – USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I Acc (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse I - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse R Acc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse R Inc - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XP Inc Portfolio (Hedged) - CHF	CHF	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XP Inc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XP - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR Acc Portfolio (Hedged) - CHF	CHF	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR Inc Portfolio (Hedged) - CHF	CHF	2. August 2023
Enhanced Income			

# Columbia Threadneedle (Lux) III Anhang I – Auflegung und Schließung von Portfolios und Anteilsklassen (Fortsetzung) zum 30. September 2023

Portfolio	Währung der	Währung	Auflegungsdatum
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XRAcc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR Inc Portfolio (Hedged) - Euro	EUR	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR Inc Portfolio (Hedged) - GBP	GBP	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR Acc - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			
CT (Lux) Sustainable Global Equity	Anteile Klasse XR - USD	USD	2. August 2023
Enhanced Income			

Während des Berichtsjahrs wurde folgende Klasse geschlossen:

Portfolio	Anteilsklasse	Währung	Schließdatum
CT (Lux) Plus II	Anteile Klasse I – EUR	EUR	13. Dezember 2022

# Anhang II – Regelmäßige Angaben gemäß Offenlegungsverordnung (ungeprüft)

# Portfolios gemäß Art. 6

Bei den nachfolgenden Portfolios wird nicht davon ausgegangen, dass sie in den Anwendungsbereich von Artikel 8 oder Artikel 9 der Offenlegungsverordnung fallen. Die Anlagen, die diesen Portfolios zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für eine ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit.

- CT (Lux) Diversified Growth - CT (Lux) Euro Bond

- CT (Lux) European Growth & Income CT (Lux) European Smaller Cap
- CT (Lux) European Smaller Cap CT (Lux) Global Absolute Return Bond CT (Lux) Global Convertible Bond CT (Lux) Global Smaller Cap Equity CT (Lux) Global Total Return Bond

- CT (Lux) US Smaller Companies

# Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

# Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Responsible Euro Corporate Bond Unternehmenskennung (LEI-Code): 2138007PU8621E722925

### Investition ist eine Ökologische und/oder soziale Merkmale Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? eines Umweltziels oder sozialen Ziels Ja × Nein beiträgt, vorausgesetzt, dass Es wurden damit nachhaltige Es wurden damit ökologische/soziale diese Investition keine Merkmale beworben und obwohl keine Investitionen mit einem Umweltziele oder Umweltziel getätigt: \_\_\_\_% nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, sozialen Ziele enthielt es einen Anteil von 83,06 % an erheblich in Wirtschaftstätigkeiten, die nachhaltigen Investitionen beeinträchtigt und die nach der EU-Taxonomie als Unternehmen, in die ökologisch nachhaltig mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, investiert wird, einzustufen sind die nach der EU-Taxonomie als ökologisch Verfahrensweisen nachhaltig einzustufen sind einer guten in Wirtschaftstätigkeiten, die Unternehmensführung nach der EU-Taxonomie nicht mit einem Umweltziel in anwenden. als ökologisch nachhaltig Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EUeinzustufen sind Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig Die EU-Taxonomie ist einzustufen sind ein Klassifikationssystem, mit einem sozialen Ziel das in der Verordnung (EU) Es wurden damit nachhaltige Es wurden damit ökologische/soziale 2020/852 festgelegt Investitionen mit einem sozialen Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen ist und ein Verzeichnis von Ziel getätigt: \_\_\_% Investitionen getätigt. ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. und/oder sozialen Merkmale erfüllt? Nachhaltige Investitionen mit Die übergeordnete Philosophie des Portfolios lautet: einem Umweltziel Vermeiden von Unternehmen mit umweltschädlichen oder sozial schädlichen Produkten oder könnten nicht nachhaltigen Geschäfts- oder Unternehmensführungspraktiken taxonomiekonform sein oder nicht. Darüber hinaus Investieren in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zur Gesellschaft und/oder Umwelt leisten

Eine nachhaltige

• Verbesserung des Managements von ESG-Themen, wobei der Einfluss des Anlageverwalters als Anleger genutzt wird, um durch Engagement bewährte Verfahren zu fördern Der Fonds hat zwar kein nachhaltiges Ziel, strebt aber an, mindestens 25 % nachhaltige Investitionen zu halten. Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 83,06 % in nachhaltigen Investitionen.

Während des Berichtszeitraums wurden alle Vermögenswerte des Fonds mit Ausnahme von Barmitteln, Devisentermingeschäften, börsengehandelten Futures und OTC-Derivaten überprüft, mit dem Ergebnis, dass Unternehmen, die keine ökologischen oder sozialen Mindeststandards einhalten, aus dem Fonds ausgeschlossen wurden. 2022 wurde ein Unternehmen nach den Screening-Kriterien des Anlageverwalters neu von "akzeptabel" in "nicht akzeptabel" eingestuft und folglich durch Verkauf aus dem Portfolio entfernt. Holcim Ltd wurde am 02.12.2022 erneut als "nicht akzeptabel" eingestuft, da der Anlageverwalter zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen gegen die verhaltensbasierten Kriterien der verantwortungsvollen Fonds verstößt.

Der Fonds investiert in Unternehmen, die Nachhaltigkeitslösungen anbieten und/oder einen positiven Beitrag für die Gesellschaft und/oder die Umwelt leisten. Diese Investition erfolgt in erster Linie durch Investitionen in grüne, nachhaltige oder nachhaltigkeitsbezogene Anleihen, die von Unternehmen ausgegeben werden (sogenannte "Anleihen mit einem Label"). Alle Anleihen mit einem Label müssen individuell vom Team für verantwortungsvolles Investieren des Anlageverwalters hinsichtlich der Auswirkungen auf die Gesellschaft und/oder die Umwelt oder die Wesentlichkeit des Nachhaltigkeitsziels bewertet werden, bevor sie für die Investition genehmigt werden. Im Berichtszeitraum erhöhte der Fonds den Prozentsatz seiner Investitionen in Anleihen mit einem Label von 35 % des NIW auf 40 % des NIW.

Der Fonds engagierte sich im Berichtszeitraum weiterhin bei Unternehmen, in die investiert wird. Eine Aufschlüsselung der Engagementaktivitäten wird im Folgenden als Nachhaltigkeitsindikator dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Anlageverwalter verwendet die folgenden Indikatoren, um das Erreichen der vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen:

1. Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen

Der Fonds investierte nicht in Anleihen, die gegen seine Standards verstießen. Vor der Investition wurde jede Position vom Team für verantwortungsvolles Investieren geprüft und für den Kauf genehmigt, wobei die Überprüfung fortlaufend erfolgt.

2. Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs)

Zum 30.09.2023 waren 83,06 % des Portfolios in Unternehmen investiert, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet sind.

- Der Prozentsatz des Portfolios, der aus Anleihen mit einem Label besteht, einschließlich nachhaltigkeitsbezogener Anleihen und grüner Anleihen. Zum 30.09.2023 waren 39,74 % des Portfolios in Anleihen mit einem Label investiert.
- 4. Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine

Im Geschäftsjahr gab es 70 Engagements bei 31 Unternehmen. Daraus ergaben sich 16 Meilensteine, d. h., ein Unternehmen hat seine Politik und seine Praktiken im Einklang mit unseren Engagementzielen spürbar verbessert.



Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

# ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	2023	2022
Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen	0	0
Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) <sup>1</sup>	83,06 %	48,51 %
Der Prozentsatz des Portfolios, der aus Anleihen mit einem Label besteht, einschließlich nachhaltigkeitsbezogener Anleihen und grüner Anleihen.	39,74 %	35,27 %
Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine	16	16
Anzahl der Engagements	70	144
Anzahl der Unternehmen, bei denen ein Engagement erfolgt ist	31	53
Anzahl der vom Engagement abgedeckten Länder	8	11
Anzahl der Meilensteine	16	16

# Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zum 30.09.2023 waren 83,06 % des Portfolios in Anleihen von Unternehmen investiert, die mehr als 50 % ihres Nettoumsatzes im Einklang mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung generieren.

Davon waren im Fonds 39,74 % der Bestände in Anleihen mit einem Label investiert, die wesentlich zu nachhaltigen Zielen beitragen. Der Anlageverwalter verlangt, dass die Erlöse in wichtigen Umweltprojektkategorien verwendet werden, z. B.:

- 1. Erneuerbare Energie und Übertragung
- 2. Alternative Kraftstoffe
- 3. Energieeffizienz
- 4. Sauberer Transport
- 5. Erhaltung der Biodiversität
- 6. Nachhaltige Abfallwirtschaft

- 7. Wasser
- 8. Grüne Gebäude
- 9. Nachhaltige Landnutzung (Forstwirtschaft und Landwirtschaft)

Die Anleihe sollte außerdem den Prinzipien für grüne Anleihen (Green Bond Principles, GBP), den Prinzipien für soziale Anleihen (Social Bond Principles, SBP), den Leitlinien für Nachhaltigkeitsanleihen (Sustainability Bond Guidelines, SBG) oder den Prinzipien für nachhaltigkeitsbezogene Anleihen (Sustainability-Linked Bond Principles) der IMCA entsprechen.

# Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf folgende Weise erheblich beeinträchtigen:

- Das Portfolio schließt Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.
- Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.
- Jede Anleihe mit einem Label wird vom Team für verantwortungsvolles Investieren geprüft und genehmigt, um sicherzustellen, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht wesentlich beeinträchtigt, z.
   B. in Bezug auf die Unternehmensführung oder die wichtigsten negativen Auswirkungen.

Der Anlageverwalter schließt Anleihen mit einem Label aus:

- die ein insgesamt sehr schlechtes ESG-Management aufweisen, was ein ernsthaftes Risiko für die Integrität des Portfolios darstellt
- die schwerwiegende Umwelt- oder Finanzmanagementprobleme aufweisen und somit unser Vertrauen in die Fähigkeit des Emittenten, seine Verpflichtungen im Hinblick auf grüne Anleihen zu erfüllen, untergraben (z. B. bedeuten größere Kontroversen im Zusammenhang mit dem Management von Umweltprojekten wie erneuerbaren Energien oder größere Kontroversen bei der Vergabe von Umweltkrediten, dass der Anlageverwalter kein Vertrauen in die Fähigkeit des Emittenten hat, grüne Projekte durchzuführen).

# Wie wurden die Indikatoren f ür nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren ber ücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH). Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS).

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist. Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, alle Positionen standen damit in Einklang. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln.

[Fügen Sie eine Erklärung für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 hinzu.]

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



# Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf verschiedene Weise:

 Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie und die Screening-Kriterien des Fonds, die sich auf die PAI beziehen, einschließlich: fossile Brennstoffe, Biodiversität, Entwaldung, Menschenrechte, globale Normen, gefährliche Abfälle und umstrittene Waffen. Der Fonds befolgte diese Ausschlussrichtlinie während des Berichtszeitraums.

- 2) Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI, um eventuell auftretende schädliche Praktiken zu überwachen. Für die im Portfolio gehaltenen Positionen wurden keine erheblichen schädlichen Praktiken identifiziert.
- 3) Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. So bezog sich beispielsweise mehr als ein Viertel der Engagements in diesem Jahr auf den Klimawandel. Einzelheiten zum PAI-Engagement sind weiter unten in diesem Bericht aufgeführt.

# Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Telstra Corporation Ltd 1,375 26. März 2029	Kommunikationsdienste	2,17	AU
Deutsche Bank AG 1,875 23. Februar 2028	Finanzen	1,82	DE
Pepsico Inc 0,75 18. März 2027	Nicht-zyklische Konsumgüter	1,72	US
Volkswagen International Finance N 0,875 22. September 2028	Finanzen	1,69	NL
Apple Inc 1,625 10. November 2026	Informationstechnologie	1,4	US
Nationwide Building Society 2,0 25. Juli 2029	Finanzen	1,37	GB
Societe Generale Sa 0,875 22. September 2028	Finanzen	1,35	FR
Bank Of America Corp 0,654 26. Oktober 2031	Finanzen	1,24	US

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023

Bank Of Ireland 1,375	Finanzen	1,2	IE
11. August 2031			
Suez Saca 2,375	Industriewerte	1,2	FR
24. Mai 2030			
Virgin Money Uk Plc 4,0	Finanzen	1,19	GB
03. September 2027			
BNP Paribas Sa 4,375	Finanzen	1,15	FR
13. Januar 2029			
Bank Of America Corp 0,808	Finanzen	1,15	US
09. Mai 2026			
Novartis Finance Sa 1,625	Finanzen	1,13	LU
09. November 2026			
Koninklijke Kpn Nv 3,875	Kommunikationsdienste	1,09	NL
03. Juli 2031			

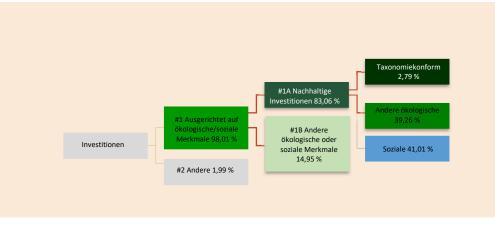
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

# Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Fonds hielt 83,06 % an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen



# Wie sah die Vermögensallokation aus?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

#### Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

#### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

#### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% des Nettovermögens
Finanzen	46,1 %
Versorger	10,2 %
Zyklische Konsumgüter	7,9 %
Nicht-zyklische Konsumgüter	6,1 %
Immobilien	6,0 %
Kommunikationsdienste	6,0 %
Gesundheitswesen	5,9 %
Grundstoffe	4,7 %
Industriewerte	3,0 %
Informationstechnologie	2,1 %
Barmittel	2,0 %

# Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel sind nicht an die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung gebunden.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 2,79 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.

# Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme T\u00e4tigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

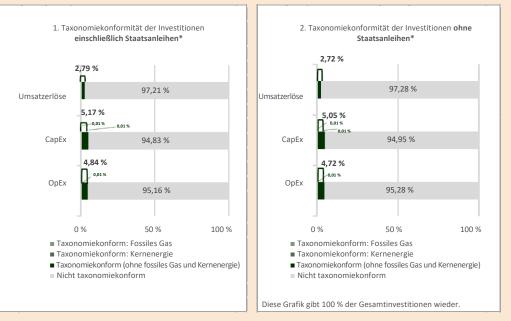


<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die
   den Anteil der
   Einnahmen aus
   umweltfreundlichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- Betriebsausgaben
   (OpEx), die die
   umweltfreundlichen
   betrieblichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   widerspiegeln

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen. Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Die ermöglichenden Tätigkeiten betrugen 2,27 %, die Übergangstätigkeiten 0,08 %.

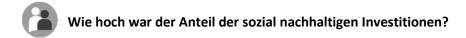
Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Der Fonds hatte zuvor nicht angegeben, dass seine Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung entsprechen. Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 2,79 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.



# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

**39,26** % des Portfolios waren in nachhaltige Investitionen investiert, die überwiegend zu einem Umweltziel beitragen. Diese Bestände wurden nicht auf ihre Taxonomiekonformität hin geprüft.



41,01 % des Portfolios waren in nachhaltige Investitionen investiert, die überwiegend zu einem sozialen Ziel beitragen.

	6	10			
1	ß	Ħ	D	9	۵
0		9	1	0	,
N	Y	1	-	7	A

## Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Zu den "Anderen" Investitionen können (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die für Treasury-Zwecke gehalten werden, und (iii) Derivate zu Absicherungszwecken gehören.

Diese Investitionen werden nicht verwendet, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios zu erfüllen.

Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Geschäftsjahr gab es 70 Engagements bei Unternehmen im Portfolio. Diese betrafen 31 Unternehmen in 8 Ländern und deckten eine Reihe von Themen ab.

Der Klimawandel wurde als systemisches Risiko identifiziert, das Emittenten betrifft, und im Jahr 2021 hat das Investment Grade Fundamental Credit Analyst Team proaktiv mit über 50 Banken Kontakt aufgenommen, um deren Klimastrategie und Klimarisikomanagementansatz zu verstehen. Anschließend fand eine Reihe von Treffen statt, bei denen es darum ging, Fortschritte in den Bereichen 1) Ziele, 2) Messung, 3) Berichterstattung und 4) Risikoübernahme zu erzielen. Sie nahmen die Informationen aus den Antworten der Banken und aus ihren Sitzungen auf und führten eine Bottom-up-Analyse der klimabezogenen Angaben innerhalb des Sektors durch. Als Ergebnis dieser Analyse stuften sie die Unternehmen auf Basis des Klimarisikos von 1-10 ein.

Bei den Banken bezogen sich die grundlegenden Einstufungen fast ausschließlich auf die Unternehmensführung und -kultur. Sie verglichen ihre grundsätzlichen Einstufungen mit den oben genannten Klimapunkten, um festzustellen, welche Änderungen vorgenommen werden müssen. In der Folgen änderten sie die grundlegende Einstufung von 14 Emittenten, indem sie deren Position um drei bis fünf Stufen verschoben.

In Fortsetzung dieser Arbeit wurden im Jahr 2023 47 Banken befragt, um deren Ausrichtung auf eine Netto-Null-Zukunft zu bewerten. Sie arbeiteten mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren zusammen, um Fragen zu formulieren, die auf 9 Bewertungsbereiche abzielten: Zwischenziele, finanzierte Emissionsleistung, Offenlegung, operatives Vorbereitetsein, Einbeziehung des Klimas in die Finanzierungsentscheidung, Hypothekarkredite für Wohngebäude, Vorbereitetsein für regulatorische Veränderungen, Unternehmensführung und Chancen. Sie vergaben in jedem der 9 Bereiche Punkte von 1 bis 10 und gaben eine Gesamtbeurteilung ab, ob die Bank ausgerichtet ist, im Prozess der Ausrichtung ist, sich verpflichtet oder nicht ausgerichtet ist. Sie bezogen die neuen Informationen und den Status der Netto-Null-Ausrichtung in ihre fundamentale Gesamtbetrachtung ein und passten ihre grundlegenden Einstufungen, ihre Bewertungen und ihre Thesen an. Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die sie in der Regel betreffen. Der Anlageverwalter aktualisiert den Ansatz zur Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAl <sup>3</sup>	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	27,50 %	50,00 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	11,67 %	0,00 %
Geschäftsgebaren	Soziales und Beschäftigung	0,83 %	0,00 %
Menschenrechte		11,67 %	6,25 %
Arbeitsstandards		21,67 %	12,50 %
Öffentliche Gesundheit		9,17 %	6,25 %
Unternehmensführung		17,50 %	25,00 %

#### Bei den

Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Der Fonds verwendet keinen Referenzwert, um zu messen, ob er die von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend

- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten? Nicht zutreffend
- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten? Nicht zutreffend

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Beachten Sie, dass Themen mit mehreren PAI übereinstimmen können.

#### Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

#### Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Responsible Global Emerging Markets Equity Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800BICB11V5TYV922

#### Investition ist eine Ökologische und/oder soziale Merkmale Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass × Nein Ja diese Investition keine Es wurden damit nachhaltige Es wurden damit ökologische/soziale Umweltziele oder Investitionen mit einem sozialen Ziele erheblich Merkmale beworben und obwohl keine beeinträchtigt und die Umweltziel getätigt: \_\_\_\_% nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, Unternehmen, in die enthielt es einen Anteil von 76,99 % an investiert wird. in Wirtschaftstätigkeiten, die nachhaltigen Investitionen Verfahrensweisen einer nach der EU-Taxonomie als guten ökologisch nachhaltig mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, Unternehmensführung einzustufen sind die nach der EU-Taxonomie als ökologisch anwenden. nachhaltig einzustufen sind in Wirtschaftstätigkeiten, die Die EU-Taxonomie ist nach der EU-Taxonomie nicht 🗶 mit einem Umweltziel in als ökologisch nachhaltig Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Klassifikationssystem, einzustufen sind Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig das in der Verordnung einzustufen sind (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein × mit einem sozialen Ziel Verzeichnis von ökologisch Es wurden damit ökologische/soziale nachhaltigen Es wurden damit nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten Investitionen mit einem sozialen Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen enthält. Ziel getätigt: \_\_\_% Investitionen getätigt. **Diese Verordnung** umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen

## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die übergeordnete Philosophie des Portfolios lautet:

- Vermeiden von Unternehmen mit umweltschädlichen oder sozial schädlichen Produkten oder nicht nachhaltigen Geschäfts- oder Unternehmensführungspraktiken
- Investieren in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zur Gesellschaft und/oder Umwelt leisten

Wirtschaftstätigkeiten.

Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltige

Eine nachhaltige

ein

- Verbesserung des Managements von ESG-Themen, wobei der Einfluss des Anlageverwalters als Anleger genutzt wird, um durch Engagement und Stimmrechtsausübung bewährte Verfahren zu fördern
- Der Fonds hat zwar kein nachhaltiges Ziel, strebt aber an, mindestens 67,5 % der Unternehmen als nachhaltige Investitionen zu halten. Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 76,99 % als nachhaltig eingestufte Investitionen.

#### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Anlageverwalter verwendet die folgenden Indikatoren, um das Erreichen der vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen:

1. Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen

Vor der Investition wurde jede Position vom Team für verantwortungsvolles Investieren geprüft und für den Kauf genehmigt, wobei die Überprüfung fortlaufend erfolgt. Außerdem wurden die Positionen überwacht, um sicherzustellen, dass sie weiterhin die Anforderungen des Fonds erfüllen. Eine Position, Tencent, wurde veräußert, da sie nicht mehr den Fondsanforderungen entsprach.

Thema:	Portfoliogewichtung zum 30.09.23:
Nahrungsmittel und Ernährung	13,56 %
Gesundheit und Wohlbefinden	24,86 %
Verantwortungsvolle Finanzwirtschaft	20,33 %
Nachhaltige Infrastruktur	6,77 %
Technologische Innovation	33,89 %
Summe:	99,42 %

2. Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet ist

3. Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs)

76,99 % des Portfolios waren zum 30.09.2023 in Unternehmen investiert, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet sind.

4. Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine

Im Geschäftsjahr gab es 55 Engagements bei 20 Unternehmen. Daraus ergaben sich 7 Meilensteine, d. h., ein Unternehmen hat seine Politik und seine Praktiken im Einklang mit den Engagementzielen des Anlageverwalters spürbar verbessert.

#### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	2023	2022
Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen	1	0
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet ist	99,42 %	97,24 %
Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) <sup>1</sup>	76,99 %	77,03 %
Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine	7	12
Anzahl der Engagements	55	58
Anzahl der Unternehmen, bei denen ein Engagement erfolgt ist	20	20
Anzahl der vom Engagement abgedeckten Länder	11	11

## Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zum 30.09.2023 war der Fonds zu 76,99 % in Unternehmen investiert, die an den Zielen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet sind und als nachhaltige Investitionen gelten.

Diese Investitionen tragen zu einem nachhaltigen Ziel bei, indem sie einen Beitrag zu wichtigen Nachhaltigkeitsthemen leisten, die vor allem einen ökologischen oder sozialen Schwerpunkt haben, darunter vor allem:

- 1. Gesundheit und Wohlbefinden Unterstützung der Bereitstellung von Dienstleistungen zur Verbesserung des langfristigen persönlichen Wohlbefindens, z. B. in den Bereichen Bildung, Gesundheit und Sanitär-Einrichtungen
- 2. Nahrungsmittel und Ernährung Unterstützung der Förderung nachhaltiger Produktionsund Konsummuster
- 3. Technologische Innovation Bereitstellung von technologischen und Konnektivitätslösungen zur Förderung einer nachhaltigen Entwicklung

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Gemessen an Betrieben, deren Einnahmen zu mehr als 50 % positiv auf die SDGs ausgerichtet sind

- 4. Energiewende Versorgung der Wirtschaft mit effizienter und erschwinglicher Energie aus konventionellen und alternativen Quellen
- 5. Nachhaltige Infrastruktur Unterstützung beim Aufbau widerstandsfähiger Infrastruktur in den Sektoren Transport, Energie, Wasser, Kommunikation und anderen Sektoren
- Verantwortungsvolle Finanzwirtschaft Bereitstellung von Finanzdienstleistungen zur Förderung der finanziellen Inklusion, der Entwicklung kleiner und mittelgroßer Unternehmen (KMU), grüner Finanzen und nachhaltiger Finanzmärkte

#### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf folgende Weise erheblich beeinträchtigen:

- Das Portfolio schließt Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produktund verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.
- Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

# Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS)<sup>2</sup>. Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Die technischen Regulierungsstandards enthalten drei Tabellen mit den von der Europäischen Kommission definierten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen. Die Tabellen decken eine Reihe schädlicher Aktivitäten in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ab.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle als nachhaltig eingestuften Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Berichtszeitraum wurden keine Verstöße festgestellt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



# Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf dreierlei Art und Weise:

- 1) Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie und die Screening-Kriterien des Fonds, die sich auf die PAI beziehen, einschließlich: fossile Brennstoffe, Biodiversität, Entwaldung, Menschenrechte, globale Normen, gefährliche Abfälle und umstrittene Waffen.
- 2) Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI gemäß Tabelle 1 im RTS. Dies ermöglicht es dem Anlageverwalter, schädliche Praktiken zu überwachen, die auftreten können. Für die im Portfolio gehaltenen Positionen wurden keine erheblichen schädlichen Praktiken identifiziert.
- 3) Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum vom 01. Oktober 2022 bis 30. September 2023 getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel

## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Informationstechnologie	6,98	тw
FPT Corp	Informationstechnologie	5,35	VN
HDFC Bank Ltd	Finanzen	5,01	IN
AIA Group Ltd	Finanzen	4,4	нк
Bank Central Asia Tbk Pt	Finanzen	3,92	ID
Jeronimo Martins Sgps Sa	Nicht-zyklische Konsumgüter	3,7	РТ
Biocon Ltd	Gesundheitswesen	3,21	IN
Techtronic Industries Co Ltd	Industriewerte	3,18	нк
Advantech Co Ltd	Informationstechnologie	2,88	TW
Haier Smart Home Co Ltd	Zyklische Konsumgüter	2,84	CN
Tata Consultancy Services Ltd	Informationstechnologie	2,77	IN
Mercadolibre Inc	Zyklische Konsumgüter	2,75	UY
Wuxi Biologics Cayman Inc	Gesundheitswesen	2,54	CN
Discovery Ltd	Finanzen	2,51	ZA
Naver Corp	Kommunikationsdienste	2,49	KR

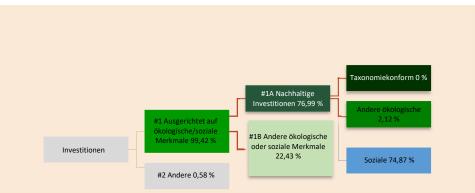
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Fonds hielt 76,99 % an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen



Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.





**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2** Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien: - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

	Nettovermögens
Informationstechnologie	25,12
Finanzen	22,09
Nicht-zyklische Konsumgüter	16,87
Gesundheitswesen	13,14
Zyklische Konsumgüter	11,33
Industriewerte	8,37
Kommunikationsdienste	2,49
Barmittel und Derivate	0,58

Sektor

% des Nettovermögens<sup>3</sup>

 $<sup>^3</sup>$  Aufgrund von Rundungen kann es vorkommen, dass die Summe der ausgewiesenen Zahlen nicht 100 % ergibt.



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

# Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel sind nicht an die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung gebunden.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 0 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.

#### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme T\u00e4tigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>4</sup>?



In Kernenergie

🗶 Nein

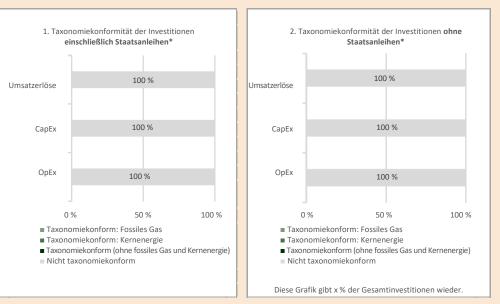
<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

### Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch

- den Anteil der: - Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlich en Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben
   (CapEx), die die
   umweltfreundlichen
   Investitionen der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   aufzeigen, z. B. für
   den Übergang zu
   einer grünen
   Wirtschaft
- Betriebsausgaben
   (OpEx), die die
   umweltfreundlichen
   betrieblichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   widerspiegeln



nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen. Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

0 % der vom Fonds getätigten Investitionen erfolgten in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

# Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Der Fonds hatte im Bericht nicht angegeben, dass seine Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung entsprechen.

# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

2,12 % des Portfolios waren in nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen investiert, die überwiegend zu einem Umweltziel beitragen.



#### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen? [

74,87 % des Portfolios waren in nachhaltige Investitionen investiert, die überwiegend zu einem sozialen Ziel beitragen.

	1	
1	ALLAN .	
(1)	1	2
U	11-	97
V	And In Concession	1

## Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Diese Kategorie umfasst ergänzende liquide Mittel, Geldmarktinstrumente, Geldmarktfonds und erstattungsfähige Einlagen sowie Absicherungs-Vermögenswerte, die für Treasury-Management-, Defensiv- oder Absicherungszwecke verwendet werden. Derivate sind innerhalb des Portfolios zulässig, um ein effizientes Management der Positionen der Anlageklasse insgesamt zu unterstützen, z. B. die Abschwächung von Zinsschwankungen, die Absicherung gegen Kursrückgänge an den Aktienmärkten oder das Management von Währungsrisiken.

Das Währungsengagement kann sich aus nicht abgesicherten Aktienpositionen oder einer Währungsstrategie ergeben und ist auf entwickelte Märkte oder wichtige Schwellenländer beschränkt.

Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Geschäftsjahr gab es 55 Engagements bei Unternehmen im Portfolio. Diese betrafen 20 Unternehmen in 11 Ländern und deckten eine Reihe von Themen ab.

Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die typischerweise behandelt werden. Der Anlageverwalter aktualisiert seinen Ansatz zur Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	23,28 %	28,57 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	12,93 %	28,57 %
Geschäftsgebaren	Soziales und	5,17 %	0,00 %
Menschenrechte	Beschäftigung	8,62 %	0,00 %

Arbeitsstandards	18,10 %	14,29 %
Öffentliche Gesundheit	1,72 %	0,00 %
Unternehmensführung	30,17 %	28,57 %

# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für den Fonds ist kein Referenzwert in Bezug auf die Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten? Nicht zutreffend.
- Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten? Nicht zutreffend.



Referenzwerten

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

### Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Responsible Global Equity Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800QUBFOSM6S1V262

# Ökologische und/oder soziale Merkmale

die zur Erreichung	
eines Umweltziels oder	Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?
sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass	<ul> <li>Ja</li> <li>X Nein</li> </ul>
diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem       X       Es wurden damit ökologische/soziale         Umweltziel getätigt:%       Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 93,97 % an nachhaltigen Investitionen         in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind       mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch
Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten	<ul> <li>in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>x mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>x mit einem sozialen Ziel</li> <li>Es wurden damit nachhaltige</li> <li>Es wurden damit nachhaltige</li> </ul>
enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige	Investitionen mit einem sozialen       Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen         Ziel getätigt:%       Investitionen getätigt.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die übergeordnete Philosophie des Portfolios lautet:

- Vermeiden von Unternehmen mit umweltschädlichen oder sozial schädlichen Produkten oder nicht nachhaltigen Geschäfts- oder Unternehmensführungspraktiken
- Investieren in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zur Gesellschaft und/oder • Umwelt leisten

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

erreicht werden.

Eine nachhaltige Investition ist eine

Investition in eine Wirtschaftstätigkeit,

Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

 Verbesserung des Managements von ESG-Themen, wobei der Einfluss des Anlageverwalters als Anleger genutzt wird, um durch Engagement und Stimmrechtsausübung bewährte Verfahren zu fördern

Der Fonds hat zwar kein nachhaltiges Ziel, strebt aber an, mindestens 67,5 % nachhaltige Investitionen zu halten.

Der CT (Lux) Responsible Global Equity Fund hat im Berichtszeitraum im Einklang mit seiner Anlagepolitik in Unternehmen investiert. Der Fonds konzentriert sich auf 7 Nachhaltigkeitsthemen, die wiederum gut mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen verknüpft sind. Zum 30.09.2023 wurden 93,97 % in nachhaltigen Investitionen gehalten.

#### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Anlageverwalter verwendet die folgenden Indikatoren, um das Erreichen der vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen:

1) Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen seine Standards verstießen. Vor der Investition wurde jede Position vom Team für verantwortungsvolles Investieren geprüft und für den Kauf genehmigt, wobei die Überprüfung fortlaufend erfolgt.

2) Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet ist

97,1 % des Portfolios waren zum 30.09.2023 auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet:

Thema Nachhaltigkeit	% des Portfolios ausgerichtet <sup>1</sup>
Energiewende	11,5 %
Ressourceneffizienz	10,2 %
Nachhaltige Städte	6,9 %
Gesundheit und Wohlbefinden	22,4 %
Verbinden und Schützen	16,3 %
Digitale Befähigung	20,1 %
Nachhaltige Finanzwirtschaft	9,8 %
Kein Thema / Barmittel	2,9 %
Summe	100,0 %

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Aufgrund von Rundungen kann es vorkommen, dass die Summe der ausgewiesenen Zahlen nicht 100 % ergibt.

3) Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs)

Zum 30.09.2023 waren 93,97 % des Portfolios in Unternehmen investiert, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet sind.

 Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine

Im Geschäftsjahr gab es 51 Engagements bei 29 Unternehmen. Daraus ergaben sich 11 Meilensteine, d. h., ein Unternehmen hat seine Politik und seine Praktiken im Einklang mit den Engagementzielen des Anlageverwalters spürbar verbessert.

Indikator	2023	2022
Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen	0	0
Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet ist	97,1 %	97,8 %
Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs)	93,97 %	92,54 %
Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine	11	16

#### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

# Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Infolge der Nachhaltigkeitsphilosophie des Portfolios wird das Portfolio mindestens 67,5 % (ohne Barmittel, Barmitteläquivalente oder Absicherungsinstrumente) in nachhaltige Investitionen investieren. Zum 30.09.2023 war der Fonds zu 93,97 % in Unternehmen investiert, die mit mehr als 50 % ihres Nettoumsatzes einen positiven Beitrag zu den Zielen für nachhaltige Entwicklung leisten und als nachhaltige Investitionen gelten. Diese Investitionen stehen auch im Einklang mit den nachhaltigen Themen des Fonds, wie unten beschrieben.

Diese Investitionen tragen zu einem nachhaltigen Ziel bei, indem sie einen Beitrag zu zentralen Nachhaltigkeitsthemen mit ökologischem oder sozialem Schwerpunkt leisten, darunter: Energiewende, Gesundheit und Wohlbefinden sowie Ressourceneffizienz. Der Anlageverwalter verwendet einen eigenen Rahmen, um zu beurteilen, inwieweit die Unternehmen der Nachhaltigkeit Priorität einräumen:

• Zusätzlich: Ist das Unternehmen führend in seiner Branche und trägt es wirklich zur positiven Entwicklung der Branche bei? Hier konzentriert sich der Anlageverwalter auf das Engagement des Portfolios in qualitativ hochwertigen, weit verbreiteten Unternehmen und belegt dies durch seine Einschätzung.

• Absicht: Wie wichtig ist die Nachhaltigkeit für die Strategie und die allgemeine Daseinsberechtigung des Unternehmens? In diesem Fall nutzt der Anlageverwalter seine umfassenden Engagement-Fähigkeiten, um die Transparenz und Kommunikation des Unternehmens in Bezug auf die strategischen Ziele zu bewerten, was die Absichten des Managementteams und des Vorstands bei der Priorisierung dieser Themen/Chancen belegen wird.

• Wesentlichkeit: Wie wesentlich sind Nachhaltigkeitschancen für das Unternehmen? Neben der Beurteilung der Umsatzausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung nimmt der Anlageverwalter eine Beurteilung der Umsatzausrichtung des Unternehmens auf sieben Nachhaltigkeitsthemen vor: Umweltverantwortung, Klimawandel, Menschenrechte, Arbeitsstandards, Öffentliche Gesundheit, Geschäftsethik und Unternehmensführung.

#### Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf folgende Weise erheblich beeinträchtigen:

- Das Portfolio schließt gemäß der Ausschlussrichtlinie des Fonds Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.
- Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

 Wie wurden die Indikatoren f
ür nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren ber
ücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS)<sup>2</sup>.

Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle Portfoliobestände und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds sowohl auf qualitativer als auch auf quantitativer Basis keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind. Einzelheiten zum PAI-Engagement sind weiter unten in diesem Bericht aufgeführt.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Berichtszeitraum gab es keine Verstöße.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Die technischen Regulierungsstandards enthalten drei Tabellen mit den von der Europäischen Kommission definierten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen. Die Tabellen decken eine Reihe schädlicher Aktivitäten in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ab.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf verschiedene Weise:

• Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie und die Screening-Kriterien des Fonds, die sich auf die PAI beziehen, einschließlich: fossile Brennstoffe, Biodiversität, Entwaldung, Menschenrechte, globale Normen, gefährliche Abfälle und umstrittene Waffen. Der Fonds befolgte die Ausschlussrichtlinie während des Berichtszeitraums.

• Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI gemäß Tabelle 1 im RTS. Dies ermöglicht es dem Anlageverwalter, schädliche Praktiken zu überwachen, die auftreten können. Im als nachhaltig ausgewiesenen Teil des Fondsportfolios wurden keine schädlichen Praktiken festgestellt.

• Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. Einzelheiten zum PAI-Engagement sind weiter unten in diesem Bericht aufgeführt.

## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023

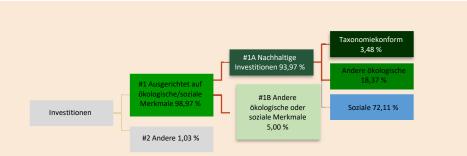
Unternehmen	Sektor	% des Portfolios	Land
Apple Inc	Informations- technologie	7,34	US
Mastercard Inc	Finanzen	4,27	US
Linde Plc	Grundstoffe	3,98	GB
Accenture Plc	Informations- technologie	3,21	IE
Intercontinental Exchange Inc	Finanzen	3,12	US
Nvidia Corp	Informations- technologie	2,96	US
Schneider Electric Se	Industriewerte	2,68	FR
Thermo Fisher Scientific Inc	Gesundheitswesen	2,56	US
Roper Technologies Inc	Informations- technologie	2,56	US
Waste Connections Inc	Industriewerte	2,34	CA

Xylem Inc/Ny	Industriewerte	2,32	US
Asml Holding Nv	Informations- technologie	2,31	NL
Becton Dickinson & Co	Gesundheitswesen	2,25	US
CSL Ltd	Gesundheitswesen	2,2	AU
Aptiv Plc	Zyklische Konsumgüter	2,19	IE

#### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Zum 30.09.2023 waren 93,97 % des Portfolios nachhaltige Investitionen.

Wie sah die Vermögensallokation aus?<sup>3</sup>



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2** Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien: - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

#### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?<sup>3</sup>

Sektor	% des Nettovermögens
Informationstechnologie	31,05

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Hinweis: Aufgrund von Rundungen können sich in der Summe der Zahlen Abweichungen von 0,01 % ergeben.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Gesundheitswesen	20,73
Industriewerte	14,48
Finanzen	14,06
Zyklische Konsumgüter	8,56
Grundstoffe	5,37
Nicht-zyklische Konsumgüter	1,67
Immobilien	1,64
Versorger	1,40
Barmittel und Derivate	1,03

# Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Von den nachhaltigen Investitionen entfallen 3,48 % auf Aktivitäten, die taxonomiekonform sind.

# Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>4</sup>?

	Ja:		
		In fossiles Gas	In Kernenergie
x	Nein		

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles** Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

```
Ermöglichende
Tätigkeiten wirken
unmittelbar
ermöglichend darauf
hin, dass andere
Tätigkeiten einen
wesentlichen Beitrag
zu den Umweltzielen
leisten.
```

#### Übergangstätigkeiten

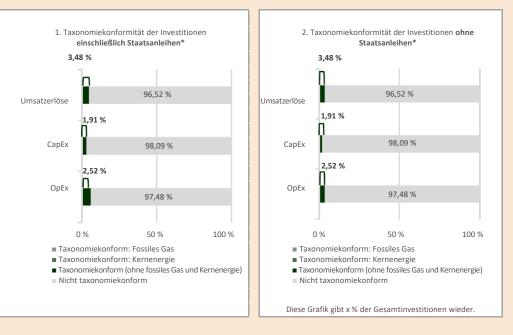
sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- Betriebsausgaben
   (OpEx), die die
   umweltfreundlichen
   betrieblichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Die vom Fonds getätigten Investitionen, die in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung erfolgten, verteilen sich wie folgt:

Ermöglichende Tätigkeiten: 1,70 %

Übergangstätigkeiten: 0 %

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Zuvor hatte der Fonds angegeben, dass 0 % seiner Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung entsprechen.

## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

18,37 % des Portfolios waren in nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen investiert, die überwiegend zu einem Umweltziel beitragen.



nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

72,11 % des Portfolios waren in nachhaltige Investitionen investiert, die überwiegend zu einem sozialen Ziel beitragen.



# Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die als "Andere ökologische/soziale Merkmale" klassifizierten Bestände beziehen sich auf Investitionen, die keine nachhaltigen Investitionen darstellen, aber durch die Einhaltung der Fondsanforderungen zu ökologischen/sozialen Merkmalen beitragen. Diese Investitionen müssen zu den ökologischen/sozialen Merkmalen des Fonds beitragen und die Ausschluss- und Screening-Kriterien auf Fondsebene, einschließlich der guten Unternehmensführung, erfüllen.

Als "Andere Investitionen" eingestufte Bestände beziehen sich auf Barpositionen oder Derivate. Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden. Dies machte 1,03 % des Fonds aus.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Geschäftsjahr gab es 51 Engagements bei Unternehmen im Portfolio. Diese betrafen 29 Unternehmen in 10 Ländern und deckten eine Reihe von Themen ab.

Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die typischerweise behandelt werden. Der Anlageverwalter aktualisiert seinen Ansatz zur Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	20,00 %	36,36 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	13,64 %	9,09 %
Geschäftsgebaren		1,82 %	0,00 %
Menschenrechte	Soziales und Beschäftigung	15,45 %	9,09 %
Arbeitsstandards		26,36 %	36,36 %
Öffentliche Gesundheit		6,36 %	9,09 %
Unternehmensführung		16,36 %	0,00 %



# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für das Portfolio ist kein Referenzwert in Bezug auf die Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

• Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend

## Bei den **Referenzwerten**

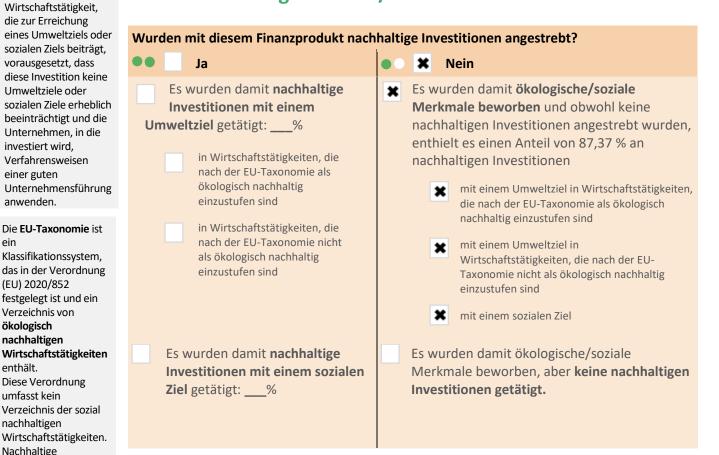
handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

#### Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

# Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) SDG Engagement Global Equity Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800TVDYDJOO2JBG48

# Ökologische und/oder soziale Merkmale



# Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der CT (Lux) SDG Engagement Global Equity Fund hat im Berichtszeitraum im Einklang mit seiner Anlagepolitik in Unternehmen investiert. Der Fonds ist bestrebt, positive Fortschritte bei der Verwirklichung der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen zu erzielen.

Die übergeordnete Philosophie des Portfolios lautet:

 Vermeiden von Unternehmen mit umweltschädlichen oder sozial schädlichen Produkten oder nicht nachhaltigen Geschäfts- oder Unternehmensführungspraktiken

erreicht werden.

Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Eine nachhaltige Investition ist eine

Investition in eine

- Investieren in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zur Gesellschaft und/oder Umwelt leisten
- Verbesserung des Managements von ESG-Themen, wobei der Einfluss des Anlageverwalters als Anleger genutzt wird, um durch Engagement und Stimmrechtsausübung bewährte Verfahren zu fördern

Der Fonds strebt an, mindestens 67,5 % nachhaltige Investitionen zu halten. Zum 30.09.2023 waren 87,37 % des Fonds in nachhaltige Investitionen investiert.

#### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Portfolio investiert unter Verwendung des "Vermeiden, Investieren, Verbessern"-Rahmens des Anlageverwalters. Das Portfolio hält sich an eine Reihe von Ausschlüssen und investiert in nachhaltige Investitionen. Der Fonds strebt ein zielgerichtetes, wirkungsorientiertes, aktives Engagement bei Unternehmen unter Verwendung des Rahmens der Ziele für nachhaltige Entwicklung ("SDGs") an.

Das Portfolio verwendet mehrere Indikatoren, um die Performance anhand dieses Rahmens zu bewerten. Während des Berichtszeitraums war das Portfolio

- in nachhaltige Investitionen investiert, wobei 87,37 % der Positionen einen positiven Umsatzbeitrag zu den SDG-Zielen aufweisen
- Während des Berichtsjahres war das Portfolio in 73 Unternehmen investiert, wobei Engagements bei 35 Unternehmen erfolgten.
- Es wurden 33 Meilensteine erreicht, was bedeutet, dass das Unternehmen eine spürbare Verbesserung seiner Richtlinien und Praktiken in Übereinstimmung mit dem SDG-Engagement-Ziel des Anlageverwalters vorgenommen hat
  - ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	2023	2022
Anteil des Fonds mit mehr als 50 % Nettoumsatz, der positiv auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs) ausgerichtet ist <sup>1</sup>	87,37 %	87,58 %
Die Anzahl der durchgeführten SDG-bezogenen Engagements	73	125
Die Anzahl der erreichten SDG-bezogenen Engagement- Meilensteine	33	19
Anzahl der Unternehmen, bei denen ein Engagement erfolgt ist	35	-
Anzahl der vom Engagement abgedeckten Länder	15	-

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Berechnet als der Anteil des Fonds, der in Emittenten gehalten wird, deren Nettoumsatz zu mehr als 50 % auf die SDGs ausgerichtet ist

# Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Infolge der Nachhaltigkeitsphilosophie des Portfolios wird das Portfolio mindestens 67,5 % (ohne Barmittel, Barmitteläquivalente oder Absicherungsinstrumente) in nachhaltige Investitionen investieren. Zum 30.09.2023 war der Fonds zu 87,37 % in Unternehmen investiert, die mit mehr als 50 % ihres Nettoumsatzes einen positiven Beitrag zu den Zielen für nachhaltige Entwicklung leisten und als nachhaltige Investitionen gelten. Diese Investitionen stehen auch im Einklang mit den nachhaltigen Themen des Fonds, wie unten beschrieben.

Diese Investitionen tragen zu einem nachhaltigen Ziel bei, indem sie einen Beitrag zu zentralen Nachhaltigkeitsthemen mit ökologischem oder sozialem Schwerpunkt leisten, darunter: Energiewende, Gesundheit und Wohlbefinden sowie Ressourceneffizienz.

Der Anlageverwalter verwendet einen eigenen Rahmen, um zu beurteilen, inwieweit die Unternehmen der Nachhaltigkeit Priorität einräumen:

- Zusätzlich: Ist das Unternehmen führend in seiner Branche und trägt es wirklich zur positiven Entwicklung der Branche bei? Hier konzentriert sich der Anlageverwalter auf das Engagement des Portfolios in qualitativ hochwertigen, weit verbreiteten Unternehmen und belegt dies durch seine Einschätzung.
- Absicht: Wie wichtig ist die Nachhaltigkeit f
  ür die Strategie und die allgemeine Daseinsberechtigung des Unternehmens? In diesem Fall nutzt der Anlageverwalter seine umfassenden Engagement-F
  ähigkeiten, um die Transparenz und Kommunikation des Unternehmens in Bezug auf die strategischen Ziele zu bewerten, was die Absichten des Managementteams und des Vorstands bei der Priorisierung dieser Themen/Chancen belegen wird.
- Wesentlichkeit: Wie wesentlich sind Nachhaltigkeitschancen für das Unternehmen? Neben der Beurteilung der Umsatzausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung nimmt der Anlageverwalter eine Beurteilung der Umsatzausrichtung des Unternehmens auf sieben Nachhaltigkeitsthemen vor: Umweltverantwortung, Klimawandel, Menschenrechte, Arbeitsstandards, Öffentliche Gesundheit, Geschäftsethik und Unternehmensführung.

## Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf folgende Weise erheblich beeinträchtigen:

Das Portfolio schließt gemäß der Ausschlussrichtlinie des Fonds Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.

Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS)<sup>1</sup>.

Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle als nachhaltige Investitionen angegebenen Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Bezugszeitraum wurden keine Verstöße gegen die Grundsätze festgestellt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf dreierlei Art und Weise:

- 1) Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie, die vier der PAI abdeckt:
  - i. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Der Fonds hat während des Bezugszeitraums nicht in Unternehmen investiert,

- die geologische Reserven von Kohle/Öl/Gas besitzen. In Übereinstimmung mit dem Net Zero Investment Framework meidet der Anlageverwalter Bergbauunternehmen, die neue Kraftwerkskohle-Projekte planen oder bauen.
- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus der Exploration oder Produktion in Gebieten mit hoher Umweltempfindlichkeit, einschließlich der Arktis, erzielen.
- die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus folgenden Aktivitäten erzielen:
  - Kohlebezogene Aktivitäten, einschließlich Exploration, Förderung, Transport, Vertrieb und Raffination\*<sup>2</sup>.
  - Aktivitäten im Zusammenhang mit der Exploration oder Förderung von unkonventionellem Öl und Gas.
  - Aktivitäten im Zusammenhang mit konventionellem Öl und Gas, einschließlich Exploration, Förderung, Raffination und Transport
- die mehr als 50 % ihres Umsatzes mit Ausrüstungen oder Dienstleistungen für Aktivitäten im Zusammenhang mit Kohle und/oder konventionellem/unkonventionellem Öl und Gas erwirtschaften.
- ii. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
  - Stromversorgungsunternehmen, die Kohle in ihrem Stromerzeugungsmix haben, müssen sich verpflichten, bis 2030 (OECD-Länder) bzw. 2040 (Nicht-OECD-Länder) aus der unverminderten Kohleverstromung auszusteigen. Stromversorgungsunternehmen, die ihre Stromerzeugung auf Kohlebasis strukturell erhöhen, werden ausgeschlossen.
  - Darüber hinaus schloss der Fonds Stromversorgungsunternehmen\* aus, - deren Kohlenstoffintensität mehr als 374 gCO2/kWh beträgt.
    - bei denen mehr als 30 % der Stromerzeugung auf Öl und Gas basieren.
  - Ausschluss von Stromversorgungsunternehmen, bei denen mehr als 5 % der Stromerzeugung auf Kernenergie basieren.
  - Ausschluss von Stromversorgungsunternehmen, die neue Kernkraftwerke bauen.

<sup>\*</sup> Es sei denn, sie haben sich im Rahmen der Science Based Targets Initiative (SBTi) ein Ziel von deutlich unter 2°C gesetzt oder sich zur "Business Ambition for 1.5°C" von SBTi verpflichtet. Hinweis. Die Beteiligung der Unternehmen an Aktivitäten im Zusammenhang mit Kohle und/oder Öl und Gas sollte nicht zunehmen.

- Ausschluss von Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit dem Verkauf von Produkten oder Dienstleistungen an die Kernkraftindustrie erzielen, ausgenommen Unternehmen, die standardmäßige, nicht kundenspezifische oder sicherheitsrelevante Produkte/Dienstleistungen anbieten.
- Ausschluss von Unternehmen, die aktive Uranminen besitzen oder betreiben.
- iii. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die aktiv gegen die UnGC-Grundsätze verstoßen

iv. Engagement in umstrittenen Waffen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Einnahmen aus der Entwicklung, Herstellung oder dem Handel mit umstrittenen Waffen, einschließlich Streumunition und Antipersonenminen, erzielen.

- 2) Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI gemäß Tabelle 1 im RTS. Dies ermöglicht es uns, schädliche Praktiken zu überwachen, die auftreten können. Für die im Portfolio gehaltenen Positionen wurden keine erheblichen schädlichen Praktiken identifiziert.
- 3) Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. So hat der Fonds beispielsweise im Laufe des Jahres bei acht Hauptversammlungen aufgrund von Problemen im Zusammenhang mit Diversität abgestimmt. Mehr als ein Viertel der Engagements bezog sich auf Arbeitnehmerfragen und mehr als 20 % auf Themen des Klimawandels. Weitere Einzelheiten zur Engagement-Aktivität sind in diesem Bericht beschrieben.

## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

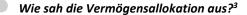
Unternehmen	Sektor	% des Portfolios	Land
Bank Mandiri Persero Tbk Pt	Finanzen	3,85	ID
Waste Connections Inc	Industriewerte	3,7	CA
Tractor Supply Co	Zyklische Konsumgüter	3,25	US
Dnb Bank Asa	Finanzen	3,1	NO
Icon Plc	Gesundheitswesen	3,06	IE
Wolters Kluwer Nv	Industriewerte	3,01	NL
Acuity Brands Inc	Industriewerte	2,9	US
Xylem Inc/Ny	Industriewerte	2,9	US

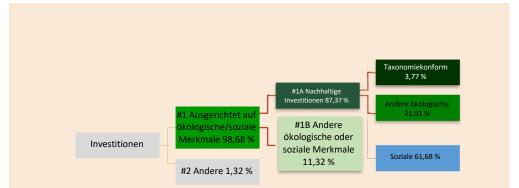
Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023

Netapp Inc	Informationstechnologie	2,89	US
Veolia Environnement Sa	Versorger	2,86	FR
Aptiv Plc	Zyklische Konsumgüter	2,8	IE
Steris Plc	Gesundheitswesen	2,76	IE
Kerry Group Plc	Nicht-zyklische Konsumgüter	2,75	IE
Americold Realty Trust Inc	Immobilien	2,71	US
Halma Plc	Informationstechnologie	2,56	GB

#### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 87,37 % an Investitionen, die als nachhaltig gelten.





**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2** Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien: - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Hinweis: Aufgrund von Rundungen können sich in der Summe der Zahlen Abweichungen von 0,01 % ergeben.

Sektor	% des Nettovermögens⁴
Industriewerte	24,33
Informationstechnologie	15,91
Finanzen	15,88
Gesundheitswesen	14,67
Zyklische Konsumgüter	11,18
Nicht-zyklische Konsumgüter	8,63
Versorger	2,86
Immobilien	2,71
Grundstoffe	2,52
Barmittel und Derivate	1,32

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles** Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

#### Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

#### Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



#### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel sind nicht an die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung gebunden.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 3,77 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.

# Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>5</sup>?



<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Aufgrund von Rundungen kann es vorkommen, dass die Summe der ausgewiesenen Zahlen nicht 100 % ergibt.
<sup>5</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

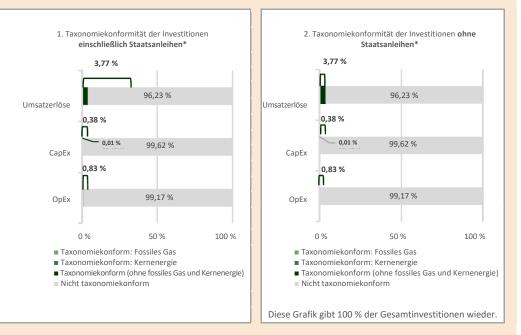


nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- Betriebsausgaben
   (OpEx), die die
   umweltfreundlichen
   betrieblichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die
   investiert wird,
   widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Die vom Fonds getätigten Investitionen, die in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung erfolgten, verteilen sich wie folgt:

Ermöglichende Tätigkeiten: 0,23 %

Übergangstätigkeiten: 0,00 %

# Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Zuvor hatte der Fonds angegeben, dass 0 % seiner Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung entsprechen. In diesem Jahr waren 3,77 % der Investitionen mit der EU-Taxonomie konform.



# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

21,91 % des Portfolios waren in nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen investiert, die überwiegend zu einem Umweltziel beitragen.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

61,68 % des Portfolios waren in nachhaltige Investitionen investiert, die überwiegend zu einem sozialen Ziel beitragen.



## Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Nicht als "Andere Investitionen" eingestufte Bestände beziehen sich nur auf Barpositionen. Die Barpositionen machten 1,32 % des Fonds aus.

Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Obwohl der Fonds nicht in Unternehmen investiert, die erhebliche nachteilige Auswirkungen haben, ist der Anlageverwalter bestrebt, sich bei Unternehmen zu engagieren, um das nachhaltige Ziel des Fonds zu unterstützen.

Während des Berichtsjahres erfolgten 73 Engagements bei 35 Unternehmen im Portfolio, die eine Reihe von Themen abdecken.

In Anbetracht des ausdrücklichen Engagement-Mandats dieses Fonds würden das Team für globale Aktien und das Team für verantwortungsvolles Investieren in Erwägung ziehen, sich von einem Unternehmen zu trennen, das sich zwei Jahre lang einem Engagement verweigert hat und/oder bei dem das Engagement nicht zu einer Dynamik der spürbaren positiven Veränderungen geführt hat.

Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die sie in der Regel betreffen. Der Anlageverwalter aktualisiert die Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	26,23 %	51,52 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	18,58 %	0,00 %
Geschäftsgebaren	Contalas und	3,83 %	0,00 %
Menschenrechte	Soziales und Beschäftigung	10,38 %	6,06 %
Arbeitsstandards		22,95 %	33,33 %
Öffentliche Gesundheit		3,83 %	6,06 %
Unternehmensführung		14,21 %	3,03 %



Der Fonds verwendet keinen Referenzwert in Bezug auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale.

# Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

### Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

# Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Unternehmenskennung (LEI-Code): 2138000A017355A61IW44

# Ökologische und/oder soziale Merkmale

eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt,	Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
vorausgesetzt, dass diese Investition keine	🔎 🔄 Ja 🔷 🗶 Nein			
Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.	<ul> <li>Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem</li> <li>Umweltziel getätigt:%</li> <li>in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 94,85 % an nachhaltigen Investitionen</li> <li>mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch</li> </ul>			
Die <b>EU-Taxonomie</b> ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen	<ul> <li>in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>mit einem sozialen Ziel</li> </ul>			
Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige	<ul> <li>Es wurden damit nachhaltige</li> <li>Investitionen mit einem sozialen</li> <li>Ziel getätigt:%</li> <li>Es wurden damit ökologische/soziale</li> <li>Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen</li> <li>Investitionen getätigt.</li> </ul>			

# Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der CT (Lux) Sustainable Global Equity Enhanced Income Fund hat seit seiner Auflegung im August 2023 in Unternehmen investiert, die seiner Anlagepolitik entsprechen. Der Fonds konzentriert sich auf 7 Nachhaltigkeitsthemen, die wiederum gut mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen verknüpft sind. Seit seiner Auflegung hat der Fonds gemäß der Definition des Anlageverwalters für nachhaltige Investitionen mehr als das Minimum von 90 % an nachhaltigen Investitionen gehalten (siehe Frage 4 für weitere Einzelheiten). Zum 30.09.2023 waren 94,85 % in nachhaltigen Investitionen investiert.

Investitionen mit einem Umweltziel könnten

taxonomiekonform sein oder nicht.

Eine nachhaltige Investition ist eine

Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung

Die übergeordnete Philosophie des Portfolios lautet:

• Vermeiden von Unternehmen mit umweltschädlichen oder sozial schädlichen Produkten oder nicht nachhaltigen Geschäfts- oder Unternehmensführungspraktiken

• Investieren in Unternehmen, die einen positiven Beitrag zur Gesellschaft und/oder Umwelt leisten

• Verbesserung des Managements von ESG-Themen, wobei der Einfluss des Anlageverwalters als Anleger genutzt wird, um durch Engagement und Stimmrechtsausübung bewährte Verfahren zu fördern

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der Anlageverwalter verwendet die folgenden Indikatoren, um das Erreichen der vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen:

1) Die Anzahl der Unternehmen, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen seine Standards verstießen. Vor der Investition wurde jede Position vom Team für verantwortungsvolles Investieren geprüft und für den Kauf genehmigt, wobei die Überprüfung fortlaufend erfolgt.

2) Der prozentuale Anteil des Portfolios, der auf die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen ausgerichtet ist

Wichtige Nachhaltigkeitsthemen	%
Verbinden und Schützen	9,65
Digitale Befähigung	18,34
Energiewende	17,24
Gesundheit und Wohlbefinden	21,33
Ressourceneffizienz	9,19
Nachhaltige Städte	11,18
Nachhaltige Finanzwirtschaft	12,44

3) Ausrichtung des Umsatzes der Unternehmen, in die investiert wird, auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs)

Zum 30.09.2023 waren 94,86 % des Portfolios in Unternehmen investiert, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet sind.

 Die Anzahl der erreichten umwelt- und sozialbezogenen Engagementziele und/oder Meilensteine

Seit Auflegung gab es 20 Engagements bei 7 Unternehmen. Daraus ergaben sich 2 Meilensteine, d. h., ein Unternehmen hat seine Politik und seine Praktiken im Einklang mit den Engagementzielen des Anlageverwalters spürbar verbessert.

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend, dies ist der erste Berichtszeitraum dieses Fonds.

# Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Infolge der Nachhaltigkeitsphilosophie des Portfolios ist das Portfolio verpflichtet, mindestens 90 % (ohne Barmittel, Barmitteläquivalente oder Absicherungsinstrumente) in nachhaltige Investitionen zu investieren. Zum 30.09.2023 war der Fonds zu 94,86 % in Unternehmen investiert, die mit mehr als 50 % ihres Nettoumsatzes einen positiven Beitrag zu den Zielen für nachhaltige Entwicklung leisten und als nachhaltige Investitionen gelten. Diese Investitionen stehen auch im Einklang mit den nachhaltigen Themen des Fonds, wie unten beschrieben.

Diese Investitionen tragen zu einem nachhaltigen Ziel bei, indem sie einen Beitrag zu zentralen Nachhaltigkeitsthemen mit ökologischem oder sozialem Schwerpunkt leisten, darunter: Energiewende, Gesundheit und Wohlbefinden sowie Ressourceneffizienz.

Der Anlageverwalter verwendet einen eigenen Rahmen, um zu beurteilen, inwieweit die Unternehmen der Nachhaltigkeit Priorität einräumen:

• Zusätzlich: Ist das Unternehmen führend in seiner Branche und trägt es wirklich zur positiven Entwicklung der Branche bei? Hier konzentriert sich der Anlageverwalter auf das Engagement des Portfolios in qualitativ hochwertigen, weit verbreiteten Unternehmen und belegt dies durch seine Einschätzung.

• Absicht: Wie wichtig ist die Nachhaltigkeit für die Strategie und die allgemeine Daseinsberechtigung des Unternehmens? In diesem Fall nutzt der Anlageverwalter seine umfassenden Engagement-Fähigkeiten, um die Transparenz und Kommunikation des Unternehmens in Bezug auf die strategischen Ziele zu bewerten, was die Absichten des Managementteams und des Vorstands bei der Priorisierung dieser Themen/Chancen belegen wird.

• Wesentlichkeit: Wie wesentlich sind Nachhaltigkeitschancen für das Unternehmen? Neben der Beurteilung der Umsatzausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung nimmt der Anlageverwalter eine Beurteilung der Umsatzausrichtung des Unternehmens auf sieben Nachhaltigkeitsthemen vor: Umweltverantwortung, Klimawandel, Menschenrechte, Arbeitsstandards, Öffentliche Gesundheit, Geschäftsethik und Unternehmensführung.

# Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf folgende Weise erheblich beeinträchtigen:

Das Portfolio schließt gemäß der Ausschlussrichtlinie des Fonds Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

# — Wie wurden die Indikatoren f ür nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren ber ücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS).

Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Seit Auflegung des Fonds überprüfte das Anlageteam alle Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind. Einzelheiten zum PAI-Engagement sind weiter unten in diesem Bericht aufgeführt.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Berichtszeitraum wurden keine Verstöße festgestellt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz "Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



# Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf verschiedene Weise:

• Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie und die Screening-Kriterien des Fonds, die sich auf die PAI beziehen, einschließlich: fossile Brennstoffe, Biodiversität, Entwaldung, Menschenrechte, globale Normen, gefährliche Abfälle und umstrittene Waffen. Während des Berichtszeitraums hat der Fonds die Ausschlusskriterien beachtet.

• Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI gemäß Tabelle 1 im RTS. Dies ermöglicht es uns, schädliche Praktiken zu überwachen, die auftreten können. Es wurden keine Fälle schädlicher Praktiken im Portfolio identifiziert.

• Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. Weitere Einzelheiten zum Engagement des Anlageverwalters sind in den Angaben näher erläutert.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023

Unternehmen	Sektor	% des Portfolios	Land
Microsoft Corp	Informationstechnologie	4,62	US
Netapp Inc	Informationstechnologie	3,44	US
Daiwa House Industry Co Ltd	Immobilien	3,42	JP
Brookfield Renewable Energy Partners Lp/Ca	Versorger	3,35	BM
Motorola Solutions Inc	Informationstechnologie	3,3	US
Emerson Electric Co	Industriewerte	2,88	US
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Gesundheitswesen	2,86	JP
Ebay Inc	Zyklische Konsumgüter	2,81	US
Linde Plc	Grundstoffe	2,73	GB
Packaging Corp Of America	Grundstoffe	2,68	US
Deutsche Telekom AG	Kommunikationsdienste	2,53	DE
Tokio Marine Holdings Inc	Finanzen	2,48	JP

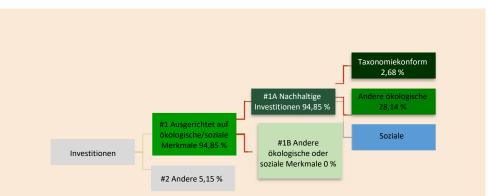
# Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Sse Plc	Versorger	2,43	GB
Johnson Controls International Plc	Industriewerte	2,38	IE
Pfizer Inc	Gesundheitswesen	2,35	US

# Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Fonds hielt 94,85 % an nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen

### Wie sah die Vermögensallokation aus?<sup>1</sup>



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2** Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien: - Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

# Sektor% des NettovermögensInformationstechnologie19,26Gesundheitswesen16,79Industriewerte15,25

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Aufgrund von Rundungen kann es vorkommen, dass die Summe der ausgewiesenen Zahlen nicht 0,01 % ergibt.

Finanzen	13,94
Versorger	7,95
Grundstoffe	7,49
Barmittel und Derivate	5,15
Kommunikationsdienste	4,2
Nicht-zyklische Konsumgüter	3,74
Immobilien	3,42
Zyklische Konsumgüter	2,81

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel sind nicht an die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung gebunden.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 2,68 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.

# Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>2</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

🗙 Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformit ät umfassen die Kriterien für **fossiles** Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

### Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind

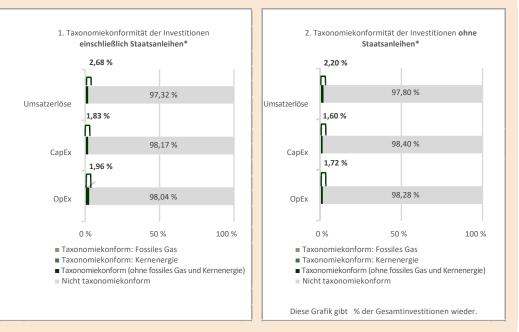
Tätigkeiten, für die es noch keine CO2armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der
   Einnahmen aus umweltfreundlichen
   Aktivitäten der
   Unternehmen, in die investiert wird,
   widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

0 % der vom Fonds getätigten Investitionen erfolgten in Übergangstätigkeiten und 1,14 % erfolgten in ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

# Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Der Fonds hatte zuvor nicht angegeben, dass seine Investitionen den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung entsprechen.



# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

28,14 % war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden



nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



# Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

64,04 % des Portfolios wurden in sozial nachhaltige Investitionen investiert.



# Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Als "Andere Investitionen" klassifizierte Positionen beziehen sich auf Investitionen, die keine nachhaltigen Investitionen darstellen, aber zu den ökologischen/sozialen Merkmalen, Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten beitragen. Diese werden zur Liquiditäts-, Absicherungs- und Ertragsgenerierung gehalten. Zum 30.09.2023 machten diese 5,15 % des Fonds aus.

Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat sich verpflichtet, den Fonds bis 2050 oder früher mit dem Null-Nettoemissionsziel in Einklang zu bringen. Dies baut auf den bestehenden Klimaschutzverpflichtungen des Fonds auf, zu denen der Ausschluss von Unternehmen mit fossilen Brennstoffreserven und das Engagement in Bezug auf Klimachancen und -risiken gehören, das durch die Abstimmungspolitik des Anlageverwalters untermauert wird.

Seit Auflegung gab es 20 Engagements bei 7 Unternehmen. Daraus ergaben sich 2 Meilensteine, d. h., ein Unternehmen hat seine Politik und seine Praktiken im Einklang mit den Engagementzielen des Anlageverwalters spürbar verbessert. Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	22,92 %	50,00 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	20,83 %	0,00 %
Geschäftsgebaren		4,17 %	0,00 %
Menschenrechte	Soziales und	8,33 %	0,00 %
Arbeitsstandards	Beschäftigung	18,75 %	50,00 %
Öffentliche Gesundheit		6,25 %	0,00 %
Unternehmensführung		18,75 %	0,00 %



# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Für das Portfolio ist kein Referenzwert in Bezug auf die Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

# Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

### Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

# Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income Unternehmenskennung (LEI-Code): 213800VPOORXSZ9R2T24

# **Nachhaltiges Investitionsziel**



### Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Der CT (Lux) Sustainable Multi-Asset Income Fund hat im Berichtszeitraum im Einklang mit seiner Anlagepolitik in nachhaltige Aktien, nachhaltige Schuldtitel, nachhaltige Staatsanleihen und nachhaltige Alternativen investiert. Der Fonds investiert in eine Reihe von Themen, die wiederum gut mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen verknüpft sind. Zu diesen Themen gehören unter anderem Gesundheit und Wohlbefinden, die mit SDG 2 und SDG 3 verknüpft sind, sowie die Energiewende, die mit SDG 7 und SDG 13 verknüpft ist. Alle vom Fonds getätigten Investitionen wurden gemäß der Definition des Anlageverwalters für nachhaltige Investitionen als nachhaltig eingestuft. Sollte sich eine Investition in der Folge als nicht nachhaltig erweisen, z. B. aufgrund von Änderungen der Daten oder der Anlagepolitik des Fonds, würde sich der Fonds von diesem Titel trennen.

# Eine nachhaltige

Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird. Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

### Die **EU-Taxonomie** ist ein

Klassifikationssystem. das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Das Portfolio strebt an, dass mindestens 90 % der Investitionen als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 98,92 % nachhaltige Investitionen.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Portfolio investiert ausschließlich in nachhaltige Investitionen, wobei der Anlageverwalter das Konzept "Vermeiden, Investieren, Verbessern" anwendet. Das Portfolio hält sich an eine Reihe von Ausschlüssen und strebt Investitionen ausschließlich in nachhaltige Investitionen an. Der Fonds strebt ein zielgerichtetes, wirkungsorientiertes, aktives Engagement bei Unternehmen unter Verwendung des Rahmens der Ziele für nachhaltige Entwicklung ("SDGs") der Vereinten Nationen an.

Das Portfolio verwendet mehrere Indikatoren, um die Performance anhand dieses Rahmens zu bewerten. Während des Berichtszeitraums war das Portfolio

- 1. nicht in Unternehmen investiert, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios und/oder gegen globale Normen verstoßen haben
- ausschließlich in nachhaltige Investitionen investiert, wobei 98,92 % der Positionen (zum 30.09.2023) eine positive Ausrichtung des Umsatzes auf die SDGs oder eine dedizierte Verwendung von Erlösen, die zu den SDGs beitragen, aufweisen
- 3. Zum 30.09.2023 waren 33,57 % des Portfolios in grünen, nachhaltigkeitsgebundenen oder Anleihen mit einem Label
- 4. Während des Berichtsjahres war das Portfolio in 150 Unternehmen engagiert, wobei Engagements bei 80 Unternehmen in 16 Ländern erfolgten. Es wurden 25 mit ökologischen oder sozialen Zielen verknüpfte Meilensteine von den insgesamt 28 ausgewiesenen Meilensteinen angegeben.

# ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	2023	2022
Desinvestition aufgrund eines Verstoßes gegen Fondskriterien	0	0
Anteil des Fonds, der auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDGs <sup>1</sup> ) ausgerichtet ist, einschließlich Anleihen mit einem Label	98,92 %	93,67 %
Anleihen mit einem Label (z. B. Grün, Sozial, Nachhaltig)	33,57 %	17,9 %
Engagement:		
Unternehmen, bei denen ein Engagement erfolgte	80	91
Engagement-Meilensteine (ökologisch und sozial)	25	33

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Berechnet als der Anteil des Fonds, der in Emittenten gehalten wird, deren Nettoumsatz zu mehr als 50 % auf die SDGs ausgerichtet ist

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

### Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf verschiedene Weisen erheblich beeinträchtigen:

Das Portfolio schließt Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie fossile Brennstoffe und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.

Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden Nachhaltigkeitsrisiken und ESG-Faktoren (einschließlich PAI und gute Unternehmensführung) während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

### Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich obligatorischer Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS)<sup>2</sup>. Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen gekommen ist.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Berichtszeitraum wurden keine Verstöße festgestellt.

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Die technischen Regulierungsstandards enthalten drei Tabellen mit den von der Europäischen Kommission definierten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen. Die Tabellen decken eine Reihe schädlicher Aktivitäten in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ab.



# Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf dreierlei Art und Weise:

- 1. Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie, die vier der PAI abdeckt: Im Berichtszeitraum wurden keine Verstöße festgestellt:
  - i. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen,
    - die geologische Reserven von Kohle/Öl/Gas besitzen. In Übereinstimmung mit dem Net Zero Investment Framework meidet der Anlageverwalter Bergbauunternehmen, die neue Kraftwerkskohle-Projekte planen oder bauen.
    - die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus folgenden Aktivitäten erzielen:
    - Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an externe Parteien
    - Gewinnung und Produktion von Öl/Gas
      - die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus folgenden Aktivitäten erzielen:
    - Vertrieb von und Handel mit Öl/Gas und verwandten Produkten<sup>3</sup>
    - Kohle-/Öl-/Gas-Transport und/oder Öl-/Gas-Pipelines
    - Raffination von Kohle/Öl/Gas
      - die mehr als 50 % ihres Umsatzes mit Ausrüstungen oder Dienstleistungen für Aktivitäten im Zusammenhang mit Kohle/Öl/Gas erwirtschaften<sup>4</sup>.
  - ii. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
    - Der Fonds schließt Stromversorgungsunternehmen aus,
    - die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus folgenden Aktivitäten erzielen:
      - Stromerzeugung auf Kohlebasis<sup>5</sup>
        - Stromerzeugung auf Öl- und Gasbasis<sup>6</sup>
    - die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus auf Kernenergie basierender Stromerzeugung erzielen<sup>7</sup>

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Der Fonds darf Emittenten halten, die die Umsatzschwelle von 5 % überschreiten, wenn sie über robuste Netto-Null-Übergangspläne verfügen, die ihre Produktemissionen abdecken, und/oder Kunden in abgelegenen/ländlichen Gebieten einen wesentlichen Nutzen bieten.

<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Emittenten, die mehr als 5 % ihrer Umsätze aus dem Einsatz und/oder der Produktion von hydraulischen Fracking-Technologien erzielen, werden ausgeschlossen.

<sup>&</sup>lt;sup>5</sup> Bei Stromversorgungsunternehmen, die Strom auf Basis von Kraftwerkskohle erzeugen, muss das Ziel gemäß der Science Based Targets Initiative (SBTi) auf 1,5 Grad Celsius bzw. deutlich unter 2 Grad Celsius festgelegt worden sein. Hinweis. Dieser Kriterienpunkt kann auch Unternehmen aus anderen Sektoren umfassen, die in der Stromerzeugung tätig sind. Insgesamt geht der Anlageverwalter davon aus, dass die Unternehmen ihre Stromerzeugung auf Kohlebasis strukturell verringern werden.

<sup>&</sup>lt;sup>6</sup> Es sei denn, es wurde ein Ziel gemäß der Science Based Targets Initiative (SBTi) von 1,5 Grad Celsius/deutlich unter 2 Grad Celsius festgelegt.

<sup>&</sup>lt;sup>7</sup> Bei Stromversorgungsunternehmen, die Strom auf Basis von Kernenergie erzeugen, muss das Ziel gemäß der Science Based Targets Initiative (SBTi) auf 1,5 Grad Celsius bzw. deutlich unter 2 Grad

- Der Fonds schließt Emittenten aus, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus folgenden Aktivitäten erzielen:
- Lieferung von Schlüsselprodukten oder -dienstleistungen für die Kernkraftindustrie, mit Ausnahme von Standardprodukten, nicht kundenspezifischen oder sicherheitsrelevanten Produkten/Dienstleistungen
- Uranbergbau
- iii. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die aktiv gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen oder eine schlechte ESG-Leistung aufweisen

iv. Engagement in umstrittenen Waffen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Einnahmen aus der Entwicklung, Herstellung oder dem Handel mit umstrittenen Waffen, einschließlich Streumunition und Antipersonenminen, erzielen.

v. Staatsanleihen

Der Fonds investierte nicht in Staatsanleihen von Ländern, die: eine Punktzahl von weniger als 40 von 100 Punkten auf dem Korruptionswahrnehmungsindex von Transparency International erzielten die Einstufung "Not free" (nicht frei) gemäß der Freedom House-Umfrage "Freedom in the World" (Freiheit in der Welt) erhielten

2. Verwendung des PAI-Rahmens zur Strukturierung des DNSH-Modells, um Emittenten anhand aller PAI zu bewerten. Auf diese Weise können wir Emittenten identifizieren, die möglicherweise Praktiken anwenden, die einer nachhaltigen Investition nicht zuträglich sind und daher für eine Investition nicht in Frage kommen würden.

In den Fällen, in denen im Laufe des Jahres Probleme festgestellt wurden, wurden die Investitionen überprüft und es wurde festgestellt, dass sie keinen erheblichen Schaden verursachen.

Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. So standen beispielsweise 28 % der Engagements des Fonds mit Klimawandel-bezogenen Themen im Zusammenhang. Weitere Einzelheiten zu den Engagements sind in diesem Bericht im Abschnitt "Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?" beschrieben.

### Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland	Finanzen	7,65	GB
Vereinigtes Königreich von Großbritannien und Nordirland	Finanzen	4,84	GB
Deutschland (Bundesrepublik)	Finanzen	3,41	DE
Microsoft Corp	Informationstechnologie	1,62	US

Celsius festgelegt worden sein.

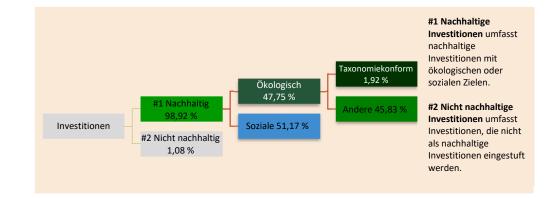
Motorola Solutions Inc	Informationstechnologie	1,16	US
Linde Plc	Grundstoffe	1,08	GB
Netapp Inc	Informationstechnologie	1,08	US
Greencoat Uk Wind Plc/Funds	Versorger	1,03	GB
Renewables Infrastructure Group Ltd/The	Versorger	1,00	GG
Greencoat Renewables Plc	Versorger	0,99	IE
Impact Healthcare Reit Plc	Immobilien	0,96	GB
Vodafone Group Plc	Kommunikationsdienste	0,94	GB
Vh Global Sustainable Energy Opportunities Plc	Finanzen	0,94	GB
Downing Renewables & Infrastructure Trust Plc/Fund	Finanzen	0,94	GB
Triple Point Energy Transition Plc	Finanzen	0,94	GB



# Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 98,92 % an Investitionen, die als nachhaltig gelten.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 98,92 % an Investitionen, die als nachhaltig gelten. Die übrigen 1,08 % entfielen auf Barmittel, Derivate und Währungspositionen.

Der Anlageverwalter betrachtet eine nachhaltige Investition als Investition in Anleihen mit spezifischer Ertragsverwendung, z. B. grüne Anleihen oder Anleihen, die nach Ansicht des Anlageverwalters ein nachhaltiges Ziel finanzieren. Der Anlageverwalter betrachtet nachhaltige Investitionen auch als Investitionen in Emittenten, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die SDGs ausgerichtet sind oder die zu einem nachhaltigen Ziel beitragen, indem sie

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an. Nachhaltigkeit in den wirtschaftlichen Zweck des Unternehmens einbetten (z. B. Erhöhung des Anteils des Umsatzes, der auf Nachhaltigkeitsziele ausgerichtet ist, oder eine Geschäftstätigkeit, die zu einem nachhaltigen Ergebnis beiträgt).

Investitionen müssen auch eine gute Unternehmensführung aufweisen und dürfen keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen verursachen.

Beachten Sie, dass eine Investition zu einem oder mehreren ökologischen oder sozialen Zielen beitragen kann. Die Investitionen wurden auf der Grundlage einer quantitativen Überprüfung des Umsatzengagements aufgeteilt, wobei das Anlageteam und das Team für verantwortungsvolles Investieren zusätzliche Informationen lieferten.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor (GICS)	% des Nettovermögens
Finanzen	33,45
Staatliche Emittenten	15,90
Informationstechnologie	11,65
Gesundheitswesen	10,94
Industriewerte	6,88
Versorger	6,30
Kommunikationsdienste	4,31
Grundstoffe	3,38
Immobilien	2,51
Zyklische Konsumgüter	2,39
Nicht-zyklische Konsumgüter	1,21
Barmittel, Devisen und Derivate	1,08

Übergangstätigkeiten sind

Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen

leisten.

Wirtschaftstätigkeiten,

für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



# Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-**Taxonomie in Einklang gebracht?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel sind nicht an die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung gebunden.

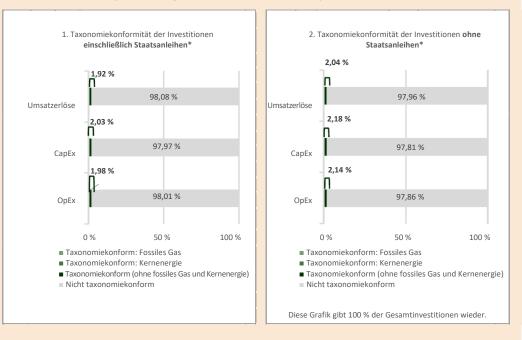
Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, meldet der Fonds, dass 1,92 % seiner Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten erfolgen, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für

# Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme T\u00e4tigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>8</sup>?



Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Bitte beachten Sie, dass sich durch die Rundung der Summen weniger als 100 % ergeben können.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds hatte (zum 30.09.2023) einen Anteil von 1,01 % an ermöglichenden Tätigkeiten und 0,01 % an Übergangstätigkeiten.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlich en Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlich en Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
   Betriebsausgaben
- (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

<sup>&</sup>lt;sup>8</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

## Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Dies ist das erste Jahr, in dem der Fonds den prozentualen Anteil der Investitionen angibt, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Ein Vergleich mit früheren Zeiträumen ist daher nicht möglich.

# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds war zu 45,83 % (zum 30.09.2023) in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert, die nicht im Hinblick auf die EU-Taxonomie bewertet wurden.



sind nachhaltige Investitionen mit

einem Umweltziel.

die die Kriterien für

Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

ökologisch

nachhaltige

# Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds hatte 51,17 % (per 30.09.2023) in nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fallen unter "nicht nachhaltige Investitionen", welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Als nicht nachhaltig eingestufte Positionen beziehen sich nur auf Barmittel, Derivate und Währungspositionen. Diese werden zu Liquiditäts- und Absicherungszwecken gehalten. Diese machten 1,08 % des Fonds aus. Bei der Investition in Barmittel und Derivate berücksichtigt der Anlageverwalter ESG-Faktoren im Rahmen der Kontrahentenauswahl.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Im Jahr 2021 verpflichtete sich der Fonds, den Sustainable Multi-Asset Income Fund bis 2050 oder früher auf ein Netto-Null-Emissionsziel auszurichten. Dies baut auf den bestehenden Klimaschutzverpflichtungen des Fonds auf, zu denen der Ausschluss von Unternehmen mit fossilen Brennstoffreserven, das Engagement in Bezug auf Klimachancen und -risiken, das durch die Abstimmungspolitik des Anlageverwalters untermauert wird, sowie Investitionen in Lösungsanbieter gehören.

Obwohl der Fonds nicht in Unternehmen investiert, die erhebliche nachteilige Auswirkungen haben, ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass er sich dennoch bei solchen Unternehmen engagieren sollte, um das nachhaltige Ziel des Fonds zu unterstützen. Im Geschäftsjahr gab es 150 Engagements bei Unternehmen im Portfolio. Diese betrafen 80 Unternehmen in 16 Ländern und deckten eine Reihe von Themen ab.

Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die sie in der Regel betreffen. Der Anlageverwalter aktualisiert seine Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	28,43 %	57,14 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	15,38 %	7,14 %
Geschäftsgebaren		3,01 %	0,00 %
Menschenrechte		11,71 %	3,57 %
Arbeitsstandards	Soziales und Beschäftigung	17,06 %	14,29 %
Öffentliche Gesundheit		8,70 %	7,14 %
Unternehmensführung		15,72 %	10,71 %



# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Der Anlageverwalter verwendet keinen Referenzwert in Bezug auf das nachhaltige Investitionsziel des Portfolios.

# Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Nicht zutreffend

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

### Anhang II - Regelmäßige Offenlegung gemäß SFDR (ungeprüft)

# Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: CT (Lux) Sustainable Opportunities European Equity

Unternehmenskennung (LEI-Code): 21380012XH3WOKJOYQ92

# **Nachhaltiges Investitionsziel**

diese Investition keine Umweltziele oder	Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?		
sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die	Ia Ia	Nein	
Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 27,20 %	Es wurden damit <b>ökologische oder soziale</b> <b>Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es% an nachhaltigen Investitionen	
Die <b>EU-Taxonomie</b> ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten	<ul> <li>nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul>	<ul> <li>mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU- Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li>mit einem sozialen Ziel</li> </ul>	
enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Limweltziel	<ul> <li>Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 70,74 %</li> </ul>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber <b>keine nachhaltigen</b> Investitionen getätigt.	



Eine nachhaltige

Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder

sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass

Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten

taxonomiekonform sein oder nicht.

# Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Produkt investiert in europäische Aktien, bei denen der Anlageverwalter sieben Schlüsselthemen identifiziert hat, die seiner Meinung nach zu einer größeren Nachhaltigkeit beitragen, z. B. Gesundheit und Wohlbefinden oder nachhaltige Städte. Der Anlageverwalter verknüpft diese Themen mit den Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs), und von jeder Investition wird erwartet, dass sie einen positiven Beitrag zu den SDGs gemäß der Definition des Anlageverwalters einer nachhaltigen Investition leistet.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden. Das Portfolio strebt an, dass mindestens 90 % der Investitionen als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 97,94 % nachhaltige Investitionen.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Das Portfolio investiert ausschließlich in nachhaltige Investitionen, wobei der Anlageverwalter das Konzept "Vermeiden, Investieren, Verbessern" anwendet. Das Portfolio hält sich an eine Reihe von Ausschlüssen, investiert ausschließlich in nachhaltige Investitionen, die mit den Themen des Portfolios übereinstimmen, und engagiert sich bei Emittenten im Hinblick auf ESG-Faktoren.

Das Portfolio verwendet mehrere Indikatoren, um die Performance anhand dieses Rahmens zu bewerten. Während des Berichtszeitraums war das Portfolio

- 1. nicht in Unternehmen investiert, die gegen die Ausschlusskriterien des Portfolios verstoßen haben
- 2. in die wichtigsten Nachhaltigkeitsthemen des Portfolios investiert, wie nachfolgend beschrieben:

Verbinden und Schützen	5,33 %
Digitale Befähigung	17,04 %
Energiewende	9,41 %
Gesundheit und Wohlbefinden	23,63 %
Ressourceneffizienz	11,85 %
Nachhaltige Städte	10,16 %
Nachhaltige Finanzwirtschaft	20,52 %

- 3. zu 90,25 %<sup>1</sup> des Portfolios in Unternehmen investiert, deren Nettoumsatz zu über 50 % auf die Zielen für nachhaltige Entwicklung ausgerichtet war.<sup>2</sup>
- 4. in 40 Unternehmen mit Engagements in ökologischen und sozialen Themen investiert, die Folgendes repräsentieren:
  - 20 Unternehmen in 9 Ländern, bei denen ein Engagement erfolgte
  - 8 erreichte Meilensteine, was bedeutet, dass das Unternehmen eine spürbare Verbesserung seiner Richtlinien und Praktiken in Übereinstimmung mit dem Engagement-Ziel des Anlageverwalters vorgenommen hat

<sup>&</sup>lt;sup>1</sup> Gemessen am 30. September 2023

<sup>&</sup>lt;sup>2</sup> Beachten Sie, dass zusätzliche Investitionen, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden, auf dem Weg zu einem Umsatzwachstum von mehr als 50 % sein können oder einen wirtschaftlichen Beitrag zu einem nachhaltigen Ziel leisten, der nicht auf der Ausrichtung des Umsatzes auf die SDGs beruht.

### ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Indikator	2023	2022
Ausschluss-Verstöße	0	0
Gehaltene nachhaltige Investitionen (ohne Barmittel oder Liquiditätspositionen)	100 %	100 %
Aufschlüsselung der Nachhaltigkeitsthemen		
Verbinden und Schützen	5,33 %	5,75 %
Digitale Befähigung	17,04 %	
		14,53 %
Energiewende	9,41 %	6,50 %
Gesundheit und Wohlbefinden	23,63 %	31,88 %
Ressourceneffizienz	11,85 %	12,68 %
Nachhaltige Städte	10,16 %	11,17 %
Nachhaltige Finanzwirtschaft	20,52 %	14,85 %
Anteil des Fonds, der auf die Ziele für	90,25 %	94,03 %
nachhaltige Entwicklung (SDGs <sup>3</sup> ) ausgerichtet ist		
Engagement		
Unternehmen, bei denen ein Engagement erfolgte	20	19
Engagement-Meilensteine	8	4

# Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Anlageansatz des Portfolios stellt sicher, dass die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen andere nachhaltige Investitionsziele nicht auf verschiedene Weisen erheblich beeinträchtigen:

Das Portfolio schließt Investitionen aus, die dem Ziel zuwiderlaufen, einen positiven Beitrag für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu leisten. Diese Kriterien sind produkt- und verhaltensbasiert und decken Themen wie Tabak und Waffen sowie Verstöße gegen den Globalen Pakt der Vereinten Nationen ab.

Durch das Investment-Research des Anlageverwalters werden ESG-Faktoren während des gesamten Anlagezyklus berücksichtigt, was dazu dient, die Risiken eines erheblichen Schadens zu mindern. Es werden Unternehmen identifiziert, die nach Ansicht des Anlageverwalters von einem aktiven Engagement profitieren könnten, um wesentliche ESG-Probleme anzugehen, die zwar bestehen, aber nicht als sehr schädlich angesehen werden.

Der Anlageverwalter wird sich von Beteiligungen trennen, die sich auf der Grundlage der Anlagepolitik des Fonds nicht mehr für eine Investition eignen. Im Laufe des Jahres wurde auf dieser Grundlage keine Veräußerung vorgenommen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

<sup>&</sup>lt;sup>3</sup> Berechnet als der Anteil des Fonds, der in Emittenten gehalten wird, bei denen mehr als 50 % des Nettoumsatzes positiv auf die SDGs ausgerichtet sind

# Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Investitionen, die als nachhaltige Investitionen ausgewiesen werden, wurden anhand eines internen datengesteuerten Modells und einer Due-Diligence-Prüfung durch das Anlageteam daraufhin geprüft, dass sie die Nachhaltigkeitsziele nicht erheblich beeinträchtigen (do not significantly harm, DNSH).

Der Anlageverwalter identifiziert Beeinträchtigungen anhand quantitativer Schwellenwerte für eine Reihe von Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, einschließlich aller obligatorischen Indikatoren aus Tabelle 1 und bestimmter Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der technischen Regulierungsstandards (RTS). Emittenten, die diese Schwellenwerte unterschreiten, werden als potenziell schädlich eingestuft und es wird dann geprüft, ob der Emittent erhebliche Beeinträchtigungen verursacht. Wenn keine quantitativen Daten zur Verfügung stehen, bemühen sich die Anlageteams, durch qualitative Online-Recherchen oder durch Engagement bei den Emittenten sicherzustellen, dass es zu keinen erheblichen Beeinträchtigungen jekommen ist.

Je nach Wesentlichkeit des Indikators für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wird der Anlageverwalter den Emittenten entweder ausschließen oder in begrenzten Fällen versuchen, mit dem Emittenten zusammenzuarbeiten, um die schädlichen Praktiken durch geeignete Maßnahmen zu beseitigen.

Im Laufe des Jahres 2023 überprüfte das Anlageteam alle Portfoliobestände anhand des Modells und besprach die Ergebnisse mit dem Team für verantwortungsvolles Investieren. Es wurde dabei festgestellt, dass im Fonds sowohl qualitativ als auch quantitativ keine wichtigen nachteiligen Auswirkungen aufgetreten sind.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Der Fonds verbietet ausdrücklich Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen. Darüber hinaus werden die nachhaltigen Investitionen im Rahmen der DNSH-Due-Diligence-Prüfung anhand von Faktoren bewertet, die sich an den UNGC-Grundsätzen und OECD-Leitlinien orientieren, um erhebliche schädliche Praktiken zu ermitteln. Im Berichtszeitraum wurde nicht gegen Ausschlüsse verstoßen.



# Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte PAI auf dreierlei Art und Weise:

- 1) Durch Ausrichtung auf die Ausschlussrichtlinie, die vier der PAI abdeckt:
- i. Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen,

die geologische Reserven von Kohle/Öl/Gas besitzen.

- die mehr als 0 % ihres Umsatzes aus der arktischen Öl- und/oder Gasproduktion erwirtschaften
- die mehr als 50 % ihres Umsatzes aus der Öl- und/oder Gasraffination erwirtschaften
- die mehr als 50 % ihres Umsatzes aus anderen öl- und gasbezogenen Aktivitäten, einschließlich Vertrieb/Einzelhandel, erwirtschaften
- die mehr als 50 % ihres Umsatzes aus Ausrüstung und Dienstleistungen für fossile Brennstoffe und Transport erwirtschaften
- ii. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen

Der Fonds investierte nicht in Stromversorgungsunternehmen,

- bei denen mehr als 10 % der Stromerzeugung auf Kohle basieren
- bei denen mehr als 30 % der Stromerzeugung auf Öl und Gas basieren
- bei denen mehr als 5 % der Stromerzeugung auf Kernenergie basieren
- die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Bereitstellung wichtiger Produkte/Dienstleistungen f
  ür die Kernkraftindustrie erzielen
- die aktive Uranminen betreiben
- iii. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die aktiv gegen die UNGC-Grundsätze oder die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) verstoßen

iv. Engagement in umstrittenen Waffen

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Einnahmen aus der Entwicklung, Herstellung oder dem Handel mit umstrittenen Waffen, einschließlich Streumunition und Antipersonenminen, erzielen.

- 2) Nutzung des PAI-Rahmens zur Überprüfung von Emittenten anhand von PAI gemäß Tabelle 1 im RTS. Dies ermöglicht es uns, schädliche Praktiken zu überwachen, die auftreten können. Für die im Portfolio gehaltenen Positionen wurden keine erheblichen schädlichen Praktiken identifiziert.
- Die PAI stehen im Einklang mit den vom Fonds durchgeführten Stewardship-Aktivitäten. Weitere Einzelheiten zur Engagement-Aktivität sind in diesem Bericht beschrieben.

# Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die		
folgenden		
Investitionen, auf die		
der größte Anteil		
der im		
Bezugszeitraum		
getätigten		
Investitionen des		
Finanzprodukts		
entfiel: 1. Oktober		
2022 bis 30.		
September 2023		

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Novo Nordisk A/S	Gesundheitswesen	5,98	DK
ASML Holding Nv	Informationstechnologie	4,83	NL

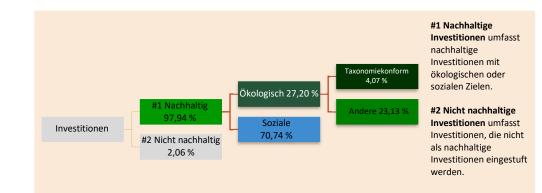
Astrazeneca Plc	Gesundheitswesen	4,67	GB
SAP Se	Informationstechnologie	4,48	DE
Schneider Electric Se	Industriewerte	4,1	FR
Air Liquide Sa	Grundstoffe	3,64	FR
Deutsche Boerse AG	Finanzen	3,59	DE
Roche Holding AG	Gesundheitswesen	3,56	СН
DNB Bank Asa	Finanzen	3,24	NO
Relx Plc	Industriewerte	3,17	GB
Legal & General Group Plc	Finanzen	3,11	GB
Cairn Homes Plc	Zyklische Konsumgüter	3,09	IE
SSE PIC	Versorger	3,08	GB
Kerry Group Plc	Nicht-zyklische Konsumgüter	3,07	IE
UBS Group AG	Finanzen	3,06	СН



# Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Zum 30.09.2023 hielt der Fonds 97,94 % an Investitionen, die als nachhaltig gelten.

# Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	In % der Vermögenswerte
Finanzen	24,11
Industriewerte	21,31
Gesundheitswesen	18,05
Informationstechnologie	11,29
Grundstoffe	11,01
Zyklische Konsumgüter	4,83
Nicht-zyklische Konsumgüter	4,25
Versorger	3,08

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Von den nachhaltigen Investitionen entfallen 4,07 % auf Aktivitäten, die taxonomiekonform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>4</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

🗶 Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

# Übergangstätigkeiten sind

Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>&</sup>lt;sup>4</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels ("Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

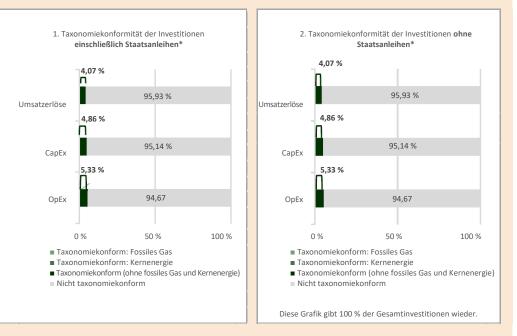


nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.





Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff "Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Die vom Fonds getätigten Investitionen, die in Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung erfolgten, verteilen sich wie folgt:

Ermöglichende Tätigkeiten: 3,94 %

Übergangstätigkeiten: 0,03 %

# Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Bisher waren 0 % der getätigten Investitionen mit der EU-Taxonomie konform.

# Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds war zu 23,13 % (zum 30.09.2023) in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel investiert, die nicht mit der EU-Taxonomie konform waren.



# Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds hatte 70,74 % (per 30.09.2023) in nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.



# Welche Investitionen fallen unter "nicht nachhaltige Investitionen", welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Als nicht nachhaltig eingestufte Positionen beziehen sich nur auf Barpositionen. Die Barmittel machten zum 30.09.2023 2,06 % des Fonds aus.

Es wird bei Barpositionen und Derivaten ein ökologischer oder sozialer Mindestschutz gewährleistet, indem ESG-spezifische Überlegungen in die Risikobewertung der Gegenpartei einbezogen werden.



# Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Obwohl der Fonds nicht in Unternehmen investiert, die erhebliche nachteilige Auswirkungen haben, ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass er sich dennoch bei solchen Unternehmen engagieren sollte, um das nachhaltige Ziel des Fonds zu unterstützen.

Im Geschäftsjahr gab es 40 Engagements bei Unternehmen im Portfolio. Diese betrafen 20 Unternehmen in 9 Ländern und deckten eine Reihe von Themen ab.

Die Engagements sind entsprechend der Engagementthemen des Unternehmens strukturiert, die sich an den PAI orientieren. Nachfolgend finden Sie eine Aufschlüsselung der durchgeführten Engagements und der PAI-Kategorien, die sie in der Regel betreffen. Der Anlageverwalter aktualisiert die Verfolgung des Engagements und die Berichterstattung, um eine PAI-Berichterstattung auf Indikatorebene zu ermöglichen. Es wird darauf hingewiesen, dass ein Engagement mit einer Reihe von PAI-Indikatoren korrelieren kann.

Engagements nach Thema	Ausrichtung an PAI	Anteil der Engagements	Erreichte Meilensteine nach Thema
Klimawandel	THG-Emissionen und Energieeffizienz	21,84 %	25,00 %
Umweltverantwortung	Biodiversität, Wasser, Abfall	17,24 %	0,00 %
Geschäftsgebaren		1,15 %	0,00 %
Menschenrechte	Soziales und Beschäftigung	13,79 %	12,50 %
Arbeitsstandards		13,79 %	25,00 %
Öffentliche Gesundheit		12,64 %	12,50 %
Unternehmensführung		19,54 %	25,00 %



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

# Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Der Fonds richtet sich nicht nach einem nachhaltigen Referenzwert.

Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?

Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten? Nicht zutreffend.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?
 Nicht zutreffend.

# ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

Einrichtung in Deutschland gemäß Richtlinie EU 2019/1160, Artikel 92:

CACEIS Bank S.A. Niederlassung Deutschland Lilienthalallee 36 80939 München Deutschland

hat die Funktion des Facility Agent in der Bundesrepublik Deutschland übernommen (der "Facility Agent").

Anleger in der Bundesrepublik Deutschland können Rücknahme- und Umtauschanträge für Anteile der Portfolios, die in der Bundesrepublik Deutschland vertrieben werden dürfen, beim Facility Agent zur Weiterleitung an die Verwaltungsstelle der Gesellschaft einreichen.

Alle Zahlungen an Anleger in der Bundesrepublik Deutschland (Rücknahmeerlöse, etwaige Auszahlungen oder sonstige Zahlungen) können über den Facility Agent überwiesen werden

Der Verkaufsprospekt, die Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte ("PRIIP KID"), die Satzung der Gesellschaft sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind beim Facility Agent während der üblichen Geschäftszeiten kostenlos und in Papierform erhältlich.

Ebenso sind die Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreise der Anteile des Portfolios sowie etwaige Mitteilungen an die Anleger in der Bundesrepublik Deutschland und die zwischen der Depotbank und der Gesellschaft geschlossenen Verträge zu Referenzzwecken kostenlos erhältlich.

### Veröffentlichungen

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden auf der folgenden Website veröffentlicht: <u>www.vwd.com</u> Bekanntmachungen an die Anleger in der Bundesrepublik Deutschland werden im Bundesanzeiger (<u>www.bundesanzeiger.de</u>) veröffentlicht.

Columbia Threadneedle (Lux) III, 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg Telefon 00 352 46 40 10 1 Fax 00 352 46 36 31



© 2023 Columbia Threadneedle Investments. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia und Threadneedle Unternehmensgruppe für Marketingzwecke. Im Vereinigten Königreich: Herausgegeben von Columbia Threadneedle Management Limited, die von der Financial Conduct Authority zugelassen ist und reguliert wird. Im EWR: Herausgegeben von Columbia Threadneedle Netherlands B.V., die von der niederländischen Finanzmarktaufsicht (AFM) reguliert wird. In der Schweiz: Herausgegeben von Columbia Threadneedle Investments (Swiss) GmbH, die als Vertretung von Columbia Threadneedle Management Limited fungiert.