

El presente documento es material de promoción comercial. Consulte el folleto de los OICVM y el KID antes de tomar cualquier decisión definitiva en materia de inversión.

Datos de contacto

Tel: +352 46 40 10 7190\*  
columbiathreadneedleenquiries@statestreet.com  
\*Por favor, tenga en cuenta que las llamadas y las comunicaciones electrónicas pueden ser registradas.  
IFDS, 49, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg

Datos fundamentales

Gestor del Fondo:



Pauline Grange  
Desde Mayo 21

Sociedad gestora: Threadneedle Man. Lux. S.A.  
Fondo de tipo paraguas: Columbia Threadneedle (Lux) II  
Categoría SFDR: Artículo 9  
Fecha de lanzamiento: 19/05/21  
Índice: MSCI ACWI Index  
Grupo de comparación: -  
Divisa del fondo: USD  
Domicilio del Fondo: Luxemburgo  
Patrimonio total: €153,2m  
N.º de títulos: 45  
Precio: 13,8708

Toda la información está expresada en EUR

El 20 de noviembre de 2023, el nombre del Fondo cambió de Columbia Threadneedle (Lux) - Sustainable Outcomes Global Equity a CT (Lux) Sustainable Outcomes Global Equity.

Calificaciones/premios:

Objetivo y política de inversión

El objetivo del Fondo es aumentar el valor de su inversión a largo plazo mediante la inversión en empresas que ofrezcan resultados sostenibles positivos para el medioambiente o la sociedad a través de sus productos y servicios y que presenten prácticas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) sólidas.

Pretende superar el rendimiento del MSCI ACWI Index en periodos consecutivos de 5 años, una vez deducidos los gastos.

El Fondo invierte un mínimo del 90 % de sus activos en acciones de empresas de todo el mundo, incluidas acciones de empresas de mercados emergentes, que pueden representar una parte sustancial de las inversiones del Fondo.

El Fondo podrá usar derivados (instrumentos complejos) con fines de cobertura y también podrá invertir en clases de activos e instrumentos distintos a los mencionados anteriormente.

El gestor del Fondo solo selecciona empresas que se ajusten al menos a una de las temáticas ambientales o sociales del Fondo, que están directamente relacionadas con los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de la ONU, tal como se describe en las Directrices de Inversión en Resultados Sostenibles del Fondo. El gestor del Fondo también se asegura de que las empresas en las que invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

El Fondo excluye a las empresas que obtienen determinados niveles de ingresos de sectores o actividades que el gestor del Fondo considera que contravienen el objetivo de realizar contribuciones positivas a la sociedad o al medioambiente. Asimismo, excluye a las empresas que se ha determinado que incumplen normas y principios internacionales.

El gestor del Fondo mantiene un diálogo activo con las empresas para fomentar resultados sostenibles positivos. Columbia Threadneedle Investments es signataria de la iniciativa Net Zero Asset Managers y se ha comprometido a alcanzar la neutralidad en carbono para 2050 o antes en relación con diversos activos, incluido el Fondo. El gestor del Fondo establece una colaboración proactiva para contribuir a la consecución de este objetivo y puede dejar de invertir en aquellos emisores que no cumplan los estándares mínimos.

El Fondo se gestiona activamente en referencia al MSCI ACWI Index. El índice es ampliamente representativo de las empresas en las que invierte el Fondo y proporciona un índice objetivo adecuado con el que se medirá y evaluará el rendimiento del Fondo a lo largo del tiempo. El índice no está diseñado para medir si el Fondo logra su objetivo sostenible. El gestor del Fondo está facultado para seleccionar inversiones con ponderaciones diferentes a las del índice y que no estén en el índice; además, como resultado de su objetivo de inversión sostenible, el Fondo mostrará una divergencia significativa con respecto al índice.

Para obtener más información acerca de las directrices de inversión del Fondo y su objetivo de inversión sostenible, consulte las Directrices de Inversión en Resultados Sostenibles y el anexo de las normas técnicas de regulación que desarrollan el SFDR que se incluye en el Folleto, ambos disponibles en [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com). Se considera que el Fondo se enmarca en el ámbito de aplicación del artículo 9 del SFDR.

Riesgos principales

- El valor de las inversiones puede subir y bajar y es posible que los inversores no recuperen el importe original de su inversión.
- Cuando la inversión sean en activos denominados en múltiples divisas, o en divisas distintas a la suya, las variaciones en los tipos de cambio podrán afectar al valor de las inversiones.
- El Fondo cuenta con una cartera concentrada (mantiene un número limitado de inversiones y/o tiene un universo de inversión restringido) y si una o varias de estas inversiones reducen su valor o se ven afectadas de otro modo, ello puede tener un efecto pronunciado en el valor del Fondo.
- El Fondo invierte en mercados en los que los riesgos económicos y legislativos pueden ser significativos. Estos factores pueden afectar a la liquidez, las liquidaciones y el valor de los activos. Esos hechos pueden tener un efecto negativo en el valor de su inversión.
- El Fondo podrá invertir en derivados (instrumentos complejos vinculados a la subida y bajada del valor de otros activos) con el objetivo de reducir el riesgo o minimizar el coste de las transacciones. Tales transacciones de derivados pueden beneficiar o afectar negativamente al rendimiento del Fondo. El Gestor no pretende que dicho uso de derivados afecte al perfil de riesgo general del Fondo.
- El objetivo del Fondo es invertir en empresas que ofrezcan resultados sostenibles y, al hacerlo, se adhiere a un conjunto de directrices de inversión sostenible. Las directrices afectarán a la exposición del Fondo a determinados sectores, lo que puede repercutir positiva o negativamente en el rendimiento del Fondo en relación con un índice de referencia u otros fondos que no estén sujetos a tales restricciones.
- El fondo normalmente conlleva el riesgo de una elevada volatilidad debido a la composición de la cartera o a las técnicas de gestión de cartera empleadas. Esto significa que es probable que el valor del fondo disminuya y aumente de forma más frecuente, efecto que podría ser más pronunciado que en otros fondos.
- Los riesgos actualmente identificados como aplicables al Fondo se detallan en el apartado "Factores de riesgo" del folleto.

Enfoque de inversión

Existe una gran oportunidad de invertir en empresas de alta calidad que puedan ofrecer soluciones a los retos de sostenibilidad mundiales, desde la energía renovable hasta la vivienda asequible, a la vez que generan crecimiento del capital. Nuestro enfoque se basa en los Objetivos de Desarrollo Sostenible (ODS) de las Naciones Unidas, un marco que pretende catalizar el cumplimiento de las principales necesidades mundiales de desarrollo sostenible. A partir de los ODS, hemos identificado una serie de resultados ambientales y sociales en los que se puede invertir, que están divididos en ocho temáticas. Tratamos de identificar aquellas empresas que actualmente puedan responder a estas temáticas o que estén reorientando sus actividades para conseguirlo en un futuro, con el objetivo de generar un rendimiento sólido y apoyar el desarrollo sostenible.

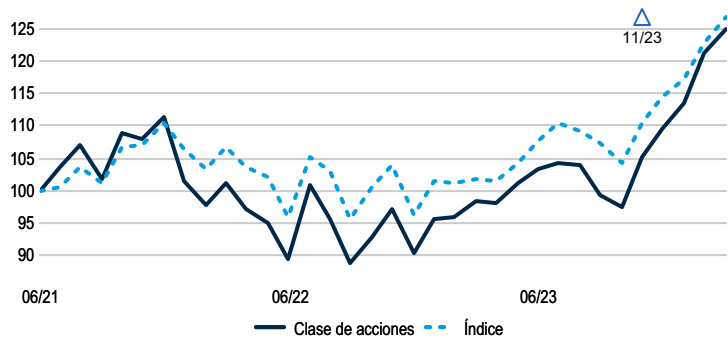
Queremos ver que invierten para lograr un futuro más sostenible y que lo hacen con integridad. Nuestro objetivo es construir una cartera de empresas que puedan apoyar el desarrollo sostenible y generar un rendimiento sólido.

La filosofía y el enfoque de inversión se basan en nuestra consolidada franquicia de renta variable global y en la creencia de que las empresas emergentes de alta calidad y en crecimiento constituyen inversiones superiores. La ventaja competitiva es la piedra angular de este enfoque. Nuestro objetivo es identificar el origen de la ventaja competitiva de una empresa y conocer la estructura del sector en el que opera. Gracias a esta información, tenemos la certeza de que dicha empresa podrá mantener su posición en el mercado y seguir ofreciendo unos buenos resultados y un crecimiento estable a largo plazo.

Rendimiento

El rendimiento histórico no es indicativo de los resultados futuros. La rentabilidad de su inversión puede cambiar como resultado de las fluctuaciones de divisas, en caso de que su inversión se realice en una divisa distinta a la utilizada en el cálculo del rendimiento histórico.

Valor liq. desde lanzamiento (EUR)



Eventos significativos

△ Se refiere a un evento significativo. Para obtener información detallada sobre cambios de fondos, consulte el PDF "Eventos significativos: fondos Columbia Threadneedle Luxemburgo-domiciliados SICAV" disponible en <https://www.columbiathreadneedle.com/en/changes>

Rentabilidad por año (EUR)

|                          | 2023 | 2022  | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|--------------------------|------|-------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| Clase de acciones (neta) | 21,1 | -18,6 | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   |
| Fondo (bruto)            | 22,2 | -17,5 | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   |
| Índice (bruta)           | 18,6 | -12,6 | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   | --   |

Rentabilidad anualizada (EUR)

|                          | 1 M | 3 M  | 6 M  | Hasta la Fecha | 1 A  | 2 A  | 3 A | 5 A | Desde la zam |
|--------------------------|-----|------|------|----------------|------|------|-----|-----|--------------|
| Clase de acciones (neta) | 3,0 | 14,0 | 25,7 | 14,0           | 26,7 | 11,2 | --  | --  | 12,1         |
| Fondo (bruto)            | 3,1 | 14,3 | 26,4 | 14,3           | 28,0 | 12,4 | --  | --  | 12,0         |
| Índice (bruta)           | 3,4 | 10,8 | 18,0 | 10,8           | 24,5 | 8,9  | --  | --  | 11,2         |

Retornos desde lanzamiento: 20/05/21

Rendimiento (12M) (EUR)

|                          | 04/23 - 03/24 | 04/22 - 03/23 | 04/21 - 03/22 | 04/20 - 03/21 | 04/19 - 03/20 | 04/18 - 03/19 | 04/17 - 03/18 | 04/16 - 03/17 | 04/15 - 03/16 | 04/14 - 03/15 |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Clase de acciones (neta) | 26,7          | -2,5          | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            |
| Fondo (bruto)            | 28,0          | -1,3          | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            |
| Índice (bruta)           | 24,5          | -4,7          | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            | --            |

Fuente: Morningstar UK Limited © 2024 a 31/03/24. Rentabilidad neta del Fondo, partir del valor liquidativo y bajo el supuesto de una reinversión de los ingresos, incluida la cifra de gastos corrientes y excluidos los gastos de entrada y de salida.

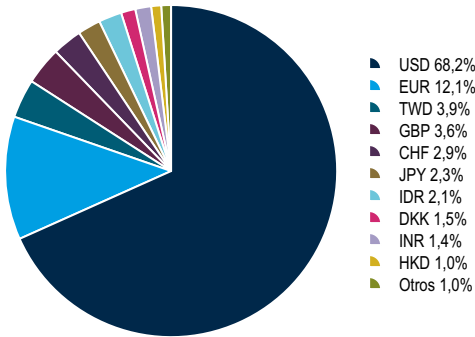
Las rentabilidades del índice incluyen las plusvalías y presuponen la reinversión de cualquier ingreso. El índice no incluye gastos ni comisiones, y usted no puede invertir directamente en él.

Rentabilidad bruta del Fondo. Fuente: Columbia Threadneedle a 31/03/24. Las rentabilidades de la cartera previa deducción de comisiones son las tasas de rentabilidad ponderadas por tiempo libres de comisiones, costes de transacción, intereses, impuestos no recuperables sobre dividendos, ni plusvalías, usando la última cotización de una inversión, que puede ser el último precio negociado o la base de oferta. Se tienen en cuenta los flujos de caja al cierre de la sesión y se excluyen los gastos de salida y de entrada.

Posiciones Top 10 (%)

| Nombre de la acción                          | Fondo | Índice |                              |
|----------------------------------------------|-------|--------|------------------------------|
| Microsoft Corporation                        | 8,8   | 4,1    | Tecnología de la información |
| NVIDIA Corporation                           | 4,9   | 3,1    | Tecnología de la información |
| Mastercard Incorporated Class A              | 4,7   | 0,6    | Financiero                   |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. | 3,9   | 0,8    | Tecnología de la información |
| Xylem Inc.                                   | 3,0   | 0,0    | Industrial                   |
| Thermo Fisher Scientific Inc.                | 2,9   | 0,3    | Salud                        |
| ASML Holding NV                              | 2,8   | 0,5    | Tecnología de la información |
| Schneider Electric SE                        | 2,6   | 0,2    | Industrial                   |
| Eli Lilly and Company                        | 2,5   | 0,9    | Salud                        |
| Linde plc                                    | 2,5   | 0,3    | Materiales                   |
| Total                                        | 38,5  | 10,8   |                              |

Exposición a divisas del Fondo, incluida cobertura



Todos los porcentajes son los vigentes al cierre del mes natural y en el momento de valoración bruta al cierre global sobre una base de utilidades no distribuidas en relación con activos subyacentes, incluidas posiciones de divisas a plazo.

Ponderaciones (%)

| Sector                       | Fondo | Índice | Dif  |     | País           | Fondo | Índice | Dif   |     |
|------------------------------|-------|--------|------|-----|----------------|-------|--------|-------|-----|
| Tecnología de la información | 33,1  | 23,7   |      | 9,4 | Estados Unidos | 63,5  | 63,6   | -0,1  |     |
| Salud                        | 17,5  | 11,1   |      | 6,4 | Reino Unido    | 6,0   | 3,3    |       | 2,8 |
| Industrial                   | 15,3  | 10,8   |      | 4,5 | Países Bajos   | 4,5   | 1,3    |       | 3,2 |
| Materiales                   | 12,0  | 4,2    |      | 7,8 | Francia        | 4,3   | 2,8    |       | 1,4 |
| Financiero                   | 9,4   | 16,1   | -6,7 |     | Taiwán         | 3,9   | 1,8    |       | 2,1 |
| Bienes de consumo            | 4,9   | 10,9   | -6,0 |     | Suiza          | 3,0   | 2,2    |       | 0,8 |
| Servicios públicos           | 2,3   | 2,5    | -0,2 |     | Brasil         | 2,4   | 0,6    |       | 1,8 |
| Bienes raíces                | 1,6   | 2,2    | -0,6 |     | Indonesia      | 2,3   | 0,2    |       | 2,1 |
| Bienes de primera necesidad  | 1,6   | 6,4    | -4,8 |     | Japón          | 2,3   | 5,5    | -3,2  |     |
| Servicios de comunicación    | --    | 7,6    | -7,6 |     | Dinamarca      | 1,5   | 0,9    |       | 0,7 |
| Energía                      | --    | 4,5    | -4,5 |     | India          | 1,4   | 1,8    | -0,3  |     |
| Efectivo                     | 2,3   | --     |      | 2,3 | Otros          | 2,6   | 16,1   | -13,5 |     |
|                              |       |        |      |     | Efectivo       | 2,3   | --     |       | 2,3 |

Diez principales sobreponderaciones/infraponderaciones (%)

| Sobreponderaciones                             | Fondo | Índice | Dif | Infraponderaciones              | Fondo | Índice | Dif  |
|------------------------------------------------|-------|--------|-----|---------------------------------|-------|--------|------|
| Microsoft Corporation                          | 8,8   | 4,1    | 4,6 | Apple Inc.                      | --    | 3,5    | -3,5 |
| Mastercard Incorporated Class A                | 4,7   | 0,6    | 4,1 | Amazon.com, Inc.                | --    | 2,3    | -2,3 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.   | 3,9   | 0,8    | 3,0 | Meta Platforms Inc Class A      | --    | 1,5    | -1,5 |
| Xylem Inc.                                     | 3,0   | 0,0    | 3,0 | Alphabet Inc. Class A           | --    | 1,2    | -1,2 |
| Thermo Fisher Scientific Inc.                  | 2,9   | 0,3    | 2,6 | Alphabet Inc. Class C           | --    | 1,1    | -1,1 |
| Schneider Electric SE                          | 2,6   | 0,2    | 2,5 | Broadcom Inc.                   | --    | 0,8    | -0,8 |
| RELX PLC                                       | 2,5   | 0,1    | 2,4 | JPMorgan Chase & Co.            | --    | 0,8    | -0,8 |
| MercadoLibre, Inc.                             | 2,4   | 0,1    | 2,3 | Berkshire Hathaway Inc. Class B | --    | 0,8    | -0,8 |
| ASML Holding NV                                | 2,8   | 0,5    | 2,3 | Tesla, Inc.                     | --    | 0,7    | -0,7 |
| PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk Class B | 2,3   | 0,0    | 2,2 | Exxon Mobil Corporation         | --    | 0,6    | -0,6 |

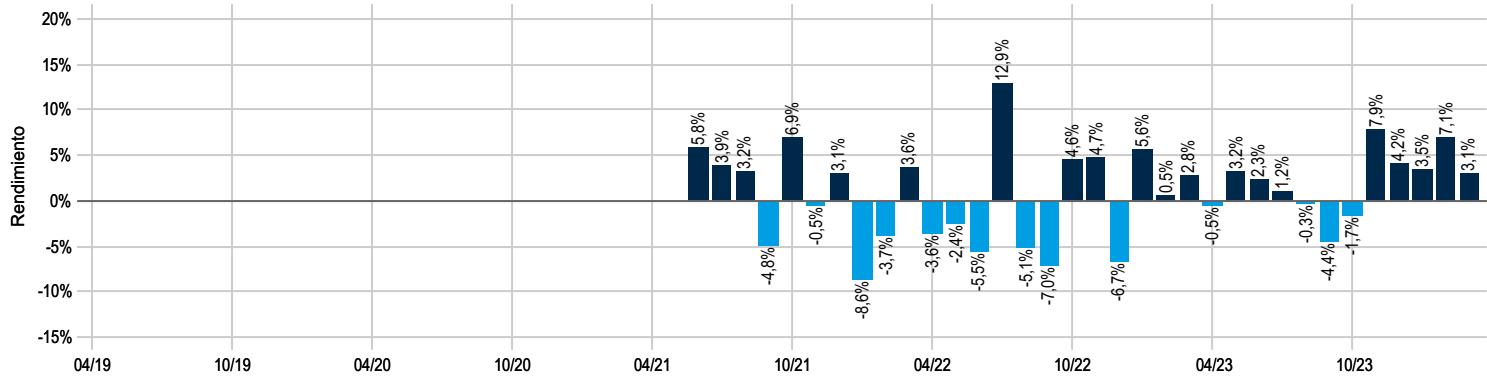
Cambios de posición más signif. en los últimos 3M

| Nombre de la acción                                        | 3M Cambiar |
|------------------------------------------------------------|------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.               | 3,9        |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Sponsored ADR | -2,9       |
| HDFC Bank Limited                                          | -2,4       |
| Smurfit Kappa Group PLC                                    | 1,8        |
| UPM-Kymmene Oyj                                            | -1,5       |
| Tetra Tech, Inc.                                           | 1,5        |
| Humana Inc.                                                | -1,4       |
| Infineon Technologies AG                                   | -1,2       |
| NVIDIA Corporation                                         | 1,1        |
| AIA Group Limited                                          | -0,9       |

Principales atribuciones positivas/negativas a títulos (últimos tres meses)

| Fondo                                           |     |      |     |  | Índice              |       |  |     |  | Atrib.                     |     |       |      |  | Fondo                              |       |  |      |  | Índice              |       |  |      |  | Atrib.             |  |  |  |  |
|-------------------------------------------------|-----|------|-----|--|---------------------|-------|--|-----|--|----------------------------|-----|-------|------|--|------------------------------------|-------|--|------|--|---------------------|-------|--|------|--|--------------------|--|--|--|--|
| Ponder. media                                   |     |      |     |  | Rendi- miento total |       |  |     |  | Efecto geom. Total         |     |       |      |  | Ponder. media                      |       |  |      |  | Rendi- miento total |       |  |      |  | Efecto geom. Total |  |  |  |  |
| Nombre del título - Diez más elevados           |     |      |     |  |                     |       |  |     |  |                            |     |       |      |  | Nombre del título - Diez más bajos |       |  |      |  |                     |       |  |      |  |                    |  |  |  |  |
| NVIDIA Corporation                              | 4,6 | 86,8 | 3,1 |  | 2,6                 | 86,6  |  | 1,2 |  | HDFC Bank Limited          | 2,3 | -14,3 | -0,6 |  | 0,1                                | -13,6 |  | -0,7 |  | 0,1                 | -13,6 |  | -0,7 |  |                    |  |  |  |  |
| Apple Inc.                                      | --  | --   | --  |  | 4,0                 | -8,8  |  | 0,8 |  | AIA Group Limited          | 1,4 | -21,0 | -0,4 |  | 0,1                                | -21,2 |  | -0,4 |  | 0,1                 | -21,2 |  | -0,4 |  |                    |  |  |  |  |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Lt. ... | 2,3 | 35,7 | 1,1 |  | --                  | --    |  | 0,8 |  | Zoetis, Inc. Class A       | 2,0 | -12,2 | -0,3 |  | 0,1                                | -12,1 |  | -0,4 |  | 0,1                 | -12,1 |  | -0,4 |  |                    |  |  |  |  |
| ASML Holding NV                                 | 2,9 | 30,1 | 0,9 |  | 0,5                 | 31,1  |  | 0,4 |  | Infineon Technologies AG   | 1,3 | -16,4 | -0,3 |  | 0,1                                | -15,7 |  | -0,4 |  | 0,1                 | -15,7 |  | -0,4 |  |                    |  |  |  |  |
| Tesla, Inc.                                     | --  | --   | --  |  | 0,8                 | -27,6 |  | 0,4 |  | Meta Platforms Inc Class A | --  | --    | --   |  | 1,4                                | 40,5  |  | -0,3 |  | 1,4                 | 40,5  |  | -0,3 |  |                    |  |  |  |  |
| Eli Lilly and Company                           | 2,5 | 36,6 | 0,8 |  | 0,8                 | 36,7  |  | 0,3 |  | Sika AG                    | 1,6 | -5,8  | -0,1 |  | 0,1                                | -5,1  |  | -0,3 |  | 0,1                 | -5,1  |  | -0,3 |  |                    |  |  |  |  |
| CrowdStrike Holdings, Inc. Class A              | 1,6 | 28,5 | 0,5 |  | 0,1                 | 28,4  |  | 0,3 |  | Genus plc                  | 0,9 | -17,1 | -0,2 |  | --                                 | --    |  | -0,3 |  | --                  | --    |  | -0,3 |  |                    |  |  |  |  |
| Advanced Drainage Systems, Inc.                 | 1,8 | 24,9 | 0,4 |  | --                  | --    |  | 0,2 |  | MercadoLibre, Inc.         | 2,3 | -1,8  | 0,0  |  | 0,1                                | -1,6  |  | -0,2 |  | 0,1                 | -1,6  |  | -0,2 |  |                    |  |  |  |  |
| Trimble Inc.                                    | 1,9 | 23,2 | 0,4 |  | 0,0                 | 23,7  |  | 0,2 |  | Humana Inc.                | 0,4 | -16,8 | -0,3 |  | 0,1                                | -22,3 |  | -0,2 |  | 0,1                 | -22,3 |  | -0,2 |  |                    |  |  |  |  |
| Trane Technologies plc                          | 1,5 | 26,1 | 0,4 |  | 0,1                 | 26,3  |  | 0,2 |  | Aptiv PLC                  | 1,1 | -9,2  | -0,1 |  | 0,0                                | -9,2  |  | -0,2 |  | 0,0                 | -9,2  |  | -0,2 |  |                    |  |  |  |  |

Rendimientos brutos mensuales



El rendimiento histórico no es indicativo de los resultados futuros. La rentabilidad de su inversión puede cambiar como resultado de las fluctuaciones de divisas, en caso de que su inversión se realice en una divisa distinta a la utilizada en el cálculo del rendimiento histórico.Fuente: Morningstar UK Limited © 2024 a 31/03/24. Rentabilidad neta del Fondo, partir del valor liquidativo y bajo el supuesto de una reinversión de los ingresos, incluida la cifra de gastos corrientes y excluidos los gastos de entrada y de salida.

Análisis de riesgos

|                             | 2 A   |        |
|-----------------------------|-------|--------|
|                             | Fondo | Índice |
| Volatilidad absoluta        | 17,1  | 14,6   |
| Volatilidad relativa        | 1,2   | --     |
| Error de seguimiento        | 5,0   | --     |
| Coefficiente de Sharpe      | 0,6   | --     |
| Coefficiente de información | 0,7   | --     |
| Beta                        | 1,1   | --     |
| Coefficiente de Sortino     | 1,1   | --     |
| Alfa de Jensen              | 2,6   | --     |
| Alfa anualizada             | 2,4   | --     |
| Alfa                        | 0,2   | --     |
| Reducción máx.              | -11,8 | -10,5  |
| R²                          | 92,3  | --     |

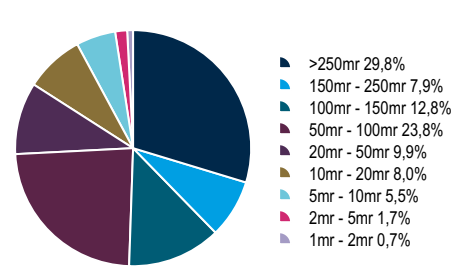
Los cálculos de riesgos ex post están basados en la rentabilidad total mensual bruta.

Estadísticas de la cartera

|                               | Fondo | Índice |
|-------------------------------|-------|--------|
| Precio-Beneficios             | 34,6  | 20,4   |
| Precio-Balance                | 5,4   | 3,0    |
| Rendimiento de los dividendos | 1,0   | 1,9    |
| Rendimiento de los activos    | 7,2   | 3,0    |
| Rendimiento del capital       | 15,7  | 14,6   |

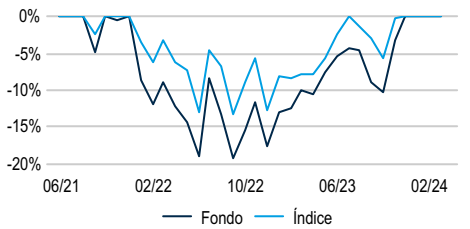
Los análisis se basan en valoraciones al cierre de operaciones mundial utilizando atributos de mercado definidos por Columbia Threadneedle Investments. Los datos de los títulos subyacentes pueden ser provisionales o estar basados en estimaciones. Las ponderaciones de capitalización bursátil incluyen el efectivo en los cálculos porcentuales.

Gráfica de desglose por capitalización bursátil



Moneda: EUR

Reducción



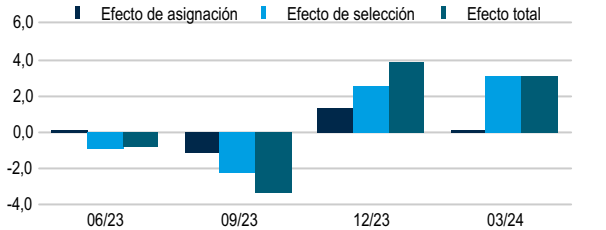
Atribución al rendimiento (ejercicio corriente)

|                              | Var. en la ponder. media | Rendimiento total del Fondo | Rendimiento total del índice | Rend. total relativo | Rendimiento relativo | Atrib. Geomét.       |                     |              |
|------------------------------|--------------------------|-----------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
|                              |                          |                             |                              |                      |                      | Efecto de asignación | Efecto de selección | Efecto total |
| Servicios de comunicación    | -7,5                     | --                          | 14,0                         | -12,3                | 2,9                  | -0,2                 | --                  | -0,2         |
| Bienes de consumo            | -6,1                     | 2,8                         | 8,4                          | -5,2                 | -2,2                 | 0,1                  | -0,3                | -0,1         |
| Bienes de primera necesidad  | -5,0                     | 18,8                        | 5,1                          | 13,0                 | -5,1                 | 0,3                  | 0,2                 | 0,5          |
| Energía                      | -4,5                     | --                          | 12,2                         | -10,8                | 1,2                  | -0,1                 | --                  | -0,1         |
| Financiero                   | -5,0                     | 1,1                         | 11,9                         | -9,6                 | 1,0                  | -0,1                 | -1,1                | -1,2         |
| Salud                        | 6,3                      | 10,1                        | 9,7                          | 0,4                  | -1,0                 | -0,1                 | 0,1                 | 0,0          |
| Industrial                   | 4,0                      | 15,0                        | 11,7                         | 2,9                  | 0,8                  | 0,1                  | 0,4                 | 0,5          |
| Tecnología de la información | 9,6                      | 25,5                        | 14,7                         | 9,4                  | 3,5                  | 0,3                  | 3,0                 | 3,4          |
| Materiales                   | 7,5                      | 10,2                        | 4,3                          | 5,6                  | -5,9                 | -0,4                 | 0,6                 | 0,2          |
| Bienes raíces                | -0,5                     | 5,1                         | 1,5                          | 3,5                  | -8,3                 | 0,1                  | 0,1                 | 0,1          |
| Servicios públicos           | -0,6                     | 7,6                         | 4,0                          | 3,4                  | -6,1                 | 0,0                  | 0,1                 | 0,1          |
| Total                        | --                       | 14,3                        | 10,8                         | 3,1                  | --                   | 0,0                  | 3,1                 | 3,1          |

Atribución al rendimiento – Efectos totales con renovación a 3 meses

|                   | Rendimiento total del Fondo | Rendimiento total del índice | Atrib. Geomét.       |                     |              |
|-------------------|-----------------------------|------------------------------|----------------------|---------------------|--------------|
|                   |                             |                              | Efecto de asignación | Efecto de selección | Efecto total |
| Marzo-23 - Jun-23 | 5,1                         | 5,9                          | 0,2                  | -0,9                | -0,8         |
| Jun-23 - Sept-23  | -3,6                        | -0,4                         | -1,1                 | -2,2                | -3,3         |
| Sept-23 - Dic-23  | 10,6                        | 6,5                          | 1,3                  | 2,5                 | 3,8          |
| Dic-23 - Marzo-24 | 14,3                        | 10,8                         | 0,0                  | 3,1                 | 3,1          |

Efectos totales a 3 meses

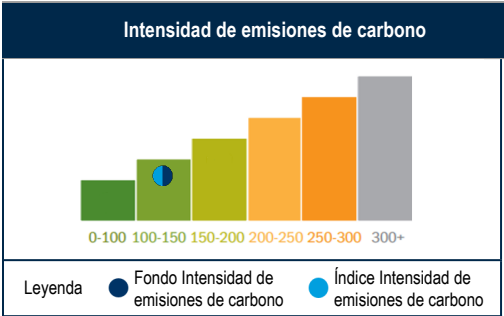


El análisis de atribuciones se calcula sobre una base geométrica diaria, a menos que se indique otra cosa. Los rendimientos del Fondo pueden dar lugar a factores residuales al compararlos con los rendimientos totales de la atribución geométrica debido a los datos y las metodologías de cálculo. La variación de las ponderaciones es la posición infraponderada/sobreponderada diaria media del Fondo con respecto al índice durante el periodo. La tabla y la gráfica de atribuciones solo muestran un máximo de 12 agrupaciones sobre la base de la ponderación final de cartera más elevada. El resumen de la atribución de los efectos totales con renovación a 3 meses está basado en las mismas agrupaciones que la atribución del ejercicio corriente.

El Fondo tiene un objetivo de inversión sostenible y se clasifica en virtud del artículo 9 del Reglamento de la UE 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR).

Métricas de inversión responsable

|                                                                                                                     | Fondo  | Índice* | Inclinación |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------|-------------|
| Intensidad de emisiones de carbono<br>Media ponderada (tCO2e/1 m \$ ventas)                                         | 133,00 | 134,30  | +1,30       |
| Exposición a controversias<br>Exposición a entidades controvertidas¹                                                | --     | 0,19%   | +0,19%      |
| Puntuación ESG de MSCI<br>Media ponderada (10 equivale a la calidad más elevada y 0 equivale a la calidad más baja) | 8,13   | 6,77    | +1,36       |



\*MSCI ACWI Index.

Cierta información ©2024 MSCI ESG Research LLC. Reproducción permitida. No se autoriza la distribución posterior.¹Fuente: UNGC: Pacto Mundial de las Naciones Unidas; OIT: normas fundamentales del trabajo de la Organización Internacional del Trabajo; UNGPBR: Principios Rectores sobre las empresas y los derechos humanos de las Naciones Unidas

Intensidad de emisiones de carbono

Esta calificación mide las emisiones de carbono en relación con el tamaño de una empresa, que se mide a partir de los ingresos y no de la capitalización bursátil. La medida que se utiliza son las toneladas de CO2 emitido (tCO2e) por cada millón de dólares de ingresos. Ofrecemos datos del Fondo en general basados en las ponderaciones de los valores mantenidos y una comparación con datos similares del Índice. La intensidad de emisiones de carbono ofrece una indicación de la eficiencia en materia de carbono. Esta medida permite la comparación con otros fondos y clases de activos.

Exposición a controversias

Evaluamos la exposición a las controversias utilizando tres marcos internacionales que cubren las normas de la práctica: el Pacto Mundial de las Naciones Unidas, las normas fundamentales del trabajo de la Organización Internacional del Trabajo y los Principios Rectores sobre las empresas y los derechos humanos de las Naciones Unidas. Medimos la proporción del Fondo asociada al incumplimiento de los tres marcos y la comparamos con datos similares del índice.

Puntuación ESG de MSCI

La puntuación ESG de MSCI utiliza la propia metodología de MSCI para evaluar la eficacia de las empresas en la gestión de su exposición a factores ESG. Las empresas con las calificaciones más altas son aquellas que, según la evaluación, gestionan mejor su exposición a los riesgos y oportunidades ESG importantes. Si la puntuación de la cartera es superior a la del índice de referencia, la cartera está sobreponderada en los emisores que gestionan sus exposiciones a factores ESG mejor que otros.

Inclinación

La cifra de «Inclinación» muestra el sesgo del Fondo en relación con el Índice y se expresa como la diferencia aritmética en la ponderación. Una inclinación positiva indica un sesgo hacia un perfil de IR «mejor» que el del Índice.

Se emplean medidas con fines comparativos en relación con las características ESG del Fondo y las respectivas del Índice. Asimismo, el Índice sirve como referencia y permite comparar el rendimiento financiero. Por lo tanto, el Índice no está diseñado para considerar específicamente las características ambientales o sociales.

Para obtener más información sobre la inversión responsable (IR) o acerca de los términos de inversión empleados en el presente documento, consulte el glosario publicado en el Centro de documentación de nuestro sitio web: <https://www.columbiathreadneedle.es/es/ret/sobre-nosotros/inversion-responsable/>. La decisión de invertir en el Fondo promovido también debe tener en cuenta todas las características o los objetivos de dicho Fondo, según se describe en su folleto o en la información que se divulgue a los inversores de acuerdo con el artículo 23 de la Directiva 2011/61/UE.

Las puntuaciones relativas a la materialidad ESG y la intensidad de emisiones de carbono se obtienen a partir de la media ponderada de los últimos 12 meses. Para periodos inferiores a 12 meses, la media se calculará según los meses disponibles. La media ponderada se calcula utilizando la misma ponderación del parámetro registrado cada día hábil de los 12 meses anteriores. La cifra de ventas del denominador de la intensidad de carbono es una medida de ingresos. La cobertura es el porcentaje del valor de mercado de la cartera, que consta de las participaciones existentes en cada parámetro aplicable. El efectivo y los derivados están excluidos de la cobertura. El MSCI otorga a los emisores una puntuación aprobada, en seguimiento o suspensa, según su desempeño en relación con los principios contemplados en los siguientes tres documentos: el Pacto Mundial de la ONU, las normas fundamentales del trabajo de la Organización Internacional del Trabajo y los Principios Rectores sobre las empresas y los derechos humanos de las Naciones Unidas. Si la puntuación en relación con alguno de estos tres documentos está suspensa, las inversiones mantenidas se considerarán controvertidas.

Este informe contiene cierta información (la "Información") procedente de MSCI ESG Research LLC, sus empresas vinculadas o sus proveedores de información (las "Partes ESG"). La Información debe destinarse exclusivamente a un uso interno y no se puede reproducir ni divulgar posteriormente de ninguna forma, ni se puede utilizar como base o componente de ningún índice, producto o instrumento financiero. Si bien las Partes ESG obtienen información de fuentes que consideran fiables, ninguna de las referidas partes garantiza la originalidad, exactitud o integridad de los datos que se incluyen en el presente documento y, además, todas las partes en cuestión niegan de forma expresa la prestación de cualquier garantía, explícita o implícita, lo que incluye las de comercialidad o idoneidad para un fin específico. Los datos de MSCI no deben entenderse como asesoramiento ni recomendación de inversión para tomar o abortar cualquier tipo de decisión de inversión, por lo que no puede basarse en ellos como tal. Asimismo, tampoco deben concebirse como indicación o garantía de rendimientos futuros, ni considerarse equiparables a análisis, previsiones o predicciones. Ninguna de las Partes ESG se responsabiliza de los posibles errores u omisiones en relación con los datos incluidos en el presente documento, ni de ningún otro daño directo, indirecto, especial, punitivo, incidental o de otra naturaleza (lo que incluye el lucro cesante), incluso si se notifica la posibilidad de que se produzcan tales daños.

Clases de acciones disponibles

| Acción | Clase | con cobertura | Moneda | Impuesto | OCF   | Fecha de la OCF | Gastos de entrada máximos | Gastos de salida máximos | Costes operativos | Inv. mín. | Lanzamiento | ISIN         | SEDOL   | BBID       | WKN/Valor/CUSIP |
|--------|-------|---------------|--------|----------|-------|-----------------|---------------------------|--------------------------|-------------------|-----------|-------------|--------------|---------|------------|-----------------|
| AEH    | Acc   | Si            | EUR    | Gross    | 1,70% | 31/12/23        | 3,00%                     | 0,00%                    | 0,20%             | 2.500     | 19/05/21    | LU2282709463 | BNC2FF4 | COOGEAE LX | A2QNPP          |
| AU     | Acc   | No            | USD    | Gross    | 1,70% | 31/12/23        | 3,00%                     | 0,00%                    | 0,11%             | 2.500     | 19/05/21    | LU2282709976 | BND73F4 | COOGEAU LX | A2QNPT          |
| IE     | Acc   | No            | EUR    | Gross    | 0,75% | 31/12/23        | 0,00%                     | 0,00%                    | 0,11%             | 100.000   | 19/05/21    | LU2282710552 | BND73L0 | COOGIEA LX | A2QNPX          |
| IEH    | Acc   | Si            | EUR    | Gross    | 0,75% | 31/12/23        | 0,00%                     | 0,00%                    | 0,20%             | 100.000   | 19/05/21    | LU2282710719 | BND73N2 | COOGEIE LX | A2QNPZ          |
| IU     | Acc   | No            | USD    | Gross    | 0,75% | 31/12/23        | 0,00%                     | 0,00%                    | 0,11%             | 100.000   | 19/05/21    | LU2282711105 | BND73S7 | COOGEIU LX | A2QNP4          |
| ZE     | Acc   | No            | EUR    | Gross    | 0,90% | 31/12/23        | 0,00%                     | 0,00%                    | 0,11%             | 1.500.000 | 19/05/21    | LU2282712095 | BND7417 | COOGEZE LX | A2QNNC          |
| ZU     | Acc   | No            | USD    | Gross    | 0,90% | 31/12/23        | 0,00%                     | 0,00%                    | 0,11%             | 2.000.000 | 19/05/21    | LU2282712418 | BND7451 | COOGEZU LX | A2QNNQ          |

Puede que las clases de acciones que figuran en la tabla no estén disponibles para todos los inversores. Consulte el Folleto para obtener más información. Efecto general de los costes: Los costes y la rentabilidad prevista pueden aumentar o disminuir como resultado de las fluctuaciones de los tipos de cambio y las divisas, en caso de que los costes se paguen en una divisa distinta de su divisa local. La cifra de gastos corrientes (OCF), los gastos de salida (importe máximo que se deducirá y que se muestra en la tabla anterior) y los costes operativos muestran el porcentaje que puede deducirse de su rentabilidad prevista. Por lo general, la OCF generalmente se basa en los gastos del ejercicio anterior e incluye gastos tales como el gasto de gestión anual y los costes de funcionamiento del Fondo. Los costes operativos que se muestran se basan en un promedio total de tres años y se calculan según el informe y las cuentas al final del ejercicio fiscal. En el caso de los fondos con menos de 3 años de existencia, los costes operativos se basan en los costes reales y aproximados. Todos los costes operativos están actualizados a 31/12/23. Puede que no se incluyan comisiones de intermediación o distribución adicionales. En algunos casos, la OCF puede basarse en un cálculo estimado de gastos futuros. Si desea un desglose más detallado, visite [www.columbiathreadneedle.com/fees](http://www.columbiathreadneedle.com/fees).

Información importante

Para uso exclusivo de clientes profesionales o tipos de inversores equivalentes en su jurisdicción exclusivamente (no debe usarse con clientes minoristas, ni transmitirse a estos). Columbia Threadneedle (Lux) II es una sociedad de inversión con sede en Luxemburgo con capital variable ("SICAV"), gestionada por Threadneedle Management Luxembourg SA Este material no debe interpretarse como una oferta, solicitud, consejo o recomendación de inversión. Este aviso es válido a partir de la fecha de publicación y puede estar sujeto a cambios sin previo aviso. La información de fuentes externas se considera confiable, pero no hay garantía en cuanto a su exactitud o integridad. El Folleto actual de la SICAV, el Documento de Datos Fundamentales y el resumen de los derechos del inversor están disponibles en inglés y / o italiano (cuando corresponda) en la Sociedad Gestora Threadneedle Management Luxembourg SA, International Financial Data Services (Luxemburgo). SA, su asesor financiero y / o en nuestro sitio web [www.columbiathreadneedle.it](http://www.columbiathreadneedle.it). Threadneedle Management Luxembourg S.A. podrá decidir rescindir los acuerdos celebrados para la comercialización de la SICAV. Emitido por Threadneedle Management Luxembourg S.A. inscrita en el Registre de Commerce et des Sociétés (Luxemburgo), con número de registro B 110242, 44 rue de la Vallée, L-2661 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo. Columbia Threadneedle Investments es la marca global del grupo de empresas Columbia y Threadneedle.

Fuente de datos del Índice: MSCI. Los datos de MSCI son únicamente para uso interno y no se pueden reproducir ni divulgar de ninguna forma, ni se pueden utilizar como base o componente de ningún índice, producto o instrumento financiero. Los datos de MSCI no constituyen ningún consejo o recomendación de inversión para tomar o abstenerse de tomar cualquier tipo de decisión de inversión, por lo que no puede basarse en ellos como tal. Los análisis y datos históricos no se deben tomar como una indicación o garantía de análisis o previsiones de rendimiento futuro. Los datos de MSCI se proporcionan "tal cual" y el usuario de los mismos asume completamente el riesgo del uso que haga de ellos. MSCI, sus filiales y todas las personas involucradas o relacionadas con la recopilación, el cálculo o la creación de datos de MSCI (conjuntamente, las "Partes de MSCI") rechazan expresamente todas las garantías (incluidas, entre otras, las garantías de originalidad, exactitud, integridad, puntualidad, no infracción, comercialización e idoneidad para un fin determinado) con respecto a dichos datos. Sin perjuicio de lo mencionado anteriormente, las Partes de MSCI no se responsabilizarán en ningún caso de los daños directos, indirectos, especiales, incidentales, punitivos, consecuentes (incluida, entre otras, la pérdida de beneficios) o de cualquier otro tipo. ([www.msci.com](http://www.msci.com)) La Standard & Poor's GICS History fue desarrollada por S&P Global Market Intelligence LLC («S&P») y es propiedad exclusiva y una marca de servicio de S&P. Threadneedle Asset Management Limited ha obtenido una licencia para su uso con fines específicos. La Global Industry Classification Standard (GICS®) fue desarrollada por MSCI Inc. y S&P Global Market Intelligence Inc. («S&P Global Market Intelligence») y/o es propiedad exclusiva de dichas entidades. La GICS es una marca de servicio de MSCI y S&P Global Market Intelligence, y Threadneedle Asset Management Limited ha obtenido una licencia para su uso con fines específicos.