

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

Kontaktdaten

Tel: +352 46 40 10 7190*

columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com

* Bitte beachten Sie, dass Anrufe und elektronische

Kommunikation aufgezeichnet werden können.

IFDS, 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

Wichtige Daten

Fondsmanager:



Tammie Tang

Seit Juni 22

Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.

Umbrella-Fonds: Columbia Threadneedle (Lux) I

SFDR-Kategorie: Artikel 9

Auflegungsdatum des

23.05.17

Fonds:

Index: ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50%), ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50%)

Vergleichsgruppe:

-

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Luxemburg

Ex-Dividendendatum: Vierteljährlich

Zahlungsdatum: Vierteljährlich

Fondsvolumen: €489,4m

Anzahl der Wertpapiere: 248

Preis der Anteilsklasse: 8,7721

Alle Angaben in EUR

Am 20. November 2023 wurde der Fondsname von

Threadneedle (Lux) - European Social Bond zu CT (Lux)

European Social Bond geändert.

Ratings/Auszeichnungen



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

Anlageziel und -politik

Der Fonds zielt darauf ab, Erträge zu erzielen, die das Potenzial haben, den von Ihnen investierten Betrag mittelfristig zu erhöhen, indem er in Anleihen investiert, von denen angenommen wird, dass sie sozial vorteilhafte Aktivitäten und Entwicklungen vorwiegend in Europa (einschließlich des Vereinigten Königreichs) unterstützen oder finanzieren.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Fonds mindestens 90 % seines Nettovermögens in Anleihen (die einem Darlehen ähnlich sind und einen festen oder variablen Zinssatz zahlen), die von Unternehmen, Regierungen, Freiwilligen- und/oder Wohltätigkeitsorganisationen begeben werden. Der Fonds wird hauptsächlich in Investment-Grade-Anleihen investieren, kann jedoch bis zu 10 % seines Nettovermögens in Anleihen unter Investment-Grade investieren. Anleihen mit Investment Grade (gemäß den internationalen Agenturen, die diese Ratings vergeben) gelten als sicherer als Anleihen mit niedrigerem Rating, erbringen jedoch in der Regel geringere Erträge.

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

Der Fondsmanager wählt nur Anleihen aus, die auf Grundlage der Sozialrating-Methodik des Fonds als soziale Investitionen eingestuft sind, und stellt sicher, dass die Emittenten dieser Anleihen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Die sozialen Ergebnisse der Investitionen werden von einem sozialen Beratungsausschuss (SAP) überprüft. Der SAP genehmigt einen Bericht über die sozialen Auswirkungen, der jährlich erstellt und den Anteilhabern zur Verfügung gestellt wird.

Der Fonds schließt Emittenten aus, die bestimmte Einnahmen aus Branchen oder Aktivitäten erzielen, bei denen der Fondsmanager der Ansicht ist, dass sie minimale soziale Vorteile bieten oder ein hohes Risiko negativer Ergebnisse aufweisen. Eine Investition kann jedoch in Anleihen eines Emittenten, der anderenfalls nach den oben genannten Kriterien ausgeschlossen wäre, erfolgen, soweit die Anleiherlöse für bestimmte Zwecke vorgesehen sind (wie grüne, soziale oder nachhaltige Anleihen). Er schließt außerdem Emittenten aus, bei denen Verstöße gegen internationale Standards und Grundsätze festgestellt wurden.

Der Fondsmanager arbeitet mit Emittenten zusammen, um ihren sozialen Wert besser zu verstehen und positiv zu beeinflussen. Columbia Threadneedle Investments ist Unterzeichner der Net Zero Asset Managers Initiative und hat sich verpflichtet, bis 2050 oder früher Netto-Null-Emissionen für eine Reihe von Vermögenswerten, einschließlich des Fonds, zu erreichen. Der Fondsmanager nutzt sein proaktives Engagement, um dabei zu helfen, dies voranzutreiben, und kann von denjenigen, die die Mindeststandards nicht erfüllen, desinvestieren.

Der Fonds wird nicht in Bezug auf einen Referenzwert verwaltet. Der ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50 %) und der ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50 %) werden als Bezugspunkte herangezogen, mit denen die finanzielle Leistung des Fonds verglichen werden kann. Der Fonds unterliegt keinen Beschränkungen in Bezug auf den Vergleichsindex und es wird erwartet, dass er aufgrund der Anwendung der Sozialrating-Methodik eine erhebliche Abweichung vom Index aufweist.

Weitere Informationen zu den Anlagerichtlinien des Fonds und seinem nachhaltigen Investitionsziel sind in der Richtlinie für soziale Investitionen und im SFDR RTS-Anhang des Prospekts zu finden, die beide unter www.columbiathreadneedle.com verfügbar sind. Der Fonds fällt in den Anwendungsbereich von Artikel 9 der SFDR.

Wesentliche Risiken

- Der Wert von Anlagen kann fallen und steigen und Anleger könnten den ursprünglich investierten Betrag nicht zurückerhalten.
- Der Fonds strebt an, in Vermögenswerten zu investieren, die als Unterstützung und Finanzierung für sozial vorteilhafte Aktivitäten und Entwicklungen angesehen werden, und verwendet eine soziale Rating-Methodik. Dies wird das Engagement des Fonds in bestimmten Emittenten, Branchen, Sektoren und Regionen beeinflussen und kann sich positiv oder negativ auf die relative Performance des Fonds auswirken.
- Bei Anlagen in Vermögenswerten, die auf verschiedene Währungen oder auf andere Währungen als Ihre eigene lauten, kann der Anlagewert durch Wechselkursänderungen beeinflusst werden.
- Der Fonds investiert in Wertpapiere, deren Wert stark beeinträchtigt würde, falls der jeweilige Emittent die Auszahlung verweigert oder zahlungsunfähig wird oder als zahlungsunfähig angesehen wird.
- Der Fonds hält Vermögenswerte, die eventuell schwer zu verkaufen sein könnten. Der Fonds muss eventuell den Verkaufspreis senken, andere Anlagen verkaufen oder auf attraktivere Anlagemöglichkeiten verzichten.
- Es ist wahrscheinlich, dass Zinssatzveränderungen den Wert des Fonds beeinflussen werden. Im Allgemeinen sinkt der Wert einer festverzinslichen Anleihe, wenn die Zinssätze steigen, und umgekehrt.
- Die objektive Bewertung der Vermögenswerte des Fonds ist möglicherweise manchmal schwierig und der tatsächliche Wert ist nicht erkennbar, bis die Vermögenswerte verkauft werden.
- Der Fonds kann in Derivate investieren (komplexe Instrumente, die an den Anstieg und Rückgang des Wertes anderer Vermögenswerte gekoppelt sind), mit dem Ziel, das Risiko zu reduzieren oder die Transaktionskosten zu minimieren. Solche Derivatgeschäfte können die Wertentwicklung des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Der Manager beabsichtigt nicht, dass sich ein solcher Einsatz von Derivaten auf das Gesamtrisiko des Fonds auswirkt.
- Der Fonds kann eine starke Kursvolatilität aufweisen.
- Die derzeit als für den Fonds maßgeblich identifizierten Risiken sind im Prospekt im Abschnitt „Risikofaktoren“ dargelegt.

Anlageansatz

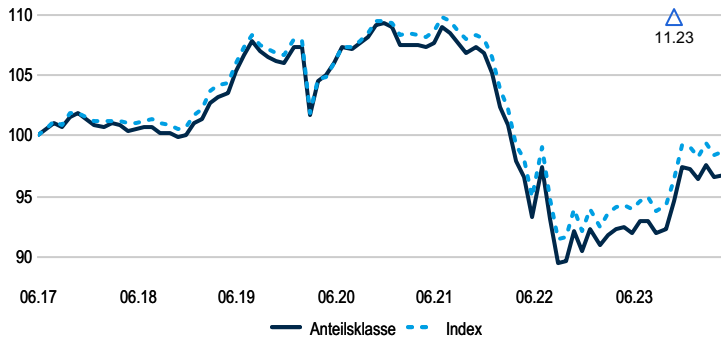
Wir verwenden einen ergebnisorientierten Ansatz, um sowohl soziale als auch finanzielle Renditen zu erzielen, und investieren in Unternehmen mit positiven sozialen Auswirkungen vorwiegend in Europa, wobei wir auf ein breites soziales Universum mit ca. 2.000 Anleihen zugreifen. Wir suchen aktiv nach Anleihen aus sieben zentralen Bereichen der sozialen Entwicklung, wobei wir uns auf die nützlichsten Projekte in den bedürftigsten Gebieten konzentrieren, wobei die geografische Lage eine wichtige Rolle spielt.

Die in Frage kommenden Anlagen werden von unseren Analysten für verantwortungsvolles Investment sowohl nach ihrer Wirkungskategorie als auch nach ihrer sozialen Intensität eingestuft. Unsere Research-Analysten für Investment-Grade-Anleihen stellen sicher, dass Anlageideen strikte Finanztests für die Aufnahme in das Portfolio bestehen. Wir kommunizieren aktiv mit den Unternehmensleitungen, um zu ergründen, wie ihre Geschäfte funktionieren, und wir übernehmen eine proaktive Rolle sowohl bei Unternehmen als auch bei Regierungen im Hinblick auf das Wachstum und die Entwicklung des Marktes für Sozialanleihen. Unser sozialer Partner, die INCO-Gruppe, bringt ihr Fachwissen und ihren Ruf ein, indem sie das Research der sozialen Auswirkungen potenzieller Anlagen vertieft; unsere sozialen Beurteilungen mithilfe eines vierteljährlich tagenden sozialen Beratungsgremiums überprüft, berät und überwacht; und einen unabhängigen Jahresbericht erstellt.

Wertentwicklung

Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Ergebnisse schließen. Die Rendite Ihrer Anlage kann sich aufgrund von Währungsschwankungen ändern, wenn Ihre Anlage in einer anderen Währung erfolgt als derjenigen, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde.

NIW seit Auflegung (EUR)



Wesentliche Ereignisse

△ Bezeichnet ein wesentliches Ereignis. Ausführliche Informationen zu Fondsänderungen finden Sie im PDF „Wesentliche Ereignisse – Columbia Threadneedle Luxemburg-domizilierten SICAV-Fonds“, verfügbar unter <https://www.columbiathreadneedle.com/en/changes>

Wertentwicklung im Kalenderjahr (EUR)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Anteilsklasse (netto)	7,6	-15,3	-2,2	3,2	5,8	-1,3	--	--	--	--
Fonds (brutto)	8,0	-15,0	-1,9	3,5	6,1	-0,8	--	--	--	--
Index (brutto)	7,5	-14,5	-1,5	2,7	5,7	-0,8	--	--	--	--

Annualisierte Wertentwicklung (EUR)

	1M	3M	6M	Seit JB	1 J	2 J	3 J	5 J	Seit Aufl.
Anteilsklasse (netto)	0,1	0,3	2,3	-0,6	4,6	0,1	-3,4	-1,3	-0,5
Fonds (brutto)	0,2	0,4	2,6	-0,3	5,0	0,5	-3,0	-1,0	-0,1
Index (brutto)	0,2	0,5	2,3	-0,5	4,6	0,3	-3,0	-1,1	-0,2

Wertentwicklung seit Auflegung von: 24.05.17

Rollierend 12M (EUR)

	06.23 - 05.24	06.22 - 05.23	06.21 - 05.22	06.20 - 05.21	06.19 - 05.20	06.18 - 05.19	06.17 - 05.18	06.16 - 05.17	06.15 - 05.16	06.14 - 05.15
Anteilsklasse (netto)	4,6	-4,1	-10,0	2,2	1,3	3,2	-0,1	--	--	--
Fonds (brutto)	5,0	-3,7	-9,7	2,6	1,6	3,5	0,4	--	--	--
Index (brutto)	4,6	-3,8	-9,3	3,2	0,5	3,3	0,6	--	--	--

Quelle Morningstar UK Limited © 2024, Stand 31.05.24. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge.

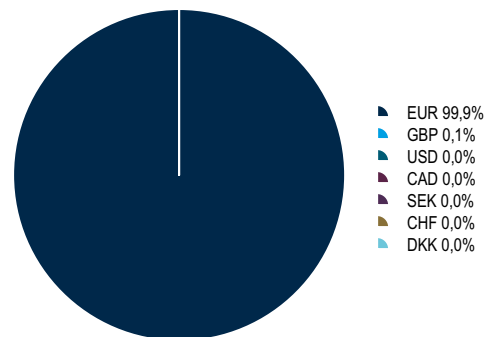
Die Indexrenditen beinhalten Veräußerungsgewinne und gehen von der Wiederanlage etwaiger Erträge aus. Der Index enthält keine Gebühren oder Kosten und Sie können nicht direkt in den Index investieren.

Brutto-Fondswertentwicklung – Quelle Columbia Threadneedle, Stand 31.05.24. Portfoliorenditen vor Abzug von Gebühren sind zeitgewichtete Renditen ohne Berücksichtigung von Provisionen, Transaktionskosten und nicht rückforderbarer Steuern auf Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne unter Verwendung von Preisen für Anlagen, die entweder dem letzten Handelskurs oder einem Geldkurs entsprechen. Cashflows werden per Tagesende berücksichtigt und schließen Ein- und Ausstiegsgebühren aus.

Top 10 Positionen (%)

Wertpapier	Fonds	Index	
Germany (Federal Republic Of)	2,8	0,0	AAA
European Investment Bank	2,6	1,6	AAA
Council Of Europe Development Bank	2,5	0,1	AAA
Union Nationale Interprofessionnelle Pour L Emploi Dans L Industries Et Le Commerce	2,4	0,3	AA
The Wellcome Trust Ltd.	2,2	0,0	AAA
Motability Operations Group Plc	2,1	0,0	A
Caisse D Amortissement De La Dette Sociale	2,1	0,6	AA
European Union	2,1	3,5	AAA
Aib Group Plc	2,0	0,3	BBB
Orange S.A.	2,0	0,7	BBB
Summe	22,8	7,3	

Fonds-Währungsengagement einschließlich Absicherung

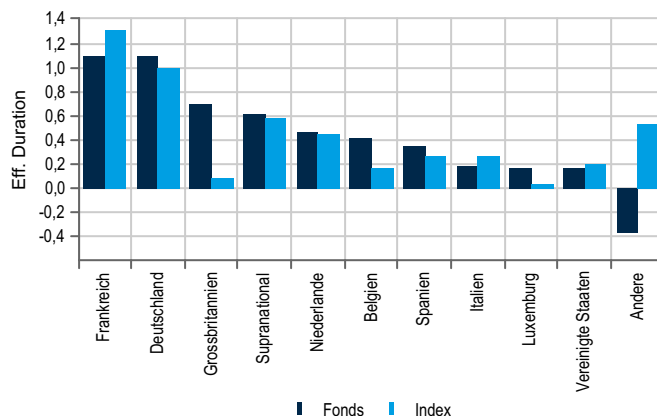


Alle Prozentangaben zum Monatsende auf Basis des globalen Bruttobewertungsschlusskurses und Bestimmung der Währungspositionen anhand der zugrundeliegenden Anlagen einschließlich Fremdwährungstermingeschäfte.

Geografisch

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
Frankreich	21,1	26,7	-5,6	1,1	1,3
Deutschland	16,0	20,1	-4,1	1,1	1,0
Grossbritannien	14,5	1,9	12,5	0,7	0,1
Supranational	10,1	7,4	2,7	0,6	0,6
Niederlande	7,7	8,9	-1,2	0,5	0,4
Spanien	6,2	7,2	-0,9	0,4	0,3
Belgien	4,2	3,0	1,1	0,4	0,2
Italien	3,0	6,5	-3,6	0,2	0,3
Luxemburg	3,0	1,0	2,0	0,2	0,0
Andere	12,0	16,9	-4,9	0,6	0,5
Derivate	-4,6	--	-4,6	-0,8	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	4,6	--	4,6	--	--
Cash einschl. FFX	2,3	--	2,3	--	--
Summe	100,0	100,0	--	4,9	4,9

Geografisch - Beitrag zur effektiven Duration



Credit Rating

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
AAA	18,9	16,3	2,6	1,1	1,0
AA	18,5	14,4	4,2	1,0	0,9
A	24,6	28,4	-3,8	1,3	1,4
BBB	31,8	40,3	-8,5	1,9	1,7
BB	2,2	0,1	2,1	0,1	0,0
NR	0,6	0,5	0,1	0,1	0,0
N/A	1,0	0,0	1,0	0,1	0,0
Derivate	-4,6	--	-4,6	-0,8	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	4,6	--	4,6	--	--
Cash einschl. FFX	2,3	--	2,3	--	--
Summe	100,0	100,0	--	4,9	4,9

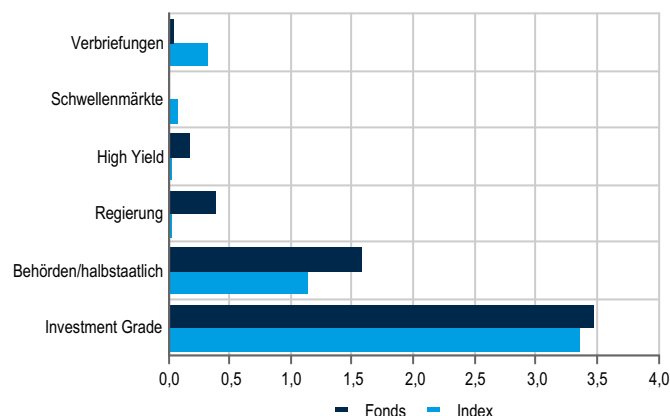
Durchschn. Rating **A+** **A**

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

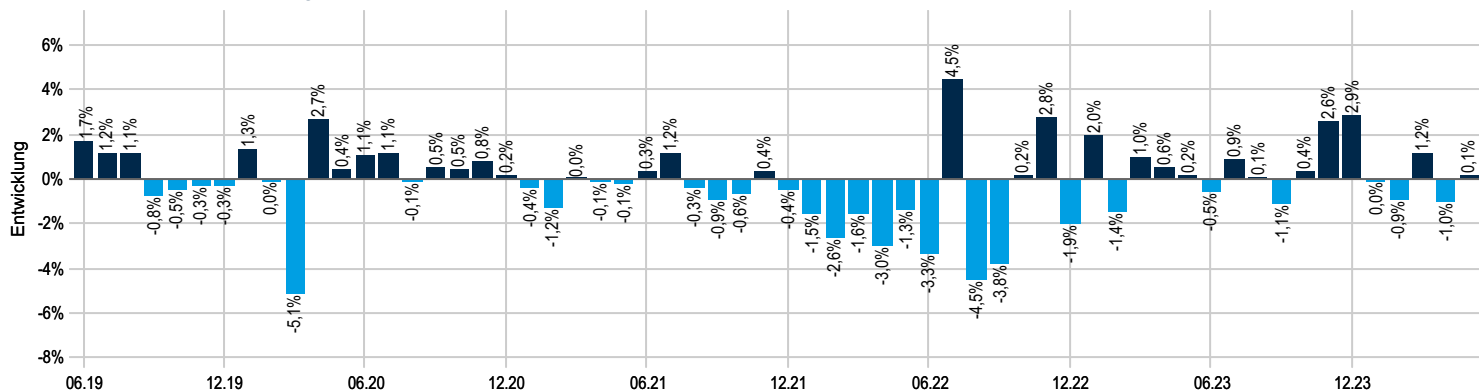
Instrumente

	Gewichtung			Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Diff.	Fonds	Index
Investment Grade	62,7	75,1	-12,4	3,5	3,4
Behörden/halbstaatlich	26,2	15,9	10,3	1,6	1,1
Regierung	4,8	0,3	4,5	0,4	0,0
High Yield	3,4	0,1	3,3	0,2	0,0
Verbriefungen	0,7	7,6	-6,8	0,0	0,3
Schwellenmärkte	--	1,2	-1,2	--	0,1
Derivate	-4,6	--	-4,6	-0,8	--
Ausgleich Barmittel-Derivate	4,6	--	4,6	--	--
Cash einschl. FFX	2,3	--	2,3	--	--
Summe	100,0	100,0	--	4,9	4,9

Instrumente - Beitrag zur effektiven Duration



Monatliche Nettowertentwicklung



Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Ergebnisse schließen. Die Rendite Ihrer Anlage kann sich aufgrund von Währungsschwankungen ändern, wenn Ihre Anlage in einer anderen Währung erfolgt als derjenigen, die bei der Berechnung der bisherigen Wertentwicklung verwendet wurde. Quelle Morningstar UK Limited © 2024, Stand 31.05.24. Netto-Fondserträge - Basierend auf dem NIW und unter der Annahme, dass die Erträge reinvestiert werden, einschließlich laufender Kosten, ohne Ausgabebau- und Rücknahmeabschläge.

Risikoanalyse

	3 J		5 J	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Absolute Volatilität	6,6	6,3	6,0	5,8
Relative Volatilität	1,0	--	1,0	--
Tracking Error	0,4	--	0,5	--
Sharpe-Ratio	-0,7	--	-0,3	--
Information Ratio	0,0	--	0,3	--
Beta	1,0	--	1,0	--
Sortino Ratio	-0,8	--	-0,3	--
Jensen-Alpha	0,2	--	0,2	--
Annualisiertes Alpha	0,2	--	0,1	--
Alpha	0,0	--	0,0	--
Max. Drawdown	-17,3	-16,7	-17,4	-16,7
R ²	99,8	--	99,5	--

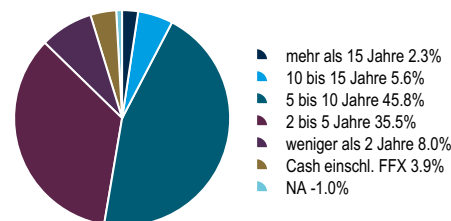
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

Portfolio-Statistik

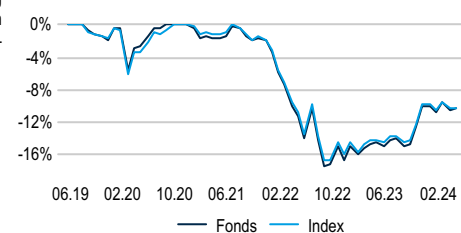
	Fonds	Index
Modifizierte Duration	5,0	5,0
Effektive Duration	4,9	4,9
Durchschnittlicher Kupon	2,3	2,2
Yield-to-Worst	3,8	3,7
Rückzahlungsrendite	3,6	3,8
Credit Rating Linear	A+	A

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

Effektive Duration



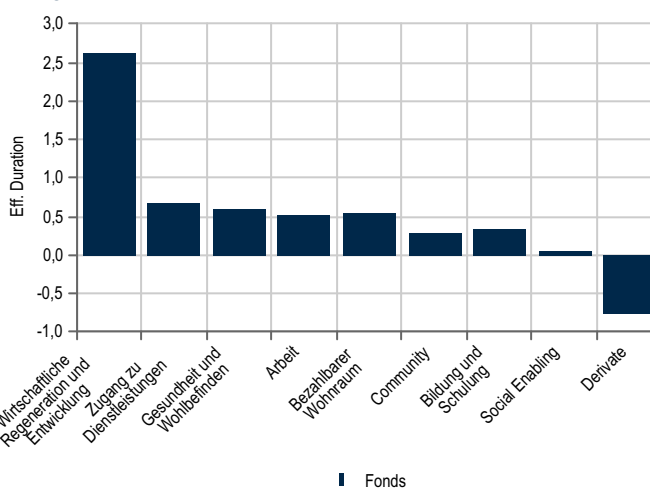
Drawdown



Entwicklungsmöglichkeit

	Gewichtung		Beitrag zur effektiven Duration	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Wirtschaftliche Regeneration und Entwicklung	44,1		2,6	
Zugang zu Dienstleistungen	14,0		0,7	
Gesundheit und Wohlbefinden	12,3		0,6	
Arbeit	11,7		0,5	
Bezahlbarer Wohnraum	8,3		0,6	
Community	4,2		0,3	
Bildung und Schulung	2,5		0,3	
Social Enabling	0,6		0,0	
Derivate	-4,6		-0,8	
Ausgleich Barmittel-Derivate	4,6		--	
Cash einschl. FFX	2,3		--	
Summe	100,0		4,9	

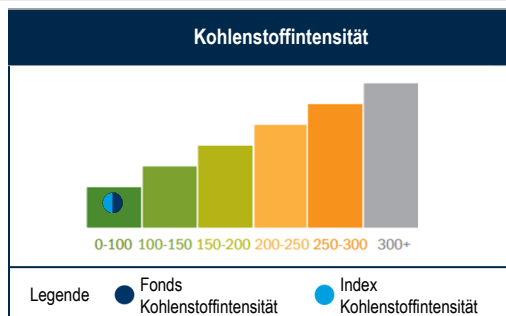
Beitrag zur effektiven Duration



Der Fonds verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel und ist gemäß der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung) als ein Fonds nach Artikel 9 eingestuft.

Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

	Fonds	Index*	Ausrichtung
Kohlenstoffintensität Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz)	75,83	94,87	+19,04
Engagement in kontroversen Unternehmen Engagement in kontroversen Titeln ¹	--	--	--
ESG-Score von MSCI Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität)	7,65	7,32	+0,34



*ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50%), ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50%).

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

Kohlenstoffintensität

Dabei werden die Kohlenstoffemissionen im Verhältnis zur Größe eines Unternehmens an den Umsätzen und nicht an der Marktkapitalisierung gemessen. Als Kennzahl wird Tonnen CO₂ pro Million Dollar Umsatz verwendet (TCO₂e). Die Daten für den gesamten Fond geben wir auf Basis der Gewichtung der gehaltenen Wertpapiere und eines Vergleichs mit ähnlichen Daten für den Index an. Die Kohlenstoffintensität ist ein Indikator für die Kohlenstoffeffizienz. Diese Kennzahl ermöglicht den Vergleich mit anderen Fonds und Anlageklassen.

Engagement in kontroversen Unternehmen

Das Risiko einer Beteiligung an Kontroversen beurteilen wir anhand von drei internationalen Rahmenwerken, in denen Standards für die operative Praxis festgelegt sind: dem UN Global Compact, den International Labour Organisation Core Labour Standards und den UN Guiding Principles on Business and Human Rights. Wir messen den Anteil des Fonds, der in Zusammenhang mit Verstößen gegen die drei Rahmenwerke steht, und vergleichen mit ähnlichen Daten für den Index.

ESG-Score von MSCI

Der MSCI ESG-Score nutzt die MSCI-eigene Methodik, um die Effektivität der Unternehmen bei der Handhabung ihres ESG-Engagements zu bewerten. Die Unternehmen mit den höchsten Ratings sind diejenigen, die ihr Engagement gegenüber diesen wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen am besten handhaben. Liegt der Portfolio-Score über der Benchmark, ist das Portfolio in Emittenten übergewichtet, die ihr ESG-Engagement besser handhaben als andere.

Ausrichtung

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

Es werden Kennzahlen verwendet, um die ESG-Merkmale des Fonds mit dem Index zu vergleichen. Dieser Index ist auch ein nützlicher Referenzwert, mit dem die Wertentwicklung verglichen werden kann.

Dementsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, ökologische oder soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen.

Weitere Informationen über verantwortungsvolles Investieren (RI) oder die in diesem Dokument verwendeten Anlagebegriffe finden Sie im Glossar, das im Document Centre auf unserer Website zur Verfügung steht:

<https://www.columbiathreadneedle.de/de/ret/uber-uns/verantwortungsvolles-anlegen/>. Bei der Entscheidung, in den beworbenen Fonds zu investieren, sollten auch alle Eigenschaften oder Ziele des beworbenen Fonds berücksichtigt werden, wie in seinem Verkaufsprospekt/ in den Informationen beschrieben, die den Anlegern gemäß Artikel 23 der Richtlinie 2011/61/EU offenzulegen sind.

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

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

Verfügbare Anteilsklassen

Anteil	Klasse	Abgesichert	Währung	Steuer	OCF	OCF Datum	Max. Ausgabeaufschlag	Max. Rücknahmeabschlag	Transaktionskosten	Mindestanlage	Auflegungsdatum	ISIN	SEDOL	BBID	WKN/Valor/CUSIP
AE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,55%	29.09.23	3,00%	0,00%	0,08%	2.500	17.09.20	LU2170387828	BM8QTG2	TESBAEA LX	A2P39P
AEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,55%	29.09.23	3,00%	0,00%	0,08%	2.500	17.09.20	LU2170388040	BM8QTH3	TESBAEP LX	A2P39Q
AFH	Acc	Ja	CHF	Gross	0,55%	29.09.23	3,00%	0,00%	0,17%	3.500	24.02.21	LU2279782101	BNGJPR3	THESBAC LX	A2QLVW
AUC	Inc	Ja	USD	Gross	0,55%	29.09.23	3,00%	0,00%	0,17%	2.500	24.02.21	LU2279782366	BNGJPT5	THESBAU LX	A2QLVY
AUH	Acc	Ja	USD	Gross	0,55%	29.09.23	3,00%	0,00%	0,17%	2.500	24.02.21	LU2279782283	BNGJPS4	THESBAH LX	A2QLVX
IE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,40%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,08%	100.000	23.05.17	LU1589836722	BYQH648	TEUSCIE LX	A2DPC6
IEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,40%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,08%	100.000	23.05.17	LU1589837290	BYQH671	TEUSIEP LX	A2DPC9
IGH	Acc	Ja	GBP	Gross	0,40%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,17%	100.000	24.02.21	LU2279783174	BNGJQ14	THESIGH LX	A2QLV5
IUC	Inc	Ja	USD	Gross	0,40%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,17%	100.000	24.02.21	LU2279782879	BNGJPY0	THESBIU LX	A2QLV2
IUH	Acc	Ja	USD	Gross	0,40%	29.09.23	0,00%	0,00%	0,17%	100.000	24.02.21	LU2279782796	BNGJPX9	THESIUH LX	A2QLV1
ZE	Acc	Nein	EUR	Gross	0,45%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,08%	1.500.000	23.05.17	LU1589837373	BYQH682	TEUSCZE LX	A2DPDA
ZEP	Inc	Nein	EUR	Gross	0,45%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,08%	1.500.000	24.04.19	LU1979273130	BJLMTD3	THESZEP LX	A2PEVJ
ZGC	Inc	Ja	GBP	Gross	0,45%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,17%	1.500.000	02.04.20	LU2128402976	BL5MKP2	TESBZGC LX	A2P07S
ZGH	Acc	Ja	GBP	Gross	0,45%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,17%	1.500.000	02.04.20	LU1589837530	BYQH6B5	TEUSZGH LX	A2DPDC
ZUH	Acc	Ja	USD	Gross	0,45%	29.09.23	5,00%	0,00%	0,17%	2.000.000	11.06.20	LU2158744941	BLR4XT1	TESBZUH LX	A2P262

Anteilsklassenbezeichnung: Beginnend mit einer Ziffer – nur verfügbare bestehende Anleger. Beginnend mit einem Buchstaben – verfügbare neue und bestehende Anleger. Die in der Tabelle aufgeführten Anteilsklassen stehen möglicherweise nicht allen Anlegern offen; weitere Informationen finden Sie im Prospekt. Allgemeine Auswirkungen der Kosten: Die Kosten und die erwarteten Erträge können aufgrund von Währungs- und Wechselkurschwankungen steigen oder sinken, wenn die Kosten in einer anderen Währung als Ihrer lokalen Währung zu zahlen sind. Die laufenden Kosten (OCF), die Rücknahmeabschläge (der in der obigen Tabelle angegebene Höchstbetrag, der abgezogen werden kann) und die Transaktionskosten zeigen den Prozentsatz, der von Ihren erwarteten Erträgen abgezogen werden kann. Die laufenden Kosten basieren in der Regel auf den Aufwendungen des letzten Jahres und umfassen Kosten wie die jährliche Verwaltungsgebühr und Betriebskosten des Fonds. Die angegebenen Transaktionskosten basieren auf einem Dreijahresdurchschnitt und werden auf der Grundlage der Zahlen aus dem Jahresbericht und -abschluss berechnet. Bei Fonds, die weniger als 3 Jahre alt sind, basieren die Transaktionskosten auf Ersatzwerten und tatsächlichen Kosten. Alle Transaktionskosten entsprechen dem Stand vom 31.03.23. Zusätzliche Vertriebs- oder Vermittlungsgebühren dürfen nicht einbezogen werden. In einigen Fällen können die laufenden Kosten auf einer Schätzung der künftigen Kosten beruhen. Eine detailliertere Aufstellung finden Sie unter www.columbiathreadneedle.com/fees.

Ausschüttungshistorie der Anteilsklasse (netto)

	Mrz-24	Dez-23	Sept-23	Juni-23
CT (Lux) European Social Bond - IEP EUR	€0,0530 ^A	€0,0450 ^A	€0,0450 ^A	€0,0400 ^A

Die Ausschüttung der von einem Fonds erwirtschafteten Erträge erfolgt in regelmäßigen Abständen in Bezug auf die in jeder Rechnungsperiode zur Zuteilung verfügbaren Erträge. Bitte beachten Sie die Ex-Dividende-/Zahlungsdaten der einzelnen Fonds (E = geschätzte Ausschüttung, A = tatsächliche Ausschüttung) auf Seite 1.

Wichtige Informationen

Nur zur Nutzung durch professionelle Kunden und/oder gleichwertige Anlegertypen in Ihren Rechtsordnungen (nicht für Privatkunden zu verwenden oder an diese weiterzugeben). Columbia Threadneedle (Lux) I is a Luxembourg domiciled investment company with variable capital ("SICAV"), managed by Threadneedle Management Luxembourg S.A.. This material should not be considered as an offer, solicitation, advice or an investment recommendation. This communication is valid at the date of publication and may be subject to change without notice. Information from external sources is considered reliable but there is no guarantee as to its accuracy or completeness. The SICAV's current Prospectus, the Key Information Document and the summary of investor rights are available in English and/ or in German (where applicable) from the Management Company Threadneedle Management Luxembourg S.A., International Financial Data Services (Luxembourg) S.A., your financial advisor and/or on our website www.columbiathreadneedle.de. Threadneedle Management Luxembourg S.A. may decide to terminate the arrangements made for the marketing of the SICAV.

Past performance is calculated according to the BVI method in Germany.

Issued by Threadneedle Management Luxembourg S.A. registered with the Registre de Commerce et des Sociétés (Luxembourg), Registered No. B 110242, 44 rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg.

Columbia Threadneedle Investments is the global brand name of the Columbia and Threadneedle group of companies.