

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

Name des Produkts: Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300FG0S32L53EKJ87

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_\_\_%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_\_\_%

Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von \_\_\_\_\_% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifizierungssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



### Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Während der Unterberater den finanziellen Ergebnissen des Portfolios Vorrang einräumt, fördert er ökologische und soziale Merkmale, indem er Maßnahmen für verantwortungsvolle Investitionen in den Investitionsentscheidungsprozess einbezieht, die im Folgenden näher erläutert werden:

Anwendung des Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating-Modells, das vom Portfolio eingesetzt wird, um in Bezug auf die wesentlichen ESG-Kriterien im Vergleich zum EMIX Smaller European Companies Index positiv abzuschneiden;

Beispiele für ökologische und soziale Merkmale, die das Portfolio aufgrund seines vorteilhaften ESG Materiality-Profiles bewirbt, sind unter anderem:

Umwelt: Energieeffizienz, Reduzierung von Treibhausgasemissionen, Abfallbehandlung;

Soziales: Achtung von Menschenrechten und Arbeitnehmerrechten, Gesundheit und Sicherheit sowie Diversität des Personals.

Der Unterberater schließt auch Unternehmen aus, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze der Unternehmensführung verstoßen, wie vom Unterberater festgelegt, sowie andere Ausschlüsse wie umstrittene Waffen und Atomwaffen.

Er verwendet keinen Referenzwert, um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● ***Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?***

Das Portfolio verfügt über die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, die die oben erläuterten Maßnahmen widerspiegeln:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche ESG Materiality Rating des Portfolios gegenüber dem EMIX Smaller European Companies Index, bewertet über rollierende 12-Monats-Zeiträume.
- Der Unterberater wird mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken ESG Materiality Rating investieren. Bei Bedarf kann der Unterberater Unternehmen, die nicht durch sein ESG Materiality Rating-Modell abgedeckt sind, anhand fundamentaler Analysen beurteilen oder sich bei Unternehmen, die ein niedriges ESG Materiality Rating haben, für Verbesserungen einsetzen, um dieses Mindestengagement von 50 % zu erreichen.
- Der Unterberater schließt Unternehmen aus, die seiner Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards, z. B. die Grundsätze des UN Global Compact, verstoßen.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind sie auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios. Weitere Informationen hierzu finden Sie weiter unten.

● ***Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

entfällt

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

**Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele erheblich schaden?**

entfällt

**Inwieweit wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

entfällt

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

entfällt

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

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ gilt nur für die dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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



**Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Ja

Nein

Nein, der Unterberater berücksichtigt nicht die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren für das Portfolio.



**Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?**

Die Anlagestrategie des Portfolios besteht darin, Kapitalzuwachs zu erzielen, indem es vorwiegend in die Aktienwerte kleinerer europäischer Unternehmen investiert, die zum Kaufdatum nicht unter den 300 größten Unternehmen des FTSE World Europe Index vertreten sind. Um die Förderung ökologischer und sozialer Merkmale zu erreichen, bevorzugt der Unterberater tendenziell Unternehmen, die im Columbia Threadneedle ESG Rating-Modell eine hohe Punktzahl erzielen. Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze verstoßen, wie vom Unterberater festgelegt, werden ebenfalls vom Portfolio ausgeschlossen.

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

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Um die Förderung von ökologischen und sozialen Merkmalen zu unterstützen und zu verbessern, wird der Unterberater den proaktiven Dialog (Engagement) mit Unternehmen suchen. Dabei wird er bei den Managementteams auf bessere Praktiken hinwirken, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO2-Emissionen.

Die Anlagestrategie wird im Rahmen des Investmentprozesses kontinuierlich wie folgt beibehalten: Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wird durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen und die kontinuierliche Überprüfung gewährleistet. Das positive ESG Materiality Rating gegenüber dem Index wird täglich von den Compliance-Systemen des Unterberaters geprüft.

● ***Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?***

Die folgenden Elemente der ESG-Anlagestrategie sind für das Portfolio bindend:

**1. Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating**

Das Portfolio muss insgesamt ein positives, gewichtetes durchschnittliches ESG Materiality Rating im Vergleich zum EMIX Smaller European Companies Index über rollierende 12-Monats-Zeiträume aufrechterhalten und die Ausschlussrichtlinien einhalten. Weitere Informationen hierzu sind nachfolgend aufgeführt.

Das Portfolio strebt einen positiven Vergleich mit dem EMIX Smaller European Companies Index über rollierende 12-Monats-Zeiträume an. Als Maßstab für die Bewertung wird das Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating (das „Modell“) herangezogen – ein firmeneigenes Modell, das auf dem Rahmenwerk des Sustainability Accounting Standards Board (SASB®) basiert. Das SASB-Rahmenwerk identifiziert die finanziell wesentlichen Risikofaktoren in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) über ein breites Spektrum von Sektoren hinweg.

Das Modell ermöglicht es dem Unterberater, eine erweiterte Analyse durchzuführen, um potenzielle wesentliche ESG-Risiken und -Chancen in den vom Portfolio gehaltenen oder für eine Investition durch das Portfolio in Frage kommenden Wertpapieren zu identifizieren und zu bewerten. Der Unterberater wird tendenziell Unternehmen bevorzugen, die im Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating eine hohe Punktzahl erreichen, sodass das Portfolio im Vergleich zum EMIX Smaller European Companies Index auf rollierender 12-Monats-Basis eine positive Entwicklung zugunsten von ESG-Merkmalen aufweist. Vorbehaltlich der nachstehenden Ausschlussrichtlinien ist der Unterberater jedoch nicht verpflichtet, nur in Unternehmen mit einem guten ESG-Score zu investieren, und er kann, um das Anlageziel des Portfolios zu erreichen, in Unternehmen mit einem ESG-Score investieren, der unter Umständen schlechter ist als der Indexdurchschnitt.

Wenn genügend Daten zur Verfügung stehen, bewertet das Modell die Wertpapiere auf einer numerischen Skala. Ein gutes Rating gibt an, dass das Unternehmen ESG-Risiken im Vergleich zu seinen Mitbewerbern gut managt, und ein schlechtes Rating bedeutet, dass das Unternehmen ESG-Risiken im Vergleich zu seinen Mitbewerbern schlechter bewältigt. Die Ratings unterstützen den Unterberater bei der Analyse von Faktoren, die für Investitionsgelegenheiten möglicherweise relevant sind, und dienen unter anderem als Grundlage für die Zusammenarbeit mit dem Management, die Verbesserung der qualitativen Analyse und die Verwaltung des gewichteten ESG-Engagements des Portfolios auf einer rollierenden 12-Monats-Basis im Vergleich zum Index.

Der Unterberater muss mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken ESG Materiality Rating investieren. Bei Bedarf kann der Unterberater Unternehmen, die nicht durch sein ESG Materiality Rating-Modell abgedeckt sind, anhand fundamentaler Analysen beurteilen oder sich bei Unternehmen, die ein niedriges ESG Materiality Rating haben, für Verbesserungen einsetzen, um dieses Mindestengagement von 50 % zu erreichen.

## 2. Ausschlüsse: Verletzung internationaler Standards

Das Portfolio schließt Unternehmen aus, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze verstoßen, wie vom Unterberater festgelegt, darunter unter anderem der Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte. Weitere Einzelheiten zu den Ausschlüssen sind nachfolgend aufgeführt.

3. Sonstige Ausschlüsse
Umstrittene Waffen gemäß der Richtlinie von Columbia Threadneedle zu umstrittenen Waffen
Nuklearwaffen – direkte Beteiligung: Emittenten, die an Sprengköpfen und Raketen, spaltbarem Material und Komponenten für den ausschließlichen Gebrauch beteiligt sind

### ● *Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?*

Es besteht keine Verpflichtung, den Umfang der Investitionen vor Anwendung der Anlagestrategie um ein Minimum zu reduzieren. Die Anwendung der Ausschlusspolitik hat jedoch zur Folge, dass sich die Zahl der für das Portfolio verfügbaren Wertpapiere verringert.

### ● *Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?*

Bei den Unternehmen, in die investiert wird, erfolgt vor der Investition eine Bewertung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung und nach der Investition eine kontinuierliche Überprüfung der guten Unternehmensführung. Der Unterberater greift auf Daten Dritter zurück, um die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung eines Unternehmens zu bewerten, und ergänzt diese durch seine Fundamentalanalyse.

**Vor der Investition:** Der Unterberater führt zunächst eine Bewertung durch, bevor er in ein Unternehmen investiert. Er kann mit dem Unternehmen in Kontakt treten, um bestimmte Probleme besser zu verstehen oder Verbesserungen zu fördern. Wenn die Bewertung jedoch ergibt, dass das Unternehmen schlechte Unternehmensführungspraktiken aufweist, investiert der Unterberater nicht in dessen Wertpapiere.

**Nach der Investition:** Unternehmen, in die investiert wird, werden kontinuierlich überwacht, um sicherzustellen, dass sich die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung nicht wesentlich verschlechtern. Wenn Probleme bekannt werden, kann der Unterberater im Rahmen seiner Prüfung mit dem Unternehmen in Kontakt treten, um diese Probleme zu klären. Wenn jedoch die Auffassung vertreten wird, dass das Unternehmen nicht mehr über eine gute Unternehmensführung verfügt, werden die Wertpapiere aus dem Portfolio veräußert.

Der Unterberater hat ein datengestütztes Modell entwickelt, das schlechte Verfahrensweisen und Kontroversen in Bezug auf die in der Offenlegungsverordnung beschriebenen vier Säulen der guten Unternehmensführung aufzeigt, um seine Bewertung und Überwachung der Unternehmen, in die er investiert, zu unterstützen. Das Modell umfasst Folgendes:

1. **Vorstandsstruktur:** einschließlich der Zusammensetzung des Vorstands und der wichtigsten Ausschüsse, Diversität und Integration sowie Verpflichtungen und Richtlinien.

**Die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.

2. Vergütung: einschließlich leistungsbezogener Vergütung, Nutzung von Aktien, Vergütung von Angestellten in nicht leitenden Positionen und Kündigungsverfahren.
3. Arbeitnehmerbeziehungen: einschließlich der Einhaltung von Arbeitsnormen unter anderem in Bezug auf Kinderarbeit, Diskriminierung sowie Gesundheit und Sicherheit.
4. Steuerqualität: einschließlich Steuerberichterstattung und Körperschaftsteuerlücke.



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

## **Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?**

**Bezüglich des geplanten Anteils an Investitionen, die getätigt werden, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen (#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale):**

Das Portfolio investiert vornehmlich in die Aktienwerte kleinerer Unternehmen in Europa. Vorbehaltlich der Ausschlusspolitik gibt es keine Einschränkungen in Bezug auf die Sektoren, in denen sie tätig sind.

Mindestens 75 % der Aktienwerte des Portfolios unterliegen der Anwendung des ESG Materiality Rating-Modells. Diese Wertpapiere werden in die Berechnung des gewichteten durchschnittlichen ESG Materiality Ratings des Portfolios einbezogen.

Der Mindestanteil der im Portfolio gehaltenen Anlagen zur Förderung der ökologischen oder sozialen Merkmale beträgt 50 % seines Gesamtnettovermögens. Wie vorstehend beschrieben, gehört das ESG Materiality Rating-Modell zu den Maßnahmen, die zum Erreichen der vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt werden. Das Portfolio kann in Unternehmen mit schlechteren ESG Materiality Ratings als der Index investieren, wird aber tendenziell Unternehmen mit guten Bewertungen bevorzugen, um sicherzustellen, dass das Portfolio im Vergleich zum EMIX Smaller European Companies Index ein besseres gewichtetes durchschnittliches ESG Materiality Rating aufweist.

Mindestens 50 % der im Portfolio gehaltenen Investitionen werden in Unternehmen mit einem starken ESG-Materiality Rating getätigt. Nur Investitionen in Unternehmen mit starken ESG Materiality Ratings werden als auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet angesehen. Unternehmen mit schlechteren Ratings sind nicht auf diese Merkmale ausgerichtet. Bei Bedarf kann der Unterberater Unternehmen, die nicht durch sein ESG Materiality Rating-Modell abgedeckt sind, anhand fundamentaler Analysen beurteilen oder sich bei Unternehmen, die ein niedriges ESG Materiality Rating haben, für Verbesserungen einsetzen, um dieses Mindestengagement von 50 % zu erreichen.

Alle Aktieninvestitionen unterliegen der Ausschlusspolitik, um sicherzustellen, dass auch bei den Unternehmen, die kein starkes ESG Materiality Rating oder ein schlechteres Rating als der Referenzwert aufweisen, Mindestschutzmaßnahmen in Bezug auf Umwelt und Soziales bestehen.

### **In Bezug auf die anderen Investitionen (#2 Andere Investitionen):**

Zu den anderen Investitionen können (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden; (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die

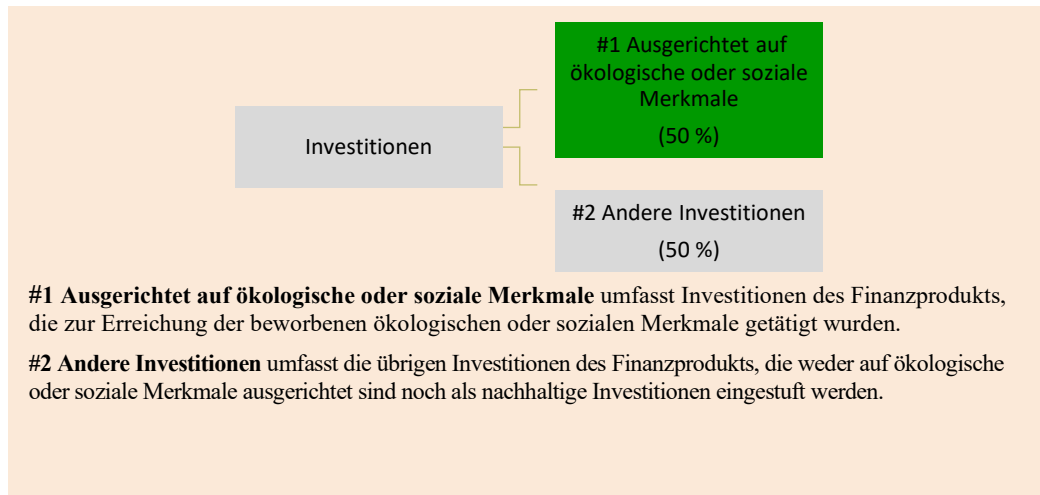
für Treasury-Zwecke gehalten werden; und (iii) Derivate zu Absicherungszwecken gehören.

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

Angesichts der vorstehenden Ausführungen beträgt der geplante maximale Anteil der Investitionen, die nicht verwendet werden, um zu den durch das Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen beizutragen, 50 % seines Gesamtnettovermögens.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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



**Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?**

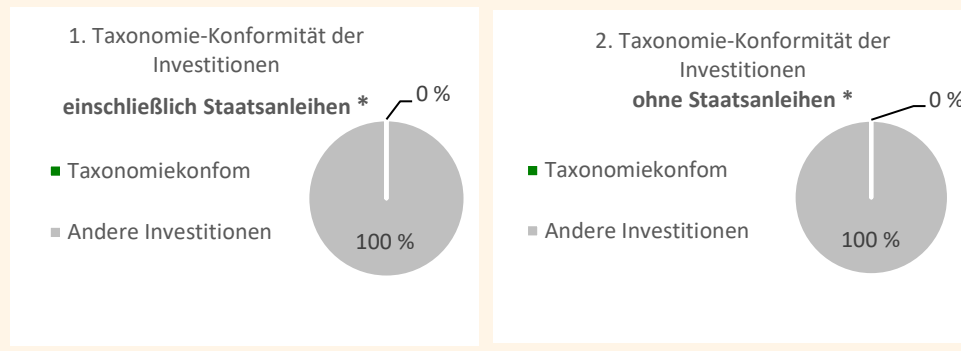
Das Produkt setzt keine Derivate zum Erreichen der ökologischen oder sozialen Merkmale ein.



**In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Das Produkt verpflichtet sich nicht, einen Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem EU-Taxonomie-konformen Umweltziel zu halten.


**In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



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

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

\*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

● **Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

entfällt



● **Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

entfällt



● **Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

entfällt



● **Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Alle Aktienanlagen unterliegen der Ausschlusspolitik, um sicherzustellen, dass auch bei Unternehmen, die kein starkes ESG Materiality Rating aufweisen, Mindestschutzmaßnahmen in Bezug auf Umwelt und Soziales bestehen.

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

● **Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?**

Nein, der EMIX Smaller European Companies Index wird nicht als Referenzwert zur Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale herangezogen, die das Portfolio bewirbt.

● **Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?**

entfällt



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



● *Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?*

entfällt

● *Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?*

entfällt

● *Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?*

entfällt



**Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?**

**Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:**

<https://www.columbiathreadneedle.lu/en/retl/our-funds/find-your-fund>