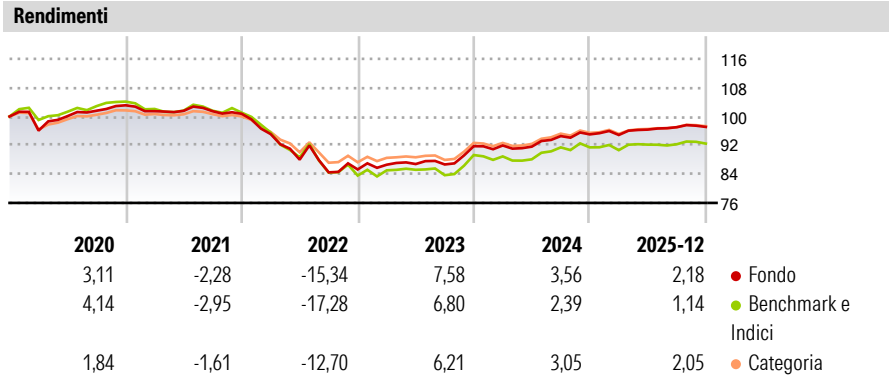


CT (Lux) - European Social Bond Fund ZEP EUR Distribution

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Diversificati EUR	Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR Usato nel Report	50% BofAML Euro Corp Euroland Issuers, 50% ICE BofA EUR Non-Sov TR EUR	★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Portfolio is actively managed and seeks to achieve a total return from income and capital appreciation by investing in debt securities that are considered to provide positive social outcomes by supporting or funding socially beneficial activities and development principally in Europe. To meet its objective, the Portfolio invests at least 90% of its net assets in all forms of debt securities issued by a government or a supranational, public, private or voluntary and/or charitable sector organisation, whether they have a fixed, floating, variable or index-linked rate or have a zero coupon. These securities may include covered bonds, agency bonds, mortgage and assetbacked securities (the mortgage and asset-backed securities not exceeding...



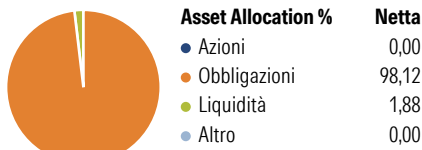
Misure di Rischio			
3Y Alpha	1,05	3Y Sharpe Ratio	0,42
3Y Beta	0,75	3Y Std Dev	3,45
3Y R-Squared	93,56	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,71	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	1,41	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,26	0,13	0,19	Trimestrali %				
6-Mesi	1,30	1,19	1,35	2026	-	-	-	-
1-Anno	3,39	2,68	2,95	2025	-0,17	1,58	0,69	0,08
3-Anni Ann.ti	3,95	2,96	3,26	2024	0,21	-0,37	3,22	0,49
5-Anni Ann.ti	-0,95	-2,10	-0,95	2023	1,54	0,22	-0,14	5,87
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-5,59	-7,47	-4,01	0,95

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Box™	Duration Effettiva 4,76		o		o
Maturity effettiva	-	AAA	24,56	BBB	27,69
Qualità Credito Media	A	AA	12,73	BB	0,47
		A	34,30	B	0,00
				Below B	0,00
				Not Rated	0,25

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Kreditanstalt Fuer...	—	1,91
The Wellcome Trust Ltd. 1.125%	—	1,86
European Investment Bank...	—	1,67
Germany (Federal Republic...	—	1,62
Eurogrid GmbH 1.113%	—	1,60
Intesa Sanpaolo S.p.A. 6.625%	—	1,57
AIB Group PLC 4.625%	—	1,55
Bayerische...	—	1,48
Avinor AS 3.5%	—	1,37
Praemia Healthcare 1.375%	—	1,35
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		15,99
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		243

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	38,35
Societario	56,81
Cartolarizzazioni	2,96
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	1,88
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	3,12
Da 0 a 4 cedole	79,39
Da 4 a 6 cedole	14,82
Da 6 a 8 cedole	2,41
Da 8 a 10 cedole	0,25
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	16,03
da 3 a 5	20,33
da 5 a 7	22,21
da 7 a 10	19,90
da 10 a 15	10,59
da 15 a 20	4,60
da 20 a 30	3,78
oltre 30	0,52

Anagrafica

Società di Gestione	Threadneedle Management Luxembourg S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	4,02 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.500.000 EUR
Telefono	+44 (0)20 7464 5437	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.columbiathreadneedl e.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,45%
		UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
		Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	24/04/2019	ISIN	LU1979273130		
Nome del Gestore	Tammie Tang				
Data Inizio Gestione	30/06/2022				
NAV (29/01/2026)	EUR 8,96				

CT (Lux) - European Social Bond Fund ZEP EUR Distribution

Patrimonio Netto (Mln)	503,79 EUR
(31/12/2025)	