

SICAV Deutschland

Kontaktdaten

Tel: +352 46 40 10 7190*

columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com

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

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

Fondsmanager: Simon Bond
 Seit: Mai 17
 Verwaltungsgesellschaft: Threadneedle Man. Lux. S.A.
 Auflegungsdatum des Fonds: 23.05.17
 Index: ICE BofA Euro Non-Sovereign ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers

Vergleichsgruppe: -
 Fondswährung: EUR
 Fondsdomizil: Luxemburg
 Ex-Dividenden-Datum: Vierteljährlich
 Zahlungsdatum: Vierteljährlich
 Fondsvolumen: €399m
 Anzahl der Wertpapiere: 327

Alle Angaben in EUR

EUROPEAN SOCIAL BOND - IEP EUR

ISIN: LU1589837290
 Preis der Anteilsklasse: 10,0920
 Laufende Kosten (OCF): 0,40% (zum 31.03.21)
 Performancegebühr: Nein

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

Siehe Tabelle der verfügbaren Anteilsklassen auf Seite 4.

Änderungen des Fonds

Ausführliche Informationen zu Änderungen am Fonds finden Sie in der PDF-Datei "Einzelheiten zu wichtigen Ereignissen - T(Lux)" unter <https://www.columbiathreadneedle.com/en/changes>

Ratings/Auszeichnungen



Weitere Informationen zur Methodik des Morningstar-Ratings finden Sie unter www.morningstar.com

Anlageziel und -politik

Der Fonds zielt darauf ab, Erträge zu erzielen, die das Potenzial haben, den von Ihnen investierten Betrag mittelfristig zu erhöhen. Er ist bestrebt, die Wertentwicklung des ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50 %) und des ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50 %) nach Abzug der Gebühren zu übertreffen. Die Anlagen des Fonds sind darauf ausgerichtet, sozial vorteilhafte Aktivitäten und Entwicklungen zu unterstützen.

Mindestens zwei Drittel der Vermögenswerte des Fonds werden in Anleihen investiert, die in Europa begeben werden.

Der Fonds investiert in Anleihen (die einem Darlehen ähnlich sind und einen festen oder variablen Zinssatz zahlen), die von Unternehmen, Regierungen, Freiwilligenorganisationen und/oder Wohltätigkeitsorganisationen begeben werden, die sich für sozial vorteilhafte Aktivitäten und Entwicklungen engagieren. Die Anlagen werden vom Fondsmanager anhand einer von ihm entwickelten sozialen Rating-Methode beurteilt. Die sozialen Auswirkungen der Anlagen werden vierteljährlich von einem sozialen Beratungsausschuss überprüft, dessen Mitglieder zur Hälfte von INCO ernannt werden, einer auf Impact-Investment spezialisierten Organisation. INCO erstellt einen jährlichen Bericht über die soziale Performance, der vom sozialen Beratungsausschuss genehmigt und den Anlegern zur Verfügung gestellt wird.

Der Fonds kann auch in andere als die oben angegebenen Anlageklassen und Instrumente investieren.

Der Fonds wird aktiv in Bezug auf den ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50 %) und den ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50 %) verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Fondsperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Es liegt im Ermessen des Fondsmanagers, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei der Fonds erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

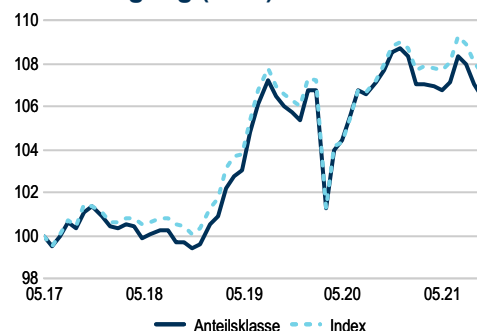
Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Fondsmanagers berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie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

Anlageansatz

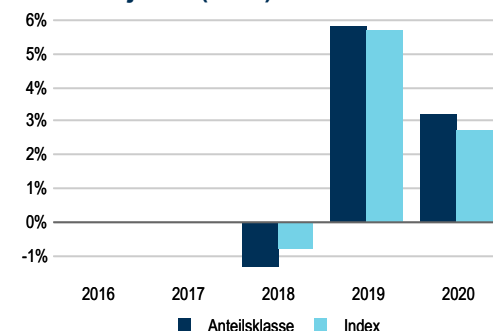
Der Fonds investiert anhand eines ergebnisbasierten Ansatzes in Kreditanleihen, um soziale und finanzielle Renditen zu erzielen. Zuerst identifizieren wir Anleihen, die das Potenzial bieten, Ergebnisse in einer Hierarchie von sieben sozialen Entwicklungserfordernissen zu liefern, um ein Europa-basiertes soziales Universum von etwa 1.900 Wertpapieren zu bilden. Dieses potenzielle, investierbare Universum repräsentiert ca. 45 % der Bestandteile des Benchmarkindex und wird durch ausgewählte benchmarkferne Anleihen ergänzt. Zulässige Anlagen werden dann von unserem zuständigen Anlagesteam eingestuft, um die „soziale Intensität“ der geeigneten Anleihen zu bewerten. Die soziale Intensität jedes Wertpapiers wird dabei als hoch, mittel oder niedrig eingestuft.

Unser Investment-Grade-Kreditteam untersucht diese Anleihen mithilfe unseres etablierten Kreditanalyseprozesses, um sicherzustellen, dass die Anlageideen die erforderlichen Finanz- und Liquiditätsanforderungen für die Aufnahme in das Portfolio erfüllen. Der soziale Partner INCO analysiert und beurteilt des Weiteren die sozialen Ergebnisse der getätigten Anlagen im Rahmen der Strategie und ist Teil des Social Advisory Panel, das die Anlagen aus einer Perspektive der sozialen Performance überarbeitet und überwacht und beratend tätig ist. Dies stellt sicher, dass resultierende Ergebnisse und Auswirkungen anhand eines weithin anerkannten und für die EU-Kommission entwickelten Rahmenwerks überprüft werden. Daraus ergibt sich die abschließende Bewertung der sozialen Vorteile und Ergebnisse sowie die Grundlage, auf der INCO die soziale Performance der Anlagen und der Strategie beurteilt und meldet.

Seit Auflegung (EUR)



Kalenderjahre (EUR)



Annualisierte Wertentwicklung (EUR)

| | 1M | 3M | 6M | Seit JB | 1 J | 2 J | 3 J | 5 J | 10 J | Seit Auf. |
|-----------------------|------|------|------|---------|------|-----|-----|-----|------|-----------|
| Anteilsklasse (netto) | -0,6 | -1,9 | -0,5 | -2,2 | -1,2 | 0,2 | 2,2 | -- | -- | 1,5 |
| Fonds (brutto) | -0,6 | -1,8 | -0,4 | -1,9 | -0,9 | 0,4 | 2,5 | -- | -- | 1,8 |
| Index (brutto) | -0,6 | -1,8 | -0,4 | -1,4 | -0,5 | 0,4 | 2,3 | -- | -- | 1,7 |

Renditen seit Auflegung von: 24.05.17

Wertentwicklung im Kalenderjahr (EUR)

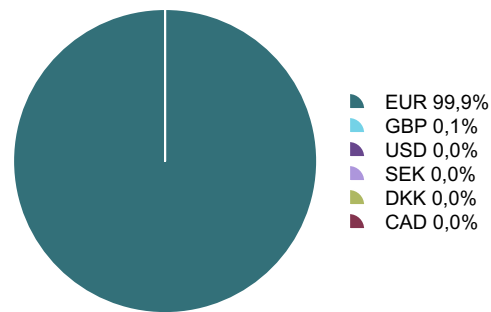
| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 11.20 - 10.21 | 11.19 - 10.20 | 11.18 - 10.19 | 11.17 - 10.18 | 11.16 - 10.17 |
|-----------------------|------|------|------|------|------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Anteilsklasse (netto) | 3,2 | 5,8 | -1,3 | -- | -- | -1,2 | 1,6 | 6,3 | -1,4 | -- |
| Fonds (brutto) | 3,5 | 6,1 | -0,8 | -- | -- | -0,9 | 1,8 | 6,7 | -1,0 | -- |
| Index (brutto) | 2,7 | 5,7 | -0,8 | -- | -- | -0,5 | 1,3 | 6,1 | -1,0 | -- |

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

Top 10 Positionen (%)

| Wertpapier | Fonds | Index | |
|---|-------------|------------|-----|
| Credit Agricole S.A. | 2,4 | 1,2 | AA |
| Bpce Sa | 1,8 | 1,0 | A |
| Volkswagen International Finance N.V. | 1,8 | 1,1 | BBB |
| Council Of Europe Development Bank | 1,7 | 0,1 | AA |
| European Union | 1,7 | 1,8 | AA |
| Cassa Depositi E Prestiti S.P.A. | 1,7 | 0,1 | BBB |
| Union Nationale Interprofessionnelle Pour L Emploi Dan... | 1,6 | 0,5 | AA |
| Caisse D Amortissement De La Dette Sociale | 1,6 | 0,6 | AA |
| Cooperatieve Rabobank U.A. | 1,5 | 0,7 | AAA |
| Orange S.A. | 1,5 | 1,0 | BBB |
| Summe | 17,3 | 8,1 | |

Fonds-Währungsengagement einschließlich Absicherung

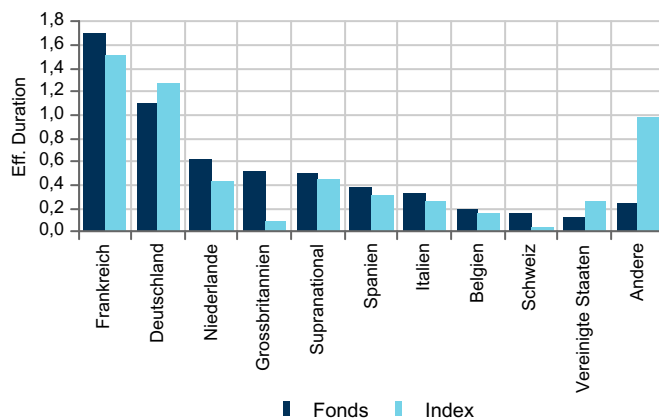


Alle Prozentangaben zum Monatsende auf Basis des globalen Bruttobewertungsschlusskurses und Bestimmung der Währungspositionen anhand der zugrundeliegenden Anlagen einschließlich Fremdwährungstermingeschäfte.

Geografisch

| | Gewichtung | | | Beitrag zur effektiven Duration | |
|------------------------------|--------------|--------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | Fonds | Index | Diff. | Fonds | Index |
| Frankreich | 25,3 | 27,5 | -2,2 | 1,7 | 1,5 |
| Deutschland | 13,8 | 22,0 | -8,2 | 1,1 | 1,3 |
| Grossbritannien | 10,5 | 2,2 | 8,3 | 0,8 | 0,1 |
| Niederlande | 9,5 | 7,5 | 2,0 | 0,6 | 0,4 |
| Spanien | 7,6 | 6,8 | 0,7 | 0,4 | 0,3 |
| Supranational | 6,5 | 5,3 | 1,2 | 0,5 | 0,4 |
| Italien | 6,5 | 5,6 | 0,8 | 0,3 | 0,3 |
| Vereinigte Staaten | 3,5 | 4,2 | -0,8 | 0,2 | 0,3 |
| Belgien | 2,3 | 2,5 | -0,2 | 0,2 | 0,2 |
| Andere | 11,7 | 16,4 | -4,7 | 0,6 | 0,7 |
| Derivate | -8,7 | -- | -8,7 | -0,7 | -- |
| Ausgleich Barmittel-Derivate | 8,9 | -- | 8,9 | -- | -- |
| Barmittel ähnlich | 1,8 | -- | 1,8 | -- | -- |
| Cash einschl. FFX | 0,9 | -- | 0,9 | -- | -- |
| Summe | 100,0 | 100,0 | -- | 5,9 | 5,8 |

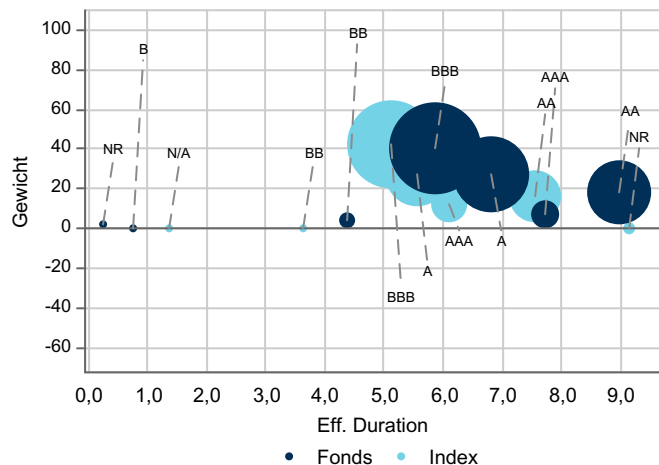
Geografisch - Beitrag zur effektiven Duration



Credit Rating

| | Gewichtung | | | Beitrag zur effektiven Duration | |
|------------------------------|--------------|--------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | Fonds | Index | Diff. | Fonds | Index |
| AAA | 7,0 | 12,6 | -5,6 | 0,5 | 0,8 |
| AA | 17,9 | 16,5 | 1,4 | 1,6 | 1,2 |
| A | 27,6 | 27,6 | 0,0 | 1,9 | 1,5 |
| BBB | 40,2 | 42,6 | -2,4 | 2,4 | 2,2 |
| BB | 4,1 | 0,1 | 4,0 | 0,2 | 0,0 |
| B | 0,2 | -- | 0,2 | 0,0 | -- |
| NR | 0,1 | 0,6 | -0,5 | 0,0 | 0,1 |
| N/A | -- | 0,0 | 0,0 | -- | 0,0 |
| Derivate | -8,7 | -- | -8,7 | -0,7 | -- |
| Ausgleich Barmittel-Derivate | 8,9 | -- | 8,9 | -- | -- |
| Barmittel ähnlich | 1,8 | -- | 1,8 | -- | -- |
| Cash einschl. FFX | 0,9 | -- | 0,9 | -- | -- |
| Summe | 100,0 | 100,0 | -- | 5,9 | 5,8 |

Credit Ratings - Beitrag zur effektiven Duration



Durchschn. Rating

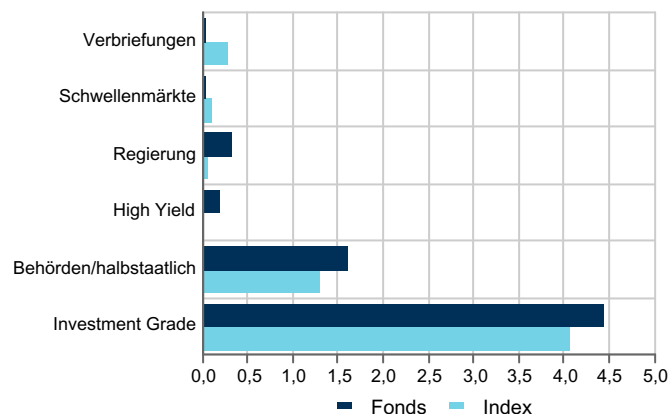
A A

Credit ratings are in-house derived ratings following LINEAR methodology. Categories shown are sorted by Credit Rating.

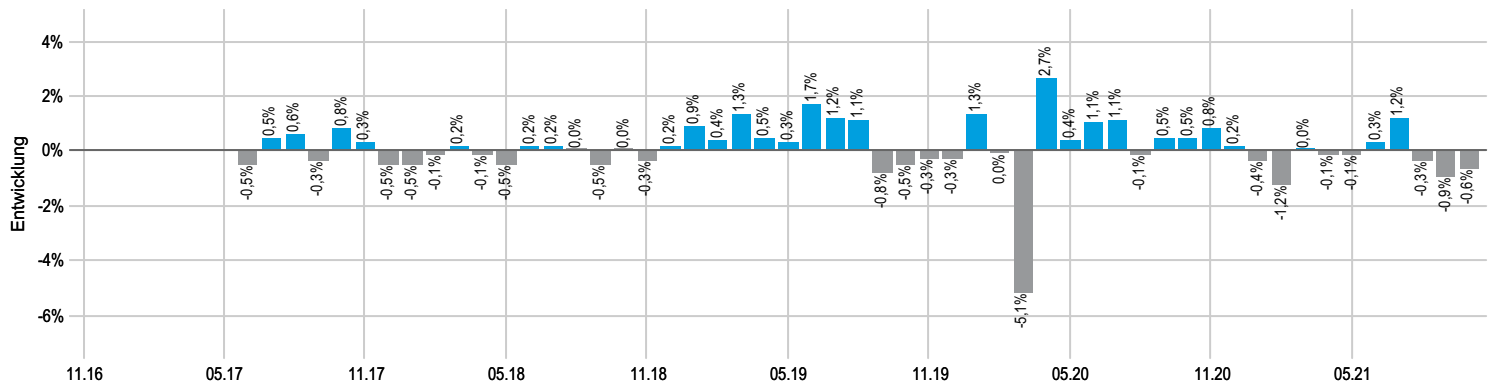
Instrumente

| | Gewichtung | | | Beitrag zur effektiven Duration | |
|------------------------------|--------------|--------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | Fonds | Index | Diff. | Fonds | Index |
| Investment Grade | 69,3 | 77,2 | -7,9 | 4,4 | 4,1 |
| Behörden/halbstaatlich | 20,8 | 15,2 | 5,6 | 1,6 | 1,3 |
| High Yield | 4,3 | -- | 4,3 | 0,2 | -- |
| Regierung | 2,1 | 0,4 | 1,7 | 0,3 | 0,0 |
| Schwellenmärkte | 0,3 | 1,4 | -1,1 | 0,0 | 0,1 |
| Verbriefungen | 0,3 | 5,8 | -5,5 | 0,0 | 0,3 |
| Derivate | -8,7 | -- | -8,7 | -0,7 | -- |
| Ausgleich Barmittel-Derivate | 8,9 | -- | 8,9 | -- | -- |
| Barmittel ähnlich | 1,8 | -- | 1,8 | -- | -- |
| Cash einschl. FFX | 0,9 | -- | 0,9 | -- | -- |
| Summe | 100,0 | 100,0 | -- | 5,9 | 5,8 |

Instrumente - Beitrag zur effektiven Duration



Monatliche Nettowertentwicklung



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

Risikoanalyse

| | 2 J | | 3 J | |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| | Fonds | Index | Fonds | Index |
| Absolute Volatilität | 4,7 | 4,9 | 4,2 | 4,3 |
| Relative Volatilität | 1,0 | -- | 1,0 | -- |
| Tracking Error | 0,5 | -- | 0,4 | -- |
| Sharpe-Ratio | 0,2 | -- | 0,7 | -- |
| Information Ratio | 0,1 | -- | 0,5 | -- |
| Beta | 1,0 | -- | 1,0 | -- |
| Sortino Ratio | 0,2 | -- | 0,9 | -- |
| Jensen-Alpha | 0,1 | -- | 0,3 | -- |
| Annualisiertes Alpha | 0,1 | -- | 0,3 | -- |
| Alpha | 0,0 | -- | 0,0 | -- |
| Max. Drawdown | -5,1 | -5,6 | -5,6 | -6,0 |
| R ² | 99,1 | -- | 99,0 | -- |

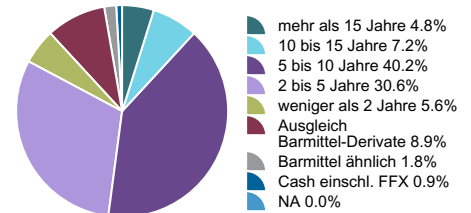
Ex-post-Risikoberechnungen basieren auf monatlichen globalen Bruttorenditen.

Portfolio-Statistik

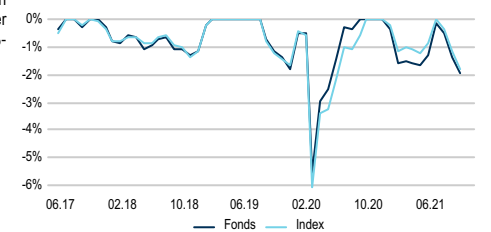
| | Fonds | Index |
|--------------------------|-------|-------|
| Modifizierte Duration | 6,0 | 5,9 |
| Effektive Duration | 5,9 | 5,8 |
| Durchschnittlicher Kupon | 1,2 | 1,4 |
| Yield-to-Worst | 0,6 | 0,4 |
| Credit Rating Linear | A | A |

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 Markt kapitalisierung umfassen Barmittel in den %-Berechnungen.

Effektive Duration



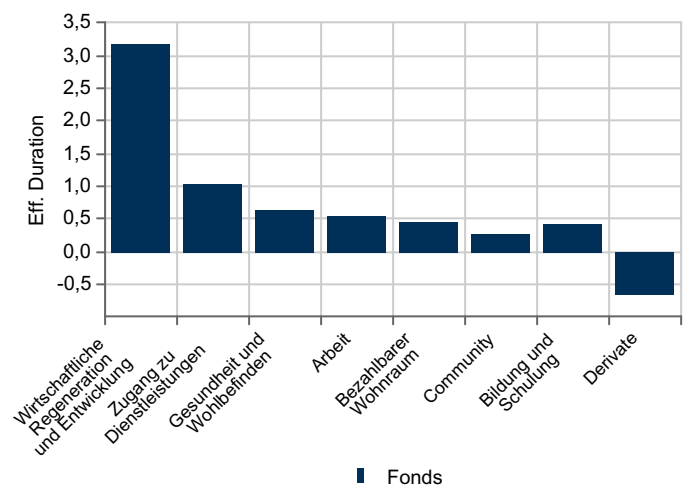
Drawdown



Entwicklungsmöglichkeit

| | Gewichtung | | Beitrag zur effektiven Duration | |
|--|--------------|-------|---------------------------------|-------|
| | Fonds | Index | Fonds | Index |
| Wirtschaftliche Regeneration und Entwicklung | 46,0 | -- | 3,2 | -- |
| Zugang zu Dienstleistungen | 19,1 | -- | 1,0 | -- |
| Gesundheit und Wohlbefinden | 12,1 | -- | 0,7 | -- |
| Arbeit | 9,6 | -- | 0,6 | -- |
| Bezahlbarer Wohnraum | 5,0 | -- | 0,5 | -- |
| Community | 3,0 | -- | 0,3 | -- |
| Bildung und Schulung | 2,4 | -- | 0,4 | -- |
| Derivate | -8,7 | -- | -0,7 | -- |
| Ausgleich Barmittel-Derivate | 8,9 | -- | -- | -- |
| Barmittel ähnlich | 1,8 | -- | -- | -- |
| Cash einschl. FFX | 0,9 | -- | -- | -- |
| Summe | 100,0 | -- | 5,9 | -- |

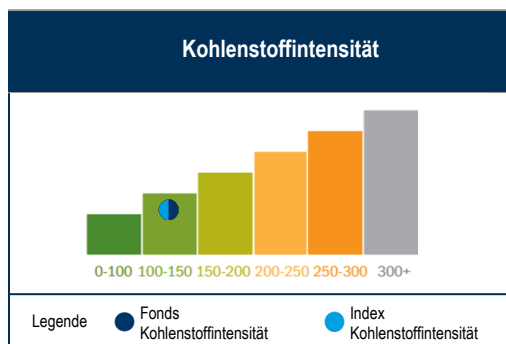
Beitrag zur effektiven Duration



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

Kennzahlen für verantwortungsvolles Investieren

| | Fonds | Index | Ausrichtung |
|--|--------|--------|-------------|
| Kohlenstoffintensität Gewichteter Durchschnitt (tCO2e/1 Mio. USD Umsatz) | 121,06 | 131,74 | +10,68 |
| Engagement in kontroversen Unternehmen Engagement in kontroversen Titeln ¹ | -- | 1,45% | +1,45% |
| ESG-Score von MSCI Gewichteter Durchschnitt (10 = höchste Qualität, 0 = niedrigste Qualität) | 7,21 | 7,04 | +0,17 |



Bestimmte Informationen ©2021 MSCI ESG Research LLC. Nachdruck mit Genehmigung; keine weitere Verbreitung.

¹ Quelle: UNGC – United Nations Global Compact; ILO – International Labor Organization Core Labor Standards (Kernarbeitsnormen der Internationalen Arbeitsorganisation (IAO)); UNGPBR – United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte)

Kohlenstoffintensität

Dabei werden die Kohlenstoffemissionen im Verhältnis zur Größe eines Unternehmens an den Umsätzen und nicht an der Marktkapitalisierung gemessen. Als Kennzahl wird Tonnen CO2 pro Million Dollar Umsatz verwendet (tCO2e). Die Daten für den gesamten Fond geben wir auf Basis der Gewichtung der gehaltenen Wertpapiere und eines Vergleichs mit ähnlichen Daten für den Index an. Die Kohlenstoffintensität ist ein Indikator für die Kohlenstoffeffizienz. Diese Kennzahl ermöglicht den Vergleich mit anderen Fonds und Anlageklassen.

Engagement in kontroversen Unternehmen

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

ESG-Score von MSCI

Der MSCI-Score beurteilt, wie effektiv das ESG-Risiko gemanagt wird. Wenn der Score des Fonds über dem des Index liegt, ist der Fonds in Unternehmen übergewichtet, die ihre ESG-Risiken besser verwalten als andere.

Ausrichtung

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

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

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

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

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

Verfügbare Anteilsklassen

| Anteil | Klasse | Währung | Steuer | OCF | Laufende Kosten Datum | Ausgabeaufschlag | Mindestanlage | Auflageungsdatum | ISIN | SEDOL | BBID | WKN/Valor/CUSIP | Abgesichert |
|--------|--------|---------|--------|-------|-----------------------|------------------|---------------|------------------|--------------|---------|------------|-----------------|-------------|
| AE | Acc | EUR | Gross | 0,55% | 31.03.21 | 3,00% | 2.500 | 17.09.20 | LU2170387828 | BM8QTG2 | TESBAEA LX | A2P39P | Nein |
| AEP | Inc | EUR | Gross | 0,55% | 31.03.21 | 3,00% | 2.500 | 17.09.20 | LU2170388040 | BM8QTH3 | TESBAEP LX | A2P39Q | Nein |
| AFH | Acc | CHF | Gross | 0,55% | 31.03.21 | 3,00% | 3.500 | 24.02.21 | LU2279782101 | BNGJPR3 | THESBAC LX | A2QLVW | Ja |
| AUC | Inc | USD | Gross | 0,55% | 31.03.21 | 3,00% | 2.500 | 24.02.21 | LU2279782366 | BNGJPT5 | THESBAU LX | A2QLVY | Ja |
| AUH | Acc | USD | Gross | 0,55% | 31.03.21 | 3,00% | 2.500 | 24.02.21 | LU2279782283 | BNGJPS4 | THESBAH LX | A2QLVX | Ja |
| IE | Acc | EUR | Gross | 0,40% | 31.03.21 | 0,00% | 100.000 | 23.05.17 | LU1589836722 | BYQH648 | TEUSCIE LX | A2DPC6 | Nein |
| IEP | Inc | EUR | Gross | 0,40% | 31.03.21 | 0,00% | 100.000 | 23.05.17 | LU1589837290 | BYQH671 | TEUSIEP LX | A2DPC9 | Nein |
| IGH | Acc | GBP | Gross | 0,40% | 31.03.21 | 0,00% | 100.000 | 24.02.21 | LU2279783174 | BNGJQ14 | THESIGH LX | A2QLV5 | Ja |
| IUC | Inc | USD | Gross | 0,40% | 31.03.21 | 0,00% | 100.000 | 24.02.21 | LU2279782879 | BNGJJP0 | THESBIU LX | A2QLV2 | Ja |
| IUH | Acc | USD | Gross | 0,40% | 31.03.21 | 0,00% | 100.000 | 24.02.21 | LU2279782796 | BNGJXP9 | THESIUH LX | A2QLV1 | Ja |
| ZE | Acc | EUR | Gross | 0,45% | 31.03.21 | 5,00% | 1.500.000 | 23.05.17 | LU1589837373 | BYQH682 | TEUSCZE LX | A2DPDA | Nein |
| ZEP | Inc | EUR | Gross | 0,45% | 31.03.21 | 5,00% | 1.500.000 | 24.04.19 | LU1979273130 | BJLMTD3 | THESZEP LX | A2PEVJ | Nein |
| ZGC | Inc | GBP | Gross | 0,45% | 31.03.21 | 5,00% | 1.500.000 | 02.04.20 | LU2128402976 | BL5MKP2 | TESBZGC LX | A2P07S | Ja |
| ZGH | Acc | GBP | Gross | 0,45% | 31.03.21 | 5,00% | 1.500.000 | 02.04.20 | LU1589837530 | BYQH6B5 | TEUSZGH LX | A2DPDC | Ja |

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

Risiken

- Der Wert von Anlagen kann sowohl fallen als auch steigen und es kann sein, dass Anleger den ursprünglich investierten Betrag nicht 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-Methode. 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.
- 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, deren Verkauf sich als schwierig erweisen könnte. Der Fonds muss den Verkaufspreis möglicherweise senken, andere Anlagen verkaufen oder auf attraktivere Investmentmöglichkeiten verzichten.
- Der Wert des Fonds kann durch Zinsänderungen beeinflusst werden. Im Regelfall verhält sich der Kurs einer festverzinslichen Anleihe umgekehrt zur Zinsentwicklung, d. h., bei steigenden Zinsen sinkt der Kurs und umgekehrt.
- Bei Anlagen in Vermögenswerten, die auf verschiedene Währungen oder auf andere Währungen als Ihre eigene lauten, kann der Anlagewert durch Wechselkursänderungen beeinträchtigt werden.
- Der Fonds kann erheblich in Derivate anlegen. Eine relativ geringe Veränderung des Werts der zugrundeliegenden Anlage kann eine viel stärkere positive oder negative Auswirkung auf den Wert des Derivats haben.
- Der Fonds kann Derivate einsetzen, um das Risiko zu verringern oder die Transaktionskosten zu minimieren. Diese Derivatgeschäfte können die Performance des Fonds positiv oder negativ beeinflussen. Es liegt nicht in der Absicht des Fondsmanagers, dass sich ein derartiger Einsatz von Derivaten auf das allgemeine Risikoprofil des Fonds auswirkt.

Chancen

- Ein innovativer, liquider Sozialinvestmentfonds, der eine dynamische Methode zur sozialen Beurteilung verwendet, um die Anlageentscheidungen zu steuern.
- Der Fonds profitiert von der starken Partnerschaft zwischen INCO, einer führenden Gesellschaft im Bereich der Beurteilung nachhaltiger sozialer Unternehmen, und Columbia Threadneedle Investments, einem etablierten Vermögensverwalter mit einer soliden Reputation im Bereich der Investition in Anleihen und sozialen Anlagen.
- Bedient die wachsende Nachfrage der Kunden nach Anlagen in einen Fonds, der positive soziale Ergebnisse sowie wettbewerbsfähige finanzielle Renditen generieren kann.
- Simon Bond hat mehr als 25 Jahre Erfahrung mit Anlagen in Unternehmensanleihen und besitzt eine Leidenschaft für den Bereich der sozialen Anlagen, einen Bereich, in dem er seit vielen Jahren Analysen und Anlagen vornimmt.

Wichtige Informationen

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

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

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

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

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

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

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

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