

Columbia Threadneedle (Irl) III plc
(vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

Kurzgefasster Halbjahresbericht und ungeprüfter Abschluss
für das Halbjahr zum 30. September 2022
Registernummer 302305

Part of



Kurzgefasster Halbjahresbericht und ungeprüfter Abschluss

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

(Eine nach irischem Recht gegründete Investmentgesellschaft mit veränderlichem Kapital, Umbrella-Struktur und getrennter Haftung zwischen den Teilfonds)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

INHALTSVERZEICHNIS

Management und Verwaltung	2
Berichte der Anlageverwalter	
– <i>CT European Real Estate Securities Fund</i>	3
– <i>CT Real Estate Equity Market Neutral Fund</i>	4
– <i>CT Multi-Strategy Global Equity Fund</i>	5
Ungeprüfter Anlagenbestand	6
Ungeprüfter Nettovermögensausweis	23
Ungeprüfte Gesamterfolgsrechnung	25
Ungeprüfter Ausweis der Veränderung des Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens	27
Erläuterungen zum Abschluss	29
Wesentliche Bestandsveränderungen	46
Anhang 1 – Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften	50
Allgemeine Informationen	54
Anfragen	55

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

MANAGEMENT UND VERWALTUNG

Geschäftssitz

Sir John Rogerson's Quay 70
Dublin 2
Irland

Registernummer 302305

Verwaltungsrat

Drew Newman (britischer Staatsbürger)
(am 6. September 2022 ernannt)
Eimear Cowhey (irischer Staatsbürger)
(am 6. September 2022 ernannt)*
Liam Miley (irischer Staatsbürger)
(am 6. September 2022 ernannt)*
David Hammond (irischer Staatsbürger)
(am 6. September 2022 zurückgetreten)*
John Fitzpatrick (irischer Staatsbürger)
(am 6. September 2022 zurückgetreten)*
Charles Porter (britischer Staatsbürger)*
Stuart Woodyatt (britischer Staatsbürger)

Anlageverwalter

Thames River Capital LLP
Exchange House Primrose Street
London EC2A 2NY
Vereinigtes Königreich

Columbia Threadneedle Management Limited
(vormals, bis 4. Juli 2022, BMO Asset Management Limited)
Exchange House
Primrose Street
London EC2A 2NY
Vereinigtes Königreich

Gesellschaftssekretär

Matsack Trust Limited
Sir John Rogerson's Quay 70
Dublin 2
Irland

Verwaltungsstelle und Registerführer

State Street Fund Services (Ireland) Limited
Sir John Rogerson's Quay 78
Dublin 2
Irland

Schweizer Vertreter

Carnegie Fund Services S.A.
11, rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz

Verwaltungsgesellschaft

KBA Consulting Management Limited
5 George's Dock
Dublin 1
Irland

Verwahrstelle

State Street Custodial Services (Ireland) Limited
Sir John Rogerson's Quay 78
Dublin 2
Irland

Rechtsberater

Matheson
Sir John Rogerson's Quay 70
Dublin 2
Irland

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers
One Spencer Dock North Wall Quay
Dublin 1
Irland

Notierungssponsor an der Euronext Dublin

J&E Davy
Davy House
49 Dawson Street
Dublin 2
Irland

Zahlstelle in der Schweiz

Banque Cantonale de Genève
Quai de l'Île 17
Postfach 2251
1211 Genf 2
Schweiz

* Von den Anlageverwaltern unabhängige, nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder

CT European Real Estate Securities Fund

Strategie & Wertentwicklung

Die thesaurierende Anteilsklasse B GBP rentierte in den sechs Monaten zum 30. September 2022 -33,8 % (nach Gebühren) und stimmte somit genau mit dem Referenzindex, dem FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Capped Total Return (Net) Index, überein.

Seit seiner Auflegung im April 2010 erzielte der Teilfonds in 42 von 51 Quartalen eine Outperformance.

Die gesamteuropäischen Immobilienaktien verzeichneten eine massive Korrektur, da die Anleger die Fundamentaldaten des Sektors angesichts der hartnäckig hohen Inflation, die zu höheren Anleiherenditen führte, neu bewerteten. So stieg beispielsweise die Rendite der 10-jährigen deutschen Staatsanleihe um 0,77 Basispunkte auf 2,1 %, ein Niveau, das zuletzt im September 2011 erreicht worden war.

Dies führte zu einer starken Underperformance der Immobilienaktien (FTSE/EPRA Developed Europe Index TR, EUR) von -23,3% gegenüber dem breiteren Aktienmarkt (EuroStoxx 600), aber auch zu einem Regimewechsel bei der Volatilität, die im Vergleich zum langfristigen historischen Niveau von 15 % im Durchschnitt 28 % betrug.

Im Berichtszeitraum lag das Nettoengagement des Teilfonds durchschnittlich bei +98 %, bestehend aus 107 % Long-Positionen und -9 % Short-Positionen. Dies widerspiegelt unsere erweiterte Long-Strategie, im Rahmen derer wir einzelne, sorgfältig ausgewählte Short-Positionen eingehen, von deren künftiger negativer Entwicklung wir besonders überzeugt sind. Unser geringeres Nettoengagement im Vergleich zum vorangegangenen sechsmonatigen Berichtszeitraum spiegelt unsere konservativere Haltung und die unsicheren Aussichten für Immobilienaktien wider.

Zu den Hauptsektoren, die einen positiven Beitrag zur relativen Bruttoperformance geleistet haben, gehören Immobilien mit gemischter Nutzung in Schweden (+39 BP), deutsche Büroimmobilien (+58 BP), Immobilien mit gemischter Nutzung in der Schweiz (+37 BP), britische/irische Wohnimmobilien (+34 BP), Londoner Verkaufsflächen (+32 BP) und britische Gesundheitsimmobilien (+22 BP). Zu den nennenswerten Performancebremsen zählten Immobilien mit gemischter Nutzung in den Beneluxländern (-111 BP), britische Immobilienkonzerne (-34 BP) und Mietlager (-32 BP).

Marktaussichten

Die gesamteuropäische Bewertung von Immobilienaktien spiegelt derzeit die erheblichen Korrekturen im Wert der zugrunde liegenden Immobilien wider, die mit einem Abschlag von etwa 50 % auf den Nettoinventarwert und somit weit unter den historischen Durchschnittswerten gehandelt werden. Diese Bewertungsverschiebungen sind in erster Linie auf die Fremdkapitalkosten zurückzuführen, wobei die am niedrigsten rentierenden (und somit die am höchsten bewerteten) Sektoren unseres Universums am stärksten betroffen waren. Zu den grössten Verlierern zählten Industrie-/Logistik- und Wohnimmobilien. Dies sind auch die beiden Teilmärkte mit den besten Aussichten, aufgrund des anhaltenden Ungleichgewichts zwischen Nachfrage und Angebot. Diese Fundamentaldaten werden sich irgendwann wieder in der Entscheidungsfindung der Anleger niederschlagen.

Wir rechnen in nächster Zeit aufgrund der weiteren Straffung der geldpolitischen Zügel mit einer anhaltend starken Volatilität. Daher stellt sich die Frage, ob die Zentralbanken Anzeichen für eine Disinflation oder sogar eine Rezession abwarten müssen, bevor sie ihre Politik ändern. Entweder bleibt die Inflation hoch, wovon Immobilienunternehmen, insbesondere in Kontinentaleuropa, durch indexierte Mietverträge profitieren dürften, oder die Inflation geht zurück, was den Weg für einen Rückgang der Anleiherenditen ebnet dürfte, was wiederum zu einer Outperformance des börsennotierten Immobiliensektors führen könnte.

Thames River Capital LLP

Oktober 2022

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

Strategie & Wertentwicklung

Unseres Erachtens ist die Aufschlüsselung des geografischen Engagements nach Ländern nicht sinnvoll und kann sogar irreführend sein. Daher haben wir ein System entwickelt, das den gesamteuropäischen Immobilienaktienmarkt in 24 Teilsektoren unterteilt, wie beispielsweise in französische Büroimmobilien, deutsche Wohnimmobilien, Hotelimmobilien, europäische Einkaufszentren, britische Studentenwohnheime und britische Verkaufsflächen. Im Mai 2016 weiteten wir das geografische Anlageuniversum des Teilfonds aus und investieren seitdem bis zu 20 % des Vermögens in US-amerikanische REITs (Immobilien-Investmenttrusts). Damals betrug unser durchschnittliches Bruttoengagement in den USA 14 % und trug +163 Basispunkte (BP) zur Bruttoperformance bei. Die Strategie des Teilfonds blieb während des Berichtszeitraums trotz der erhöhten Volatilität unverändert.

Gesamteuropäische Immobilienaktien (FTSE/EPRA Developed Europe Index TR, EUR) erfuhren im Berichtszeitraum eine starke Korrektur von -36,3 %, da die Anleger die Fundamentaldaten des Sektors angesichts der hartnäckig hohen Inflation, die zu höheren Anleiherenditen führte, neu bewerteten. So stieg beispielsweise die Rendite der 10-jährigen deutschen Staatsanleihe um 0,8 Basispunkte auf 2,1 %, ein Niveau, das zuletzt im September 2011 erreicht worden war. Dies führte zu einer deutlichen Underperformance von Immobilienaktien von -23,3 % gegenüber dem breiteren Aktienmarkt (EuroStoxx 600), aber auch zu einem Regimewechsel bei der Volatilität, die im Durchschnitt 28 % gegenüber dem langfristigen historischen Niveau von 15 % betrug.

Die GBP-Klasse C des CT Real Estate Equity Market Neutral Fund rentierte in den sechs Monaten zum 30. September 2022 in GBP nach Gebühren -0,5 %.

Die Aktivität des Teilfonds war mit einer Umschlagsquote von 83,2 % (Käufe und Verkäufe geteilt durch zwei) sehr hoch, was die extreme Volatilität widerspiegelt, mit einer hohen Streuung sowohl für Teilsektoren als auch für einzelne Aktien. Das Brutto- und Nettoengagement des Teilfonds lagen im Berichtszeitraum durchschnittlich bei +94 % bzw. +0,1 %. Wir reduzierten unser Nettoengagement von +4,8 % auf -6,2 % zum Ende des Berichtszeitraums, indem wir unsere Long-Positionen um 6,6 % reduzierten und unsere Short-Positionen um 4,3 % ausbauten.

Zu den Teilsektoren, die am meisten zur Bruttoperformance des Teilfonds beigetragen haben, zählten die deutschen Büroimmobilien (+83 BP), die Immobilien mit gemischter Nutzung in der Schweiz (+67 BP), die britischen Wohnimmobilien (+49 BP), die Londoner Verkaufsflächen (+37 BP), die Immobilien mit gemischter Nutzung in Schweden (+37 BP), die Büroimmobilien in Stockholm (+34 BP), die britischen Gesundheitsimmobilien (+33 BP) und die britischen Verkaufsflächen (+30 BP). Unter den Performancebremsen in Europa sind die Immobilien mit gemischter Nutzung in den Beneluxländern (-175 BP), die deutschen Wohnimmobilien (-76 BP), die britischen Immobilienkonzerne (-55 BP), die Mietlager (-50 BP), die Supermärkte (-43 BP) und die Industrieimmobilien (-37 BP) zu erwähnen. Die Brutto-Outperformance in den USA betrug 19 BP und war den Gesundheits- (+16 BP) und Büroimmobilien (+7 BP) zu verdanken, deren Performance jedoch durch die Triple Net REITs (-7 BP) teilweise ausgeglichen wurde.

Marktaussichten

Die Bewertung der gesamteuropäischen Immobilienaktien spiegelt nun in allen Sektoren erhebliche Wertkorrekturen bei den zugrunde liegenden Immobilien wider. Der Preisfindungsprozess auf dem physischen Markt ist in vollem Gange. Diese Bewertungsverschiebungen sind in erster Linie auf die Fremdkapitalkosten zurückzuführen, wobei die am niedrigsten rentierenden (und somit die am höchsten bewerteten) Sektoren unseres Universums am stärksten betroffen waren. Zu den grössten Verlierern zählten Industrie-/Logistik- und Wohnimmobilien. Dies sind auch die beiden Teilmärkte mit den besten Aussichten, aufgrund des anhaltenden Ungleichgewichts zwischen Nachfrage und Angebot. Diese Fundamentaldaten werden sich irgendwann wieder in der Entscheidungsfindung der Anleger niederschlagen. Kurzfristig werden die Märkte jedoch weiterhin von der restriktiven Haltung der Zentralbanken geprägt sein. Daher stellt sich die Frage, ob die Zentralbanken Anzeichen für eine Disinflation oder sogar eine Rezession abwarten müssen, bevor sie ihre Politik ändern.

Wir werden uns weiterhin auf Unternehmen konzentrieren, die sowohl höheren Zinssätzen als auch einem rezessiven Umfeld bei unseren Long-Positionen standhalten können. Unternehmen, die aufgrund von schlechter Schuldenabsicherung, Vertragsverletzungen und/oder Rating-Herabstufungen sowie ihrer Unfähigkeit, die Inflation über die Mietverträge an ihre Mieter weiterzugeben, zu Gewinneinbussen neigen, bleiben unsere wichtigsten Short-Kandidaten.

CT Multi-Strategy Global Equity Fund

Wertentwicklung

Im Halbjahr zum 30. September 2022 rentierte das Portfolio -6,0 %. Der MSCI AC World NR Index rentierte im selben Zeitraum -7,3 %. Die Performance wird nach Gebühren und in Euro angegeben.

Die Umstellung auf eine Untergewichtung von Aktien wirkte positiv, da die Aktien nach unserer Reduzierung im August ausverkauft wurden. Die regionale Aktienallokation wirkte im Berichtszeitraum wertsteigernd, da die Übergewichtung in Grossbritannien und die Untergewichtung in den USA zu Beginn des Berichtszeitraums beide einen positiven Beitrag leisteten. Die Übergewichtung von US-Substantiteln gegenüber der Untergewichtung von US-Wachstumstiteln trug zur Performance bei. Die Aktienallokation trug im Berichtszeitraum insgesamt zur Wertsteigerung bei, wobei die Strategien Global Systematic und Global Sustainable besonders hohe Renditen erzielten, während Global Small Cap einen negativen Beitrag leistete.

Strategie

Während des Berichtszeitraums gingen wir zu einer Untergewichtung von Aktien und einer Übergewichtung von Barmitteln über. Wir reduzierten unsere Untergewichtung in US-Aktien und behielten eine Übergewichtung in Grossbritannien bei. Wir haben sowohl Japan als auch die Schwellenländer auf neutral reduziert und Europa ohne Grossbritannien von neutral auf untergewichtet umgestellt. Die Übergewichtung von Substanzaktien und die Untergewichtung der Wachstumstitel wurden während des gesamten Berichtszeitraums beibehalten.

Marktaussichten

Die Stimmung gegenüber Aktien ist nach wie vor äusserst pessimistisch, und die Märkte rechnen mit weiteren Gewinnrückgängen, wodurch die Bewertungen attraktiver werden. Die derzeitige Straffung der Geldpolitik in den meisten Ländern der Welt zur Bekämpfung der steigenden Kerninflation erfolgte zeitgleich mit mehreren Faktoren: dem Anstieg der Renditen der langfristigen britischen Staatsanleihen, der anhaltenden Stärke des US-Dollars, den sich verschlechternden Wachstumsaussichten in China, der anhaltenden Gaskrise in Europa und den Massnahmen des japanischen Finanzministeriums zur Verhinderung einer weiteren Währungsabwertung. Dies zeigt den Anlegern auf, dass viele Hürden zu überwinden sind, während wir darauf warten, dass der Inflationsdruck und die geldpolitische Straffung der Zentralbanken nachlassen, was erklärt, warum der Markt solche Entscheidungsschwierigkeiten hat. Zu Beginn der Berichtssaison sind die Erwartungen niedriger, was etwas beruhigend wirkt, aber die Marktvolatilität wird kurzfristig sehr wahrscheinlich anhalten.

Der CT Multi Strategy Global Equity Fund wird voraussichtlich im ersten Quartal 2023 geschlossen (vgl. Anmerkung 2 auf Seite 29).

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022

CT European Real Estate Securities Fund

Wertpapiere – 67,29% (31. März 2022: 69,07%)

Aktien – 67,29% (31. März 2022: 69,07%)

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. GBP	% des NIW
Diversifizierte Immobilienkonzerne – 18,49% (31. März 2022: 21,01%)				
Atrium Ljungberg	SEK	17.127	190	0,77
CA Immobilien Anlagen	EUR	8.089	216	0,87
Castellum	SEK	92.599	935	3,76
Dios Fastigheter	SEK	14.008	80	0,32
Inmobiliaria Colonial Socimi	EUR	86.331	374	1,51
Merlin Properties Socimi	EUR	57.748	401	1,61
Mobimo Holding	CHF	98	19	0,08
NSI	EUR	45.011	960	3,86
Picton Property Income (REIT)	GBP	7.444	6	0,02
Platzer Fastigheter Holding	SEK	12.529	68	0,27
PSP Swiss Property	CHF	3.527	318	1,28
Samhallsbyggnadsbolaget I Norden	SEK	82.808	81	0,33
Swiss Prime Site	CHF	13.187	948	3,81
			4.596	18,49
Gesundheit – 3,74% (31. März 2022: 3,69%)				
Aedifica	EUR	13.239	916	3,68
Cofinimmo	EUR	188	14	0,06
			930	3,74
Hotels – 0,54% (31. März 2022: 0 %)				
Pandox	SEK	14.106	135	0,54
			135	0,54
Industrie – 8,99% (31. März 2022: 10,17%)				
Argan	EUR	5.092	354	1,42
Catena	SEK	17.321	463	1,86
LondonMetric Property	GBP	202.908	354	1,43
Sagax	SEK	17.042	253	1,02
Tritax Big Box	GBP	489.109	664	2,67
VGP	EUR	113	10	0,04
Warehouses De Pauw	EUR	6.179	136	0,55
			2.234	8,99
Büros – 6,57% (31. März 2022: 6,64%)				
Aroundtown	EUR	244.717	485	1,95
Entra	NOK	15.672	131	0,53
Fabege	SEK	46.991	288	1,16
Gecina	EUR	8.758	618	2,48
Icade	EUR	3.349	112	0,45
			1.634	6,57
Immobilien – 0,54% (31. März 2022: 0 %)				
Sirius Real Estate	GBP	188.837	134	0,54
			134	0,54
Wohnimmobilien – 19,33% (31. März 2022: 22,03%)				
Deutsche Wohnen	EUR	9.449	162	0,65
Fastighets Balder (Klasse B)	SEK	137.342	496	2,00
Fortinova Fastigheter	SEK	106.605	192	0,77
Grand City Properties	EUR	17.405	156	0,63
Home	GBP	129.239	117	0,47
LEG Immobilien	EUR	15.600	840	3,38
TAG Immobilien	EUR	76.420	551	2,22
Vonovia ⁽¹⁾	EUR	117.500	2.290	9,21
			4.804	19,33
Einzelhandel – 0,49% (31. März 2022: 0 %)				
Supermarket Income	GBP	113.821	122	0,49
			122	0,49
Einkaufszentren – 8,33% (31. März 2022: 4,57%)				
Carmila	EUR	20.151	243	0,98
Eurocommercial Properties	EUR	6.163	110	0,44

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT European Real Estate Securities Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 67,29% (31. März 2022: 69,07%) (Fortsetzung)

Aktien – 67,29% (31. März 2022: 69,07%) (Fortsetzung)

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. GBP	% des NIW
Einkaufszentren – 8,33% (31. März 2022: 4,57%)				
Hamborner	EUR	15.682	97	0,39
Klepierre	EUR	38.371	603	2,43
Lar Espana Real Estate Socimi	EUR	25.827	98	0,39
Retail Estates	EUR	2.412	121	0,49
Unibail-Rodamco-Westfield	EUR	19.113	719	2,89
Vastned Retail	EUR	4.449	79	0,32
Studentenwohnheime – 0,27% (31. März 2022: 0,96%)				
Xior Student Housing	EUR	2.388	2.070	8,33
			67	0,27
Total Aktien – 67,29% (31. März 2022: 69,07%)			16.726	67,29
Total Wertpapiere – 67,29% (31. März 2022: 69,07%)			16.726	67,29

Finanzderivate – 1,73% (31. März 2022: 2,39%)

	Währung	Nominal- bestand	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. GBP	% des NIW
Differenzkontrakte – 1,58% (31. März 2022: 2,38%)				
Diversifizierte Immobilienkonzerne – 0,55% (31. März 2022: 0,13%)				
LXI	GBP	13.922	1	0,01
NP3 Fastigheter	SEK	5.522	60	0,24
Nyfosa	SEK	5.436	18	0,07
Peach Property Group	CHF	6.922	40	0,16
Standard Life Investment Property Income Trust	GBP	159.766	10	0,04
Wihlborgs Fastigheter	SEK	10.480	7	0,03
			136	0,55
Gesundheit – 0,08% (31. März 2022: 0%)				
Assura	GBP	49.117	3	0,01
Care Property Invest	EUR	2.208	11	0,04
Target Healthcare	GBP	39.451	7	0,03
			21	0,08
Industrie – 0,08% (31. März 2022: 0,44%)				
Aberdeen Standard European	GBP	10.222	2	0,01
Tritax EuroBox	GBP	45.672	18	0,07
			20	0,08
Immobilienkonzerne – 0% (31. März 2022: 0,31%)				
Büros – 0,10% (31. März 2022: 0,17%)				
Hufvudstaden	SEK	20.909	24	0,10
			24	0,10
Immobilien – 0,15% (31. März 2022: 0%)				
Dic Asset	EUR	16.391	36	0,15
			36	0,15
Wohnimmobilien – 0,25% (31. März 2022: 0,04%)				
Grainger	GBP	40.439	20	0,08
Irish Residential Properties	EUR	27.950	3	0,01
Kojamo	EUR	12.505	40	0,16
			63	0,25
Einzelhandel – 0,08% (31. März 2022: 0,14%)				
Shaftesbury	GBP	40.000	21	0,08
			21	0,08

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT European Real Estate Securities Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – 1,73% (31. März 2022: 2,39%) (Fortsetzung)

	Währung	Nominal- bestand	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. GBP	% des NIW
Differenzkontrakte – 1,58% (31. März 2022: 2,38%) (Fortsetzung)				
Mietlager – 0,17% (31. März 2022: 0,85%)				
Shurgard Self Storage	EUR	5.164	42	0,17
			<u>42</u>	<u>0,17</u>
Einkaufszentren – 0,04% (31. März 2022: 0,07%)				
Cibus Nordic	SEK	1.915	6	0,02
Citycon	EUR	15.457	1	-
Immobiliare Grande Distribuzione	EUR	6.053	4	0,02
			<u>11</u>	<u>0,04</u>
Studentenwohnheime – 0,08% (31. März 2022: 0,23%)				
Empiric Student Property	GBP	155.241	19	0,08
			<u>19</u>	<u>0,08</u>
Total Differenzkontrakte – 1,58% (31. März 2022: 2,38%)			393	1,58

Offene Devisenterminkontrakte – 0,15% (31. März 2022: 0,01%)

Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. GBP	% des NIW
Anlageebene – 0,15% (31. März 2022: 0,01%)						
GBP	1.145.318	CHF	1.286.000	27.10.2022	27	0,11
CHF	128.000	GBP	121.794	27.10.2022	5	0,02
SEK	5.102.000	GBP	414.415	27.10.2022	3	0,01
SEK	4.077.000	GBP	331.619	27.10.2022	2	0,01
					<u>37</u>	<u>0,15</u>
Klassenebene – 0,00% (31. März 2022: 0,00%)						
NOK	47.386	GBP	4.081	31.10.2022	-*	-
EUR	7.978	GBP	7.133	31.10.2022	-*	-
EUR	8.863	GBP	7.954	31.10.2022	-*	-
EUR	3.415	GBP	3.065	31.10.2022	-*	-
					<u>-</u>	<u>-</u>
Total Offene Devisenterminkontrakte – 0,15% (31. März 2022: 0,01%)					37	0,15
Total Finanzderivate – 1,73% (31. März 2022: 2,39%)					430	1,73

Finanzderivate – (12,76)% (31. März 2022: (1,60)%)

	Währung	Nominal- bestand	Nicht realisierter Verlust in Tsd. GBP	% des NIW
Differenzkontrakte – (12,45)% (31. März 2022: (1,26)%)				
Diversifizierte Immobilienkonzerne – (0,21)% (31. März 2022: (0,07)%)				
Custodian	GBP	93.175	(6)	(0,02)
Schroder Real Estate Investment Trust	GBP	105.216	(9)	(0,04)
UK Commercial Property Trust	GBP	147.350	(37)	(0,15)
			<u>(52)</u>	<u>(0,21)</u>
Gesundheit – (0,36)% (31. März 2022: (0,03)%)				
Primary Health Properties	GBP	331.029	(90)	(0,36)
			<u>(90)</u>	<u>(0,36)</u>
Hotels – 0,00% (31. März 2022: (0,00)%)				
Industrie – (2,99)% (31. März 2022: (0,00)%)				
Argan	EUR	2.478	(40)	(0,16)
LondonMetric Property	GBP	127.025	(92)	(0,37)

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT European Real Estate Securities Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – (12,76)% (31. März 2022: (1,60)%) (Fortsetzung)

			Nicht realisierter Verlust in	
	Währung	Nominalbestand	Tsd. GBP	% des NIW
Differenzkontrakte – (12,45)% (31. März 2022: (1,26)%) (Fortsetzung)				
Industrie – (2,99)% (31. März 2022: (0,00)%) (Fortsetzung)				
Segro	GBP	164.604	(516)	(2,07)
Tritax Big Box	GBP	113.823	(96)	(0,39)
			(744)	(2,99)
Immobilienkonzerne – (2,28)% (31. März 2022: 0,00%)				
British Land	GBP	58.606	(95)	(0,38)
Land Securities Group	GBP	211.809	(472)	(1,90)
			(567)	(2,28)
Büros – (2,95)% (31. März 2022: (0,47)%)				
Covivio	EUR	2.538	(18)	(0,07)
Derwent London	GBP	12.005	(122)	(0,49)
Great Portland Estates	GBP	66.833	(21)	(0,08)
Helical	GBP	222.933	(210)	(0,85)
Icade	EUR	15.135	(255)	(1,03)
Workspace Group	GBP	48.538	(106)	(0,43)
			(732)	(2,95)
Wohnimmobilien – (1,00)% (31. März 2022: (0,11)%)				
Phoenix Spree Deutschland	GBP	179.386	(202)	(0,81)
The Prs	GBP	102.139	(6)	(0,03)
Triple Point Social Housing	GBP	160.360	(34)	(0,14)
Wallenstam	SEK	51.145	(6)	(0,02)
			(248)	(1,00)
Einzelhandel – (0,73)% (31. März 2022: (0,12)%)				
Capital and Counties	GBP	354.528	(170)	(0,68)
Hammerson	GBP	11.696	-*	-
NewRiver	GBP	84.530	(4)	(0,02)
Supermarket Income	GBP	89.133	(8)	(0,03)
			(182)	(0,73)
Mietlager – (0,92)% (31. März 2022: (0,29)%)				
Big Yellow	GBP	3.336	(3)	(0,01)
Safestore Holdings	GBP	87.160	(226)	(0,91)
			(229)	(0,92)
Einkaufszentren – (0,30)% (31. März 2022: (0,17)%)				
Mercialys	EUR	32.193	(52)	(0,21)
Unibail-Rodamco-Westfield	EUR	1.734	(23)	(0,09)
			(75)	(0,30)
Studentenwohnheime – (0,59)% (31. März 2022: 0,00%)				
UNITE Group	GBP	56.325	(144)	(0,58)
Xior Student Housing	EUR	1.988	(2)	(0,01)
			(146)	(0,59)
Transportwesen – (0,12)% (31. März 2022: 0,00%)				
Urban Logistics	GBP	85.193	(31)	(0,12)
			(31)	(0,12)
Total Differenzkontrakte – (12,45)% (31. März 2022: (1,26)%)			(3,096)	(12,45)

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT European Real Estate Securities Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – (12,76)% (31. März 2022: (1,60)%) (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – (0,31)% (31. März 2022: (0,34)%)

Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Verlust in Tsd. GBP	% des NIW
Anlageebene – (0,07)% (31. März 2022: (0,32)%)						
GBP	223.857	EUR	249.000	27.10.2022	(5)	(0,02)
EUR	216.000	GBP	187.485	27.10.2022	(3)	(0,01)
GBP	191.678	SEK	2.342.000	27.10.2022	(3)	(0,01)
EUR	215.000	GBP	186.650	27.10.2022	(2)	(0,01)
GBP	250.176	SEK	3.071.000	27.10.2022	(2)	(0,01)
EUR	142.000	GBP	123.529	27.10.2022	(1)	(0,01)
CHF	171.000	GBP	155.727	27.10.2022	-*	-
					(16)	(0,07)
Klassenebene – (0,24)% (31. März 2022: (0,02)%)						
GBP	1.635.990	EUR	1.822.621	31.10.2022	(34)	(0,14)
GBP	641.365	EUR	714.531	31.10.2022	(14)	(0,06)
GBP	203.720	NOK	2.365.235	31.10.2022	(9)	(0,03)
GBP	78.523	EUR	87.465	31.10.2022	(2)	(0,01)
GBP	31.161	EUR	34.709	31.10.2022	(1)	-
GBP	49	EUR	55	31.10.2022	-*	-
GBP	2.368	EUR	2.639	31.10.2022	-*	-
					(60)	(0,24)
Total Offene Devisenterminkontrakte – (0,31)% (31. März 2022: (0,34)%)					(76)	(0,31)
Total Finanzderivate – (12,76)% (31. März 2022: (1,60)%)					(3,172)	(12,76)

	Fair Value in Tsd. GBP	% des NIW
Total erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte Anlagen – 56,26% (31. März 2022: 69,86%)	13.984	56,26
Bankguthaben – 19,08% (31. März 2022: 22,25%)	4.743	19,08
Barsicherheiten – 23,80% (31. März 2022: 7,61%)	5.915	23,80
Kontokorrentkredit – (0,01)% (31. März 2022: 0,00%)	(2)	(0,01)
Sonstige Nettovermögenswerte – 0,87% (31. März 2022: 0,28%)	217	0,87
Gesamtnettovermögen	24.857	100,00

Aufschlüsselung des Gesamtvermögens

	in % des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	59,97
OTC-Derivate	0,13
Sonstige Vermögenswerte	39,90
	100,00

Die Gegenparteien der vom Teilfonds gehaltenen OTC-Derivate am 30. September 2022 waren:

Forwards: Bank of Montreal, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citibank, JPMorgan Chase, Royal Bank of Canada, State Street Bank and Trust

Differenzkontrakte: Goldman Sachs

(1) Das Wertpapier wird von Goldman Sachs teilweise als Sicherheit gehalten (GBP 1.560 Mio).

* Werte geringer als GBP 500

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

Wertpapiere – 32,95% (31. März 2022: 33,37%)

Anleihen – 8,28% (31. März 2022: 3,66%)

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Frankreich – 8,28% (31. März 2022: 3,66%)				
Französischer Schatzwechsel 0,000% 19.10.2022	EUR	20.000.000	19.998	4,14
Französischer Schatzwechsel 0,000% 16.11.2022	EUR	20.000.000	19.988	4,14
			39.986	8,28
Total Anleihen – 8,28% (31. März 2022: 3,66%)			39.986	8,28

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Aktien – 24,67% (31. März 2022: 29,71%)				
Wohnungen – 0,82% (31. März 2022: 0,46%)				
Equity Residential	USD	28.700	1.969	0,41
UDR	USD	46.700	1.989	0,41
			3.958	0,82
Rechenzentren – 0,18% (31. März 2022: 0,10%)				
Digital Realty Trust	USD	8.600	871	0,18
			871	0,18
Diversifizierte Immobilienkonzerne – 6,57% (31. März 2022: 9,80%)				
Atrium Ljungberg	SEK	149.708	1.893	0,39
Castellum	SEK	862.453	9.928	2,05
Inmobiliaria Colonial Socimi	EUR	691.142	3.412	0,71
NSI	EUR	678.854	16.496	3,42
			31.729	6,57
Diversifizierte Finanzdienstleister – 1,59% (31. März 2022: 0,00%)				
Agree Realty	USD	16.300	1.124	0,23
Alexandria Real Estate Equities	USD	6.700	959	0,20
Boston Properties	USD	14.400	1.102	0,23
Brixmor Property Group	USD	55.600	1.048	0,22
Healthpeak Properties	USD	38.900	910	0,19
Host Hotels & Resorts	USD	55.000	892	0,18
Piedmont Office Realty Trust	USD	71.000	765	0,16
Welltower	USD	13.400	880	0,18
			7.680	1,59
Gesundheit – 2,07% (31. März 2022: 1,21%)				
Aedifica	EUR	127.043	10.017	2,07
			10.017	2,07
Hotels – 0,28% (31. März 2022: 0,38%)				
Park Hotels & Resorts	USD	118.200	1.359	0,28
			1.359	0,28
Industrie – 2,57% (31. März 2022: 4,88%)				
Catena	SEK	219.824	6.693	1,39
First Industrial Realty Trust	USD	46.662	2.134	0,44
Rexford Industrial Realty	USD	39.200	2.081	0,43
Tritax Big Box	GBP	977.498	1.513	0,31
			12.421	2,57
Einkaufszentren – 0,00% (31. März 2022: 0,18%)				
Fertighäuser – 0,18% (31. März 2022: 0,08%)				
Sun Communities	USD	6.200	856	0,18
			856	0,18
Büros – 1,10% (31. März 2022: 0,26%)				
Aroundtown	EUR	1.430.418	3.228	0,67
Cousins Properties	USD	42.100	1.004	0,21
Kilroy Realty	USD	24.600	1.057	0,22
			5.289	1,10

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 32,95% (31. März 2022: 33,37%) (Fortsetzung)

Aktien – 24,67% (31. März 2022: 29,71%) (Fortsetzung)	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Immobilien – 0,19% (31. März 2022: 0,00%)				
VICI Properties	USD	29.400	896	0,19
			896	0,19
Wohnimmobilien – 5,80% (31. März 2022: 4,24%)				
Fastighets Balder (Klasse B)	SEK	542.333	2.233	0,46
Fortinova Fastigheter	SEK	1.451.611	2.978	0,62
Home	GBP	383.029	396	0,08
LEG Immobilien	EUR	250.226	15.354	3,18
TAG Immobilien	EUR	855.171	7.025	1,46
			27.986	5,80
Einzelhandel – 0,40% (31. März 2022: 0,66%)				
Retail Opportunity Investments	USD	72.900	1.024	0,21
SITE Centers	USD	81.700	893	0,19
			1.917	0,40
Mietlager – 2,02% (31. März 2022: 2,82%)				
Life Storage	USD	10.500	1.187	0,25
Safestore Holdings	GBP	895.450	8.566	1,77
			9.753	2,02
Einkaufszentren – 0,51% (31. März 2022: 0,45%)				
Carmila	EUR	180.191	2.479	0,51
			2.479	0,51
Studentenwohnheime – Null (31. März 2022: 0,58%)				
Supermärkte – 0,00% (31. März 2022: 2,82%)				
Sendemasten – 0,16% (31. März 2022: 0,20%)				
Crown Castle	USD	5.300	782	0,16
			782	0,16
Triple Net – 0,23% (31. März 2022: 0,59%)				
Realty Income	USD	18.500	1.099	0,23
			1.099	0,23
Total Aktien – 24,67% (31. März 2022: 29,71%)			119.092	24,67
Total Wertpapiere – 32,95% (31. März 2022: 33,37%)			159.078	32,95
Finanzderivate – 4,97% (31. März 2022: 1,68%)				
			Nicht realisierter Gewinn in Tsd. EUR	% des NIW
Differenzkontrakte – 4,57% (31. März 2022: 1,49%)				
Wohnungen – 0,07% (31. März 2022: 0,00%)				
Essex Property Trust	USD	7.900	339	0,07
			339	0,07
Rechenzentren – 0,05% (31. März 2022: 0,02%)				
Equinix	USD	1.600	228	0,05
			228	0,05
Diversifizierte Immobilienkonzerne – 0,82% (31. März 2022: 0,00%)				
Allreal Holding	CHF	46.809	29	0,01
Corem Property Group	SEK	1.136.610	53	0,01
Empire State Realty Trust	USD	93.323	99	0,02
LXI	GBP	5.348.064	1.261	0,26
Mobimo Holding	CHF	21.008	913	0,19
NP3 Fastigheter	SEK	189.628	24	-
Nyfosa	SEK	689.759	336	0,07
Peach Property Group	CHF	188.688	1.214	0,25

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – 4,97% (31. März 2022: 1,68%) (Fortsetzung)

	Währung	Nominal- bestand	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. EUR	% des NIW
Differenzkontrakte – 4,57% (31. März 2022: 1,49%) (Fortsetzung)				
Diversifizierte Immobilienkonzerne – 0,82% (31. März 2022: 0,12%) (Fortsetzung)				
PSP Swiss Property	CHF	79.311	12	-
Wihlborgs Fastigheter	SEK	1.097.663	25	0,01
			<hr/>	
			3.966	0,82
Gaming – 0,02% (31. März 2022: 0,00%)				
Gaming & Leisure Properties	USD	19.600	108	0,02
			<hr/>	
			108	0,02
Gesundheit – 0,53% (31. März 2022: 0,00%)				
Assura	GBP	11.227.712	1.444	0,30
Care Property Invest	EUR	29.745	175	0,04
Healthcare Realty Trust	USD	41.200	150	0,03
Medical Properties Trust	USD	70.900	270	0,06
Target Healthcare	GBP	2.399.229	506	0,10
			<hr/>	
			2.545	0,53
Hotels – 0,18% (31. März 2022: 0,01%)				
Diamondrock Hospitality	USD	78.500	90	0,02
Pebblebrook Hotel Trust	USD	84.700	783	0,16
			<hr/>	
			873	0,18
Industrie – 0,79% (31. März 2022: 0,10%)				
Aberdeen Standard European	GBP	1.463.107	434	0,09
Sagax	SEK	229.019	837	0,17
Segro	GBP	787.637	142	0,03
Stag Industrial	USD	77.600	849	0,18
Tritax EuroBox	GBP	2.989.475	1.321	0,27
VGP	EUR	29.790	223	0,05
			<hr/>	
			3.806	0,79
Immobilienkonzerne – 0,00% (31. März 2022: 0,03%)				
British Land	GBP	2.242.425	15	-
			<hr/>	
			15	-
Fertighäuser – 0,03% (31. März 2022: 0,00%)				
Equity LifeStyle Properties	USD	13.500	143	0,03
			<hr/>	
			143	0,03
Büros – 0,46% (31. März 2022: 0,67%)				
Derwent London	GBP	104.124	469	0,10
Douglas Emmett	USD	72.700	612	0,13
Great Portland Estates	GBP	564.022	59	0,01
JBG Smith Properties	USD	67.500	514	0,11
SI Green Realty	USD	32.289	552	0,11
			<hr/>	
			2.206	0,46
Immobilien – 0,33% (31. März 2022: 0,00%)				
Dic Asset	EUR	272.834	689	0,14
Montea C.V.A	EUR	34.969	823	0,17
Washington Real Estate Investment	USD	16.300	65	0,02
			<hr/>	
			1.577	0,33
Wohnimmobilien – 0,26% (31. März 2022: 0,18%)				
Civitas Social Housing	GBP	1.259.781	393	0,08
Grainger	GBP	2.766.203	592	0,12
Irish Residential Properties	EUR	1.858.734	268	0,06
			<hr/>	
			1.253	0,26
Einzelhandel – 0,51% (31. März 2022: 0,09%)				
Eastgroup Properties	USD	14.000	635	0,13
Hammerson	GBP	14.769.438	126	0,03

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – 4,97% (31. März 2022: 1,68%) (Fortsetzung)

	Währung	Nominal- bestand	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. EUR	% des NIW		
Differenzkontrakte – 4,57% (31. März 2022: 1,49%) (Fortsetzung)						
Einzelhandel – 0,51% (31. März 2022: 0,09%) (Fortsetzung)						
Kimco Realty	USD	55.700	317	0,07		
Shaftesbury	GBP	1.575.368	930	0,19		
Supermarket Income	GBP	394.998	63	0,01		
Urban Edge Properties	USD	76.300	371	0,08		
			<u>2.442</u>	<u>0,51</u>		
Mietlager – 0,00% (31. März 2022: 0,15%)						
Einkaufszentren – 0,31% (31. März 2022: 0,09%)						
Cibus Nordic	SEK	171.307	653	0,13		
Citycon	EUR	597.488	42	0,01		
Eurocommercial Properties	EUR	60.102	100	0,02		
Immobiliare Grande Distribuzione	EUR	322.090	525	0,11		
Philips Edison & Company	USD	39.200	202	0,04		
			<u>1.522</u>	<u>0,31</u>		
Studentenwohnheime – 0,06% (31. März 2022: 0,03%)						
Xior Student Housing	EUR	131.963	272	0,06		
			<u>272</u>	<u>0,06</u>		
Sendemasten – 0,04% (31. März 2022: 0,00%)						
American Tower	USD	4.300	126	0,03		
CubeSmart	USD	28.200	65	0,01		
			<u>191</u>	<u>0,04</u>		
Triple Net – 0,11% (31. März 2022: 0,00%)						
Camden Property Trust	USD	14.100	260	0,05		
National Retail Properties	USD	26.100	96	0,02		
Spirit Realty Capital	USD	27.000	198	0,04		
			<u>554</u>	<u>0,11</u>		
Total Differenzkontrakte – 4,57% (31. März 2022: 1,49%)			22.040	4,57		
Offene Devisenterminkontrakte – 0,40% (31. März 2022: 0,19%)						
Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Gewinn in Tsd. EUR	% des NIW
Anlageebene – 0,22% (31. März 2022: 0,18%)						
SEK	378.955.000	EUR	35.465.824	27.10.2022	628	0,13
GBP	18.262.000	EUR	21.035.802	27.10.2022	249	0,05
EUR	11.420.725	GBP	10.183.000	27.10.2022	170	0,04
SEK	9.412.000	EUR	883.834	27.10.2022	19	-
EUR	8.723.622	SEK	94.970.000	27.10.2022	7	-
CHF	2.513.000	EUR	2.607.672	27.10.2022	-*	-
					<u>1.073</u>	<u>0,22</u>
Klassenebene – 0,18% (31. März 2022: 0,01%)						
EUR	39.907.098	GBP	35.820.731	31.10.2022	858	0,18
EUR	8.428.579	SEK	91.898.423	31.10.2022	19	-
					<u>877</u>	<u>0,18</u>
Total Offene Devisenterminkontrakte – 0,40% (31. März 2022: 0,19%)					1.950	0,40
Total Finanzderivate – 4,97% (31. März 2022: 1,68%)					23.990	4,97

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – (6,17)% (31. März 2022: (2,47)%)

	Währung	Nominal bestand	Nicht realisierter Verlust in Tsd. EUR	% des NIW
Differenzkontrakte – (6,01)% (31. März 2022: (1,93)%)				
Wohnungen – 0,00% (31. März 2022: (0,07)%)				
Diversifizierte Immobilienkonzerne – (0,07)% (31. März 2022: (0,10)%)				
Picton Property Income (REIT)	GBP	1.816.780	(318)	(0,07)
			(318)	(0,07)
Gesundheit – (0,21)% (31. März 2022: (0,11)%)				
Cofinimmo	EUR	122.495	(98)	(0,02)
Primary Health Properties	GBP	2.568.305	(898)	(0,19)
			(996)	(0,21)
Hotels – 0,00% (31. März 2022: (0,07)%)				
Industrie – (1,94)% (31. März 2022: (0,52)%)				
Argan	EUR	125.756	(3,291)	(0,68)
LondonMetric Property	GBP	2.347.248	(2,093)	(0,43)
Tritax Big Box	GBP	3.877.210	(3,947)	(0,82)
Warehouses De Pauw	EUR	335.498	(47)	(0,01)
			(9,378)	(1,94)
Immobilienkonzerne – (0,77)% (31. März 2022: (0,03)%)				
Land Securities Group	GBP	1.531.477	(3.744)	(0,77)
			(3.744)	(0,77)
Einkaufszentren – 0,00% (31. März 2022: (0,01)%)				
Büros – (1,25)% (31. März 2022: (0,13)%)				
Covivio	EUR	109.821	(156)	(0,03)
Helical	GBP	3.346.644	(1,320)	(0,27)
Hufvudstaden	SEK	721.693	(200)	(0,04)
Icade	EUR	305.656	(3.378)	(0,70)
Workspace Group	GBP	398.229	(1.008)	(0,21)
			(6.062)	(1,25)
Wohnimmobilien – (0,66)% (31. März 2022: (0,01)%)				
Kojamo	EUR	844.133	(583)	(0,12)
Phoenix Spree Deutschland	GBP	2.025.996	(1,882)	(0,39)
Triple Point Social Housing	GBP	1.353.997	(324)	(0,07)
Vonovia	EUR	559.234	(117)	(0,02)
Wallenstam	SEK	1.995.259	(272)	(0,06)
			(3.178)	(0,66)
Einzelhandel – (0,47)% (31. März 2022: (0,05)%)				
Capital and Counties	GBP	3.822.332	(2.260)	(0,47)
			(2.260)	(0,47)
Mietlager – (0,16)% (31. März 2022: (0,59)%)				
Big Yellow	GBP	728.804	(16)	-
Safestore Holdings	GBP	48.275	(277)	(0,06)
Shurgard Self Storage	EUR	216.503	(487)	(0,10)
			(780)	(0,16)
Einkaufszentren – (0,48)% (31. März 2022: (0,21)%)				
Klepierre	EUR	146.272	(549)	(0,12)
Mercialys	EUR	360.096	(496)	(0,10)
Unibail-Rodamco-Westfield	EUR	73.600	(916)	(0,19)
Wereldhave	EUR	136.464	(345)	(0,07)
			(2.306)	(0,48)
Sendemasten – 0,00% (31. März 2022: (0,01)%)				
Triple Net – 0,00% (31. März 2022: (0,02)%)				
Total Differenzkontrakte – (6,01)% (31. März 2022: (1,93)%)			(29.022)	(6,01)

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – (6,17)% (31. März 2022: (2,47)% (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – (0,16)% (31. März 2022: (0,54)%)

Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Verlust in Tsd. EUR	% des NIW
Anlageebene – (0,13)% (31. März 2022: (0,53)%)						
USD	35.112.000	EUR	35.389.136	27.10.2022	(396)	(0,08)
EUR	7.628.232	GBP	6.621.000	27.10.2022	(92)	(0,02)
CHF	4.250.000	EUR	4.361.316	27.10.2022	(48)	(0,01)
USD	1.924.000	EUR	1.918.256	27.10.2022	(42)	(0,01)
EUR	4.254.613	CHF	4.062.000	27.10.2022	(40)	(0,01)
EUR	1.661.502	GBP	1.458.000	27.10.2022	(2)	-
					(620)	(0,13)
Klassenebene – (0,03)% (31. März 2022: (0,01)%)						
EUR	5.942.669	USD	5.735.526	31.10.2022	(99)	(0,02)
GBP	1.417.824	EUR	1.579.284	31.10.2022	(34)	(0,01)
EUR	251.097	USD	242.299	31.10.2022	(4)	-
SEK	1.681.421	EUR	154.190	31.10.2022	(1)	-
SEK	20.163	EUR	1.849	31.10.2022	-*	-
					(138)	(0,03)
Total Offene Devisenterminkontrakte – (0,16)% (31. März 2022: (0,54)%)					(758)	(0,16)
Total Finanzderivate – (6,17)% (31. März 2022: (2,47)%)					(29.780)	(6,17)
					Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Total erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte Anlagen – 31,75% (31. März 2022: 32,58%)					153.288	31,75
Bankguthaben – 54,01% (31. März 2022: 55,61%)					260.794	54,01
Barsicherheiten – 14,81% (31. März 2022: 13,15%)					71.491	14,81
Sonstige Nettverbindlichkeiten – (0,57)% (31. März 2022: (1,34)%)					(2.717)	(0,57)
Gesamtnettvermögen					482.856	100,00

Aufschlüsselung des Gesamtvermögens	in % des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	32,16
OTC-Derivate	0,39
Sonstige Vermögenswerte	67,45
	100,00

Die Gegenparteien der vom Teilfonds gehaltenen OTC-Derivate am 30. September 2022 waren:

Forwards: Bank of Montreal, BNP Paribas, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citibank, ING Bank, JPMorgan Chase, State Street Bank and Trust

Differenzkontrakte: Goldman Sachs

* Werte geringer als EUR 500

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund

Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%)

Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%)

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Baumaterialien – 4,96% (31. März 2022: 5,55%)				
Eagle Materials	USD	2.358	258	0,08
International Flavors & Fragrances	USD	28.715	2.662	0,88
Koninklijke DSM	EUR	12.832	1.507	0,50
Linde	USD	18.597	5.118	1,69
Lundin Mining	CAD	44.942	233	0,08
Rio Tinto	AUD	12.074	740	0,24
Rio Tinto	GBP	42.184	2.353	0,78
SIG Combibloc Services	CHF	18.788	393	0,13
Smurfit Kappa Group	EUR	49.933	1.465	0,48
Wheaton Precious Metals	USD	9.317	308	0,10
			15.037	4,96
Kommunikationsdienste – 0,39% (31. März 2022: 0,00%)				
Meta Platforms (Klasse A)	USD	8.404	1.164	0,39
			1.164	0,39
Nicht-Basiskonsumgüter – 9,25% (31. März 2022: 8,29%)				
Advance Auto Parts	USD	5.185	827	0,27
Allegro.eu	PLN	27.446	122	0,04
Amazon.com	USD	22.728	2.622	0,86
ANTA Sports Products	HKD	22.600	245	0,08
Aptiv	USD	24.548	1.960	0,65
Best Buy	USD	10.876	703	0,23
Boot Barn Holdings	USD	1.910	114	0,04
Cie Generale des Etablissements Michelin	EUR	38.093	882	0,29
Columbia Sportswear	USD	2.266	156	0,05
Darden Restaurants	USD	16.808	2.167	0,71
Dollar General	USD	4.314	1.056	0,35
eBay	USD	23.182	871	0,29
Global Fashion Group	EUR	581	1	-
Haier Smart Home (Klasse H)	HKD	125.000	391	0,13
Home Depot	USD	3.941	1.110	0,37
Honda Motor	JPY	69.500	1.538	0,51
Industria de Diseno Textil	EUR	59.184	1.259	0,42
Lennar (Klasse A)	USD	19.243	1.464	0,48
LKQ	USD	23.635	1.138	0,38
Magna International	CAD	25.309	1.232	0,41
MDC Holdings	USD	4.931	138	0,05
Meituan	HKD	12.800	276	0,09
MercadoLibre	USD	300	253	0,08
Mercedes-Benz Group	EUR	35.219	1.844	0,61
Mohawk Industries	USD	6.218	579	0,19
PulteGroup	USD	27.416	1.049	0,35
Sekisui House	JPY	63.400	1.074	0,35
Shimano	JPY	9.100	1.459	0,48
Tesla	USD	5.541	1.500	0,49
			28.030	9,25
Basiskonsumgüter – 5,57% (31. März 2022: 5,46%)				
Anthem	USD	1.925	893	0,30
By-health (Klasse A)	CNY	158.400	401	0,13
Colgate-Palmolive India	INR	15.747	322	0,11
Enhabit Home Health & Hospice	USD	2.069	30	0,01
Fomento Economico Mexicano	MXN	33.360	214	0,07
Glanbia	EUR	17.000	200	0,07
GSK	GBP	97.981	1.458	0,48
HelloFresh	EUR	4.312	94	0,03
Hologic	USD	12.540	826	0,27
Inner Mongolia Yili Industrial Group (Klasse A)	CNY	115.889	550	0,18
Jeronimo Martins SGPS	EUR	23.674	451	0,15

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)

Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Basiskonsumgüter – 5,57% (31. März 2022: 5,46%)				
Kerry Group (Class A)	EUR	26.015	2.373	0,78
Kimberly-Clark	USD	14.322	1.645	0,54
Koninklijke Ahold Delhaize	EUR	34.885	912	0,30
Loblaw	CAD	18.446	1.499	0,50
Marico	INR	79.909	538	0,18
MARR	EUR	16.040	155	0,05
Nestle India	INR	1.889	453	0,15
Nomad Foods	USD	10.382	150	0,05
Origin Enterprises	EUR	61.048	221	0,07
Raia Drogasil	BRL	71.200	305	0,10
Walmart	USD	13.974	1.850	0,61
Walmart de Mexico	MXN	302.355	1.086	0,36
Wuxi Biologics Cayman	HKD	39.500	243	0,08
			16.869	5,57
Diversifizierte Finanzdienstleister – 17,75% (31. März 2022: 16,22%)				
Aflac	USD	49.032	2.813	0,93
AIA Group	HKD	103.600	882	0,29
Alleghany	USD	617	529	0,17
Allstate	USD	21.734	2.763	0,91
Aviva	GBP	163.286	722	0,24
Bank Central Asia	IDR	1.800.900	1.032	0,34
Bank of China (Klasse H)	HKD	4.679.000	1.564	0,52
Berkshire Hathaway (Klasse B)	USD	16.889	4.603	1,52
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD	30.802	1.383	0,46
CBRE	USD	26.964	1.858	0,61
China Construction Bank (Klasse H)	HKD	3.563.783	2.104	0,69
Discovery	ZAR	29.780	177	0,06
Focus Financial Partners	USD	7.232	233	0,08
HDFC Bank	USD	65.731	3.920	1,29
HDFC Bank	INR	59.038	1.053	0,35
Hong Kong Exchanges & Clearing	HKD	22.500	789	0,26
Intercontinental Exchange	USD	35.719	3.294	1,09
Investor (Klasse B)	SEK	126.707	1.906	0,63
MetLife	USD	57.527	3.569	1,18
Mitsubishi HC Capital	JPY	49.300	216	0,07
Morgan Stanley	USD	46.162	3.723	1,23
Moscow Exchange MICEX-RTS	RUB	474.420	-*	-
National Australia Bank	AUD	50.350	952	0,31
Ping An Insurance Group Co of China	HKD	72.500	370	0,12
PRA Group	USD	9.823	329	0,11
Prudential	GBP	185.840	1.893	0,62
Ringkjøbing Landbobank	DKK	5.793	629	0,21
Storebrand	NOK	43.386	307	0,10
SVB Financial Group	USD	6.525	2.236	0,74
T Rowe Price Group	USD	8.208	880	0,29
Tikehau Capital	EUR	12.958	322	0,11
Toronto-Dominion Bank	CAD	53.857	3.390	1,12
UBS Group	CHF	147.813	2.219	0,73
Weyerhaeuser	USD	39.024	1.138	0,37
			53.798	17,75
Energie – 1,72% (31. März 2022: 0,95%)				
ConocoPhillips	USD	14.449	1.510	0,50
Kosmos Energy	USD	26.500	140	0,05
Petroleo Brasileiro	BRL	239.915	1.349	0,44
Petroleo Brasileiro	USD	81.684	1.029	0,34
Reliance Industries	INR	26.443	788	0,26

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)

Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Energie – 1,72% (31. März 2022: 0,95%) (Fortsetzung)				
SEPLAT Energy	NGN	142.733	169	0,06
World Fuel Services	USD	9.307	223	0,07
			<u>5.208</u>	<u>1,72</u>
Gesundheit – 16,05% (31. März 2022: 16,49%)				
Abbott Laboratories	USD	13.012	1.285	0,42
AbbVie	USD	8.613	1.180	0,39
Amgen	USD	11.471	2.639	0,87
AstraZeneca	GBP	25.689	2.911	0,96
Biocon	INR	73.867	269	0,09
Bristol-Myers Squibb	USD	41.306	2.998	0,99
Catalent	USD	3.459	256	0,08
CSL	AUD	18.264	3.417	1,13
CVS Health	USD	42.596	4.147	1,37
Encompass Health	USD	4.138	191	0,06
Genus	GBP	3.962	118	0,04
Gilead Sciences	USD	16.142	1.017	0,34
Healthcare Realty Trust	USD	12.479	266	0,09
Hoya	JPY	25.800	2.525	0,83
Hualan Biological Engineering (Klasse A)	CNY	87.585	229	0,08
Humana	USD	8.196	4.059	1,34
IDEXX Laboratories	USD	2.948	980	0,32
Jazz Pharmaceuticals	USD	9.776	1.330	0,44
Johnson & Johnson	USD	13.375	2.230	0,74
Merck	USD	15.334	1.348	0,45
Mettler-Toledo International	USD	2.853	3.157	1,04
Molina Healthcare	USD	1.091	367	0,12
Novo Nordisk (Klasse B)	DKK	28.242	2.892	0,95
Roche Holding	CHF	10.393	3.486	1,15
Syneos Health	USD	3.386	163	0,05
Thermo Fisher Scientific	USD	8.685	4.497	1,48
Torrent Pharmaceuticals	INR	26.393	515	0,17
US Physical Therapy	USD	2.253	175	0,06
			<u>48.647</u>	<u>16,05</u>
Industrie – 10,79% (31. März 2022: 11,32%)				
Acuity Brands	USD	18.480	2.970	0,98
Aena SME	EUR	5.041	539	0,18
AP Moller (Klasse B)	DKK	284	530	0,18
Ashthead Group	GBP	18.914	881	0,29
CITIC	HKD	678.816	653	0,22
Compagnie de Saint-Gobain	EUR	20.555	762	0,25
Deutsche Post	EUR	34.965	1.088	0,36
GrafTech International	USD	37.365	164	0,05
Hayward Holdings	USD	18.103	164	0,05
Melrose Industries	GBP	180.163	210	0,07
Mitsubishi	JPY	71.100	1.990	0,66
MSC Industrial Direct (Klasse A)	USD	2.190	163	0,05
Norma Group	EUR	13.616	188	0,06
Owens Corning	USD	10.114	812	0,27
Roper Technologies	USD	8.047	2.954	0,97
Schneider Electric	EUR	16.902	1.976	0,65
Sumitomo	JPY	85.100	1.082	0,36
Techtronic Industries	HKD	39.000	385	0,13
Transurban Group	AUD	143.321	1.161	0,38
Trimble	USD	31.414	1.740	0,57
Tyman	GBP	74.225	166	0,05
Verisk Analytics	USD	17.536	3.053	1,01
Vestas Wind Systems	DKK	87.068	1.658	0,55

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)

Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Industrie – 10,79% (31. März 2022: 11,32%) (Fortsetzung)				
Vinci	EUR	12.376	1.029	0,34
Wizz Air Holdings	GBP	8.384	151	0,05
Wolters Kluwer	EUR	23.547	2.353	0,78
WSP Global	CAD	3.671	415	0,14
Xylem	USD	38.711	3.452	1,14
			<hr/>	<hr/>
			32.689	10,79
Informationstechnologie – 20,75% (31. März 2022: 21,67%)				
Accenture (Klasse A)	USD	9.330	2.450	0,81
Akamai Technologies	USD	11.119	912	0,30
Amano	JPY	9.000	154	0,05
Apple	USD	38.698	5.459	1,80
Arrow Electronics	USD	13.100	1.233	0,41
Autodesk	USD	17.503	3.338	1,10
Automatic Data Processing	USD	8.993	2.076	0,69
Broadcom	USD	3.429	1.554	0,51
Cadence Design Systems	USD	8.442	1.408	0,46
Cognizant Technology Solutions (Klasse A)	USD	21.046	1.234	0,41
Cognyte Software	USD	14.500	60	0,02
Computacenter	GBP	8.346	184	0,06
Constellation Software	CAD	473	675	0,22
CrowdStrike Holdings	USD	10.860	1.827	0,60
Descartes Systems Group	CAD	39.005	2.542	0,84
EPAM Systems	USD	1.669	617	0,20
F5 Networks	USD	8.324	1.230	0,41
FPT	VND	117.480	405	0,13
Genpact	USD	6.238	279	0,09
Infineon Technologies	EUR	55.791	1.267	0,42
Infosys	INR	53.649	952	0,31
Intel	USD	42.735	1.124	0,37
Keyence	JPY	7.800	2.635	0,87
Mastercard (Klasse A)	USD	12.944	3.757	1,24
MaxLinear	USD	8.545	285	0,09
Motorola Solutions	USD	19.943	4.559	1,50
Murata Manufacturing	JPY	32.600	1.525	0,50
NetApp	USD	53.638	3.386	1,12
Nordic Semiconductor	NOK	11.310	154	0,05
NXP Semiconductors	USD	7.871	1.185	0,39
Palo Alto Networks	USD	6.878	1.150	0,38
PayPal Holdings	USD	26.226	2.304	0,76
Realtek Semiconductor	TWD	72.000	625	0,21
Samsung Electronics (Vorzugsaktie)	KRW	37.576	1.257	0,42
ServiceNow	USD	2.794	1.077	0,36
Shimadzu	JPY	73.300	1.962	0,65
STMicroelectronics	EUR	28.652	924	0,31
Taiwan Semiconductor Manufacturing	TWD	262.000	3.555	1,17
Tata Consultancy Services	INR	14.907	563	0,19
Viavi Solutions	USD	18.003	240	0,08
Western Union	USD	26.723	368	0,12
WEX	USD	1.439	186	0,06
Win Semiconductors	TWD	53.000	210	0,07
			<hr/>	<hr/>
			62.887	20,75
Pharmazeutika – 1,37% (31. März 2022: 0,76%)				
Eli Lilly	USD	12.543	4.140	1,37
			<hr/>	<hr/>
			4.140	1,37
Immobilien – 0,87% (31. März 2022: 2,48%)				
Americold Realty Trust	USD	90.729	2.278	0,75

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund (Fortsetzung)

Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)

	Währung	Nominal- bestand	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%) (Fortsetzung)				
Immobilien – 0,87% (31. März 2022: 2,48%) (Fortsetzung)				
CLS Holdings	GBP	96.562	154	0,05
Sirius Real Estate	GBP	241.162	194	0,07
			2.626	0,87
Software – 1,00% (31. März 2022: 0,62%)				
NortonLifeLock	USD	147.366	3.030	1,00
			3.030	1,00
Technologie – 1,29% (31. März 2022: 0,00%)				
Jack Henry & Associates	USD	3.989	742	0,24
SK Hynix	KRW	19.586	1.161	0,38
Snowflake	USD	6.732	1.168	0,39
ZoomInfo Technologies	USD	19.825	843	0,28
			3.914	1,29
Telekommunikation – 6,06% (31. März 2022: 8,92%)				
Alphabet (Klasse A)	USD	34.080	3.327	1,10
Alphabet (Klasse C)	USD	28.712	2.818	0,93
Deutsche Telekom	EUR	121.479	2.125	0,70
Euromoney Institutional Investor	GBP	19.755	325	0,11
KDDI	JPY	112.600	3.369	1,11
Media & Games Invest	SEK	14.099	22	0,01
NAVER	KRW	4.230	584	0,19
NetEase ADR	HKD	25.700	396	0,13
Next Fifteen Communications Group	GBP	14.829	132	0,04
Nippon Telegraph & Telephone	JPY	73.800	2.033	0,67
Tencent Holdings	HKD	93.359	3.234	1,07
			18.365	6,06
Sendemasten – 1,03% (31. März 2022: 0,00%)				
Crown Castle	USD	21.235	3.133	1,03
			3.133	1,03
Versorger – 0,92% (31. März 2022: 1,13%)				
NRG Energy	USD	28.597	1.117	0,37
Orsted	DKK	18.424	1.505	0,50
Rubis	EUR	7.240	155	0,05
			2.777	0,92
Total Aktien – 99,77% (31. März 2022: 99,86%)			302.314	99,77
Total Wertpapiere – 99,77% (31. März 2022: 99,86%)			302.314	99,77
Finanzderivate – 0,44% (31. März 2022: 0,20%)				
Futures – 0,44% (31. März 2022: 0,20%)				
Deutschland – 0,29% (31. März 2022: 0,08%)				
MSCI World Index Dezember 2022	USD	(84)	576	0,19
Euro Stoxx Futures Dezember 2022	EUR	(96)	301	0,10
			877	0,29
Vereinigtes Königreich – Null (31. März 2022: 0,02%)				
Vereinigte Staaten – 0,15% (31. März 2022: 0,10%)				
E-mini Russell 1000 Index Dezember 2022	USD	(30)	465	0,15
			465	0,15
Total Futures – 0,44% (31. März 2022: 0,20%)			1.342	0,44
Total Finanzderivate – 0,44% (31. März 2022: 0,20%)			1.342	0,44

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER ANLAGENBESTAND am 30. September 2022 (Fortsetzung)

CT Multi-Strategy Global Equity Fund (Fortsetzung)

Finanzderivate – (0,38)% (31. März 2022: (0,25)%)

	Währung	Anzahl Kontrakte	Nicht realisierter Verlust in Tsd. EUR	% des NIW
Futures – (0,38)% (31. März 2022: (0,25)%)				
Australien – 0,00% (31. März 2022: (0,03)%)				
Deutschland – 0,00% (31. März 2022: (0,02)%)				
Hongkong – 0,00% (1. März 2022: (0,03)%)				
Singapur – 0,00% (31. März 2022: (0,00)%)				
Vereinigtes Königreich – (0,08)% (31. März 2022: 0,00%)				
FTSE Index Futures Dezember 2022	GBP	39	(248)	(0,08)
			(248)	(0,08)
Vereinigte Staaten – (0,30)% (31. März 2022: (0,17)%)				
S&P500 E-mini Futures Dezember 2022	USD	18	(445)	(0,15)
E-mini Russell 1000 Index Dezember 2022	USD	49	(445)	(0,15)
			(890)	(0,30)
Total Futures – (0,38)% (31. März 2022: (0,25)%)			(1.138)	(0,38)
Total Finanzderivate – (0,38)% (31. März 2022: (0,25)%)			(1.138)	(0,38)

	Fair Value in Tsd. EUR	% des NIW
Total erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte Anlagen – 99,83% (31. März 2022: 99,81%)	302.518	99,83
Bankguthaben – 0,83% (31. März 2022: 0,42%)	2.512	0,83
Guthaben auf Margin-Konten – 0,28% (31. März 2022: 0,33%)	854	0,28
Kontokorrentkredit – (0,39)% (31. März 2022: (0,11)%)	(1.173)	(0,39)
Sonstige Nettverbindlichkeiten – (0,55)% (31. März 2022: (0,45)%)	(1.687)	(0,55)
Gesamtnettvermögen	303.024	100,00

Aufschlüsselung des Gesamtvermögens

	in % des Gesamtvermögens
Zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassene Wertpapiere	95,62
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,42
Sonstige Vermögenswerte	3,96
	100,00

* Der Marktwert wurde auf null heruntergeschrieben, nachdem der Handel eingestellt worden war.

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER NETTOVERMÖGENSAUSWEIS

zum 30. September 2022

	Erl.	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Aktienfonds in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund* in Tsd. EUR	Gesellschaft insgesamt** in Tsd. EUR
Kurzfristige Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte finanzielle Vermögenswerte:	11					
Wertpapiere		16.726	159.078	302.314	-	480.451
Derivative Finanzinstrumente		430	23.990	1.342	-	25.822
Bankguthaben		4.743	260.794	2.512	73	268.784
Guthaben auf Margin-Konten		-	-	854	-	854
Barsicherheiten	21	5.915	71.491	-	-	78.231
Debitoren		472	1.395	9.139	35	11.107
Kurzfristige Vermögenswerte insgesamt		28.286	516.748	316.161	108	865.249
Kurzfristige Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte finanzielle Verbindlichkeiten:	11					
Derivative Finanzinstrumente		(3.172)	(29.780)	(1.138)	-	(34.532)
Kontokorrentkredit		(2)	-	(1,173)	-	(1,175)
Kreditoren – innerhalb eines Berichtszeitraums fällig werdende Beträge		(255)	(4,112)	(10,826)	(108)	(15,337)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(3,429)	(33,892)	(13,137)	(108)	(51,044)
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnendes Nettovermögen	6,9	24.857	482.856	303.024	-	814.205

* am 6. September 2022 geschlossen

** Die Spalte „Gesellschaft insgesamt“ umfasst keine der in Erläuterung 2 beschriebenen Restbarmittelbestände für geschlossene Teilfonds, da deren Genehmigung noch nicht von der Zentralbank widerrufen wurde.

Der Abschluss wurde am 25. November 2022 vom Verwaltungsrat der Columbia Threadneedle (Irl) III plc genehmigt.

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

NETTOVERMÖGENSAUSWEIS

zum 31. März 2022

	Erl.	BMO High Income Bond Fund* in Tsd. USD	F&C Global Emerging Markets Fund** in Tsd. USD	BMO European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	BMO Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	BMO Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	BMO Enhanced Income Euro Equity Fund in Tsd. EUR	Gesellschaft insgesamt*** in Tsd. EUR
Kurzfristige Vermögenswerte								
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte finanzielle Vermögenswerte:	11							
Wertpapiere		-	-	33.203	182.744	359.557	5.681	587.273
Finanzderivate		-	-	1.151	9.196	739	8	11.305
Bankguthaben		6.177	788	10.698	304.563	1.509	19	325.010
Guthaben auf Margin-Konten		-	-	-	-	1.179	52	1.231
Barsicherheiten	21	-	-	3.658	72.012	-	-	76.341
Debitoren		-	-	1.296	5.444	28.440	60	35.477
Kurzfristige Vermögenswerte insgesamt		6.177	788	50.006	573.959	391.424	5.820	1.036.637
Kurzfristige Verbindlichkeiten								
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzte finanzielle Verbindlichkeiten:	11							
Finanzderivate		-	-	(769)	(13.510)	(922)	(7)	(15.349)
Kontokorrentkredit		-	-	-	-	(406)	-	(406)
Kreditoren – innerhalb eines Geschäftsjahres fällig werdende Beträge		(6.177)	(788)	(1.164)	(12.819)	(30.027)	(56)	(50.539)
Kurzfristige Verbindlichkeiten insgesamt		(6.177)	(788)	(1.933)	(26.329)	(31.355)	(63)	(66.294)
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnendes Nettovermögen	6,9	-	-	48.073	547.630	360.069	5.757	970.343

* am 26. April 2019 geschlossen

** am 26. Oktober 2018 geschlossen

*** Die Spalte „Gesellschaft insgesamt“ umfasst keine Restbarmittelbestände von anderen geschlossenen Teilfonds, die in Erläuterung 2 beschrieben und deren Genehmigung noch nicht von der Zentralbank widerrufen wurde.

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTE GESAMTERFOLGSRECHNUNG

für das Halbjahr zum 30. September 2022

	CT European Real Estate Securities Fund	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	CT Multi-Strategy Global Equity Fund	CT Enhanced Income Euro Equity Fund*	Gesellschaft insgesamt
Erl.	in Tsd. GBP	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Erträge					
Dividendenerträge	988	6.133	5.066	135	12.489
Zinsen auf Bankeinlagen	27	10	22	-	64
Erträge aus	12	-	17	-	17
Nettoverlust aus erfolgswirksamen finanziellen Vermögenswerten und	3	(14.506)	(8.012)	(36.820)	(686)
Gesamtverlust aus Anlagen		(13.491)	(1.869)	(31.715)	(551)
Aufwendungen					
Anlageverwaltungsgebühr	(185)	(3.222)	(428)	(6)	(3.871)
Performancegebühr	-	(1)	-	-	(1)
Verwaltungsgebühr	(16)	(230)	(151)	(2)	(402)
Verwahrstellengebühr	(15)	(64)	(68)	(9)	(158)
Gemeinkosten	4	(49)	(278)	(186)	(48)
Prüfthonorare	(8)	(8)	(23)	(15)	(55)
Verwaltungsrathonorare	13	(7)	(59)	(47)	(1)
Verwaltungsgesellschaftsgebühren	(1)	(16)	(10)	-	(27)
Rückerstattung von Aufwendungen	-	-	-	54	54
Total Betriebsaufwendungen		(281)	(3.878)	(913)	(27)
Nettoverlust vor Finanzierungskosten		(13.772)	(5.747)	(32.628)	(578)
Finanzierungskosten					
Aufwendungen für Bankzinsen	(11)	(998)	(104)	-	(1.115)
Finanzierungskosten für Differenzkontrakte	(106)	(804)	-	-	(928)
Ausschüttung	5	(105)	-	(206)	(329)
Nettoaussgleich	(63)	271	(92)	122	227
Total Finanzierungskosten		(285)	(1.531)	(196)	(84)
Verlust für den Berichtszeitraum		(14.057)	(7.278)	(32.824)	(662)
Quellensteuer	14	(48)	(408)	(730)	(24)
Kapitalertragsteuer	14	-	-	139	-
Betriebsverlust		(14.105)	(7.686)	(33.415)	(686)
Abnahme des Inhabern von rückzahlbaren gewinnberech- tigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit im Berichtszeitraum		(14.105)	(7.686)	(33.415)	(686)

* für den Berichtszeitraum vom 1. April 2022 bis zur Schliessung des Teilfonds am 6. September 2022.

Die Gewinne und Verluste stammen ausschliesslich aus der fortgeführten Geschäftstätigkeit, ausser beim CT Enhanced Income Euro Equity Fund, der am 6. September 2022 geschlossen wurde.

Es lagen keine anderen Gewinne oder Verluste als die in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung ausgewiesenen vor.

Der Abschluss wurde am 25. November 2022 vom Verwaltungsrat der Columbia Threadneedle (Irl) III plc genehmigt.

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTE GESAMTERFOLGSRECHNUNG

für das Halbjahr zum 30. September 2021

	Erl.	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi-Strategy Global Equity Fund Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund in Tsd. EUR	Gesellschaft insgesamt in Tsd. EUR
Erträge						
Dividenertrag		1.072	4.253	3.811	119	9.430
Zinsen auf Bankeinlagen		-	4	18	-	22
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	12	-	-	8	-	8
Nettoertrag aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	3	6.157	11.550	28.482	197	47.390
Total Anlagenertrag		7.229	15.807	32.319	316	56.850
Aufwendungen						
Anlageverwaltungsgebühr		(258)	(2.655)	(507)	(7)	(3.469)
Performancegebühr		(586)	(2.469)	-	-	(3.151)
Verwaltungsgebühr		(24)	(189)	(180)	(4)	(401)
Verwahrstellengebühr		(19)	(93)	(109)	(7)	(231)
Gemeinkosten	4	(66)	(162)	(94)	(26)	(359)
Prüfthonorare		(8)	(9)	(7)	(6)	(31)
Verwaltungsratshonorare	13	(6)	(50)	(49)	(1)	(106)
Total Betriebsaufwendungen		(967)	(5.627)	(946)	(51)	(7.748)
Nettoertrag vor Finanzierungskosten		6.262	10.180	31.373	265	49.102
Finanzierungskosten						
Aufwendungen für Bankzinsen		(9)	(799)	(19)	(1)	(829)
Finanzierungskosten für Differenzkontrakte		(51)	(738)	-	-	(797)
Ausschüttung	5	(99)	-	-	(66)	(181)
Nettoausgleich		3	(498)	(138)	-	(633)
Summe der Finanzierungskosten		(156)	(2.035)	(157)	(67)	(2.440)
Gewinn des Berichtszeitraums		6.106	8.145	31.216	198	46.662
Quellensteuer	14	(70)	(84)	(468)	(13)	(646)
Betriebsgewinn		6.036	8.061	30.748	185	46.016
Zunahme des Inhabers von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		6.036	8.061	30.748	185	46.016

Die Gewinne und Verluste stammen ausschliesslich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Es lagen keine anderen Gewinne oder Verluste als die in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung ausgewiesenen vor.

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

**UNGEPRÜFTER AUSWEIS DER VERÄNDERUNG DES INHABERN VON RÜCKZAHLBAREN
GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS**

für das Halbjahr zum 30. September 2022

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund* in Tsd. EUR	Gesellschaft insgesamt in Tsd. EUR
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	48.073	547.630	360.069	5.757	970.343
Nominelle Wechselkursbereinigung	-	-	-	-	(1.415)
Abnahme des Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(14.105)	(7.686)	(33.415)	(686)	(58.280)
Anteilstransaktionen					
Erlös aus der Ausgabe von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.060	30.093	-	164	31.497
Kosten für die Rücknahme von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen	(10.171)	(87.181)	(23.630)	(5.235)	(127.940)
Abnahme des Nettovermögens	(9.111)	(57.088)	(23.630)	(5.071)	(96.443)
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums	24.857	482.856	303.024	-	814.205

* für den Berichtszeitraum vom 1. April 2022 bis zur Schliessung des Teilfonds am 6. September 2022

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

UNGEPRÜFTER AUSWEIS DER VERÄNDERUNG DES INHABERN VON RÜCKZAHLBAREN
GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDEN NETTOVERMÖGENS

für das Halbjahr zum 30. September 2021

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund in Tsd. EUR	Gesellschaft insgesamt in Tsd. EUR
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzuordnendes Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	43.222	365.388	396.438	6.721	819.286
Nominelle Wechselkursbereinigung	-	-	-	-	(453)
Zunahme des Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	6.036	8.061	30.748	185	46.016
Anteilstransaktionen					
Erlös aus der Ausgabe von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen	4.021	157.603	4.346	54	166.680
Kosten für die Rücknahme von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen	(4.757)	(48.440)	(34.996)	-	(88.969)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens	(736)	109.163	(30.650)	54	77.711
Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnendes Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums	48.522	482.612	396.536	6.960	942.560

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS

für das Halbjahr zum 30. September 2022

1. Allgemeines

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (bis zum 4. Juli 2022 BMO Investments III (Ireland) plc) (die „Gesellschaft“) wurde am 25. Februar 1999 nach dem Recht der Republik Irland als offene Investmentgesellschaft mit veränderlichem Kapital gegründet. Die Gesellschaft ist ein Umbrella-Fonds und wurde von der irischen Zentralbank (die „Zentralbank“) gemäss der irischen Durchführungsverordnung *European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011* (in ihrer jeweils gültigen Fassung) und den *Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019* (zusammen die „OGAW-Verordnungen“) als Investmentgesellschaft zugelassen. Am Abschlussdatum hatte die Gesellschaft drei aktive Teilfonds (die „Teilfonds“) mit voneinander getrennter Haftung.

2. Grundlagen der Aufstellung

Dieser kurzgefasste, ungeprüfte Abschluss wurde für den Berichtszeitraum zum 30. September 2022 erstellt.

Entsprechenserklärung

Dieser verkürzte Abschluss wurde gemäss Finanzberichterstattungsstandard 104 „Zwischenberichterstattung“ („FRS 104“) und den OGAW-Verordnungen erstellt.

Dieser verkürzte Abschluss wurde auf der gleichen Grundlage erstellt wie der geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft für das Berichtsjahr zum 31. März 2022, mit Ausnahme der Abschlüsse des BMO High Income Bond Fund und des F&C Global Emerging Markets Fund, und sollte im Zusammenhang mit diesem gelesen werden. Diese Teilfonds wurden in vorhergehenden Geschäftsjahren geschlossen und sind im vorliegenden verkürzten Abschluss in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Der CT Enhanced Income Euro Equity Fund wurde am 6. September 2022 geschlossen.

Im zweiten Quartal 2022 wurde der Verwaltungsrat über die Entscheidung eines bedeutenden Anteilinhabers informiert, seine Beteiligung am CT Multi-Strategy Global Equity Fund zurückzugeben. Der Verwaltungsrat kam infolge der Rücknahme zum Schluss, dass es nicht im besten Interesse der verbleibenden Anteilinhaber wäre, den Teilfonds aktiv weiterzuführen. Auf dieser Grundlage hielt es der Verwaltungsrat für angemessen, den Abschluss des CT Multi-Strategy Global Equity Fund nicht nach dem Prinzip der Unternehmensfortführung zu erstellen und eine Rückstellung für die erwarteten Kosten seiner Liquidation zu machen.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds nach FRS 102 geltenden Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch gemacht.

Der kurzgefasste Abschluss zum 30. September 2022 ist ungeprüft. Der Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers für das am 31. März 2022 abgeschlossene Berichtsjahr wurde mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen. Sofern nichts anderes angegeben ist, beziehen sich alle Verweise auf das Nettovermögen auf das den Inhabern von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen.

Geschlossene Teilfonds

Die in der untenstehenden Tabelle aufgeführten Teilfonds wurden in vorhergehenden Geschäftsjahren geschlossen. Der Tabelle sind die Barmittelbestände der Teilfonds zum 30. September 2022 und zum 31. März 2022 zu entnehmen. Diese Barmittelbestände sind zwar Vermögenswerte der Gesellschaft, doch aufgrund ihres Geldwerts wurden für die betreffenden Teilfonds keine Finanzausweise erstellt und sie werden ausschliesslich in dieser Erläuterung erwähnt. Der Barmittelbestand des Eastern European Fund entstand im Wesentlichen durch nicht ausgezahlte Rücknahmeerlöse an Anteilinhaber, deren Dokumente zur Verhinderung von Geldwäsche noch nicht bei der Gesellschaft eingegangen sind (30. September 2022: USD 171.057 und 31. März 2022: USD 171.057). Die übrigen Barmittelbestände der Teilfonds wurden gehalten, um potenzielle Liquidationskosten zu decken und werden an die verbleibenden Anteilinhaber ausgezahlt, bevor den Fonds die Zulassung der Zentralbank entzogen wird.

Teilfonds	30.09.2022	31.03.2022
BMO High Income Bond Fund	USD 6.112.084	USD 6.176.516
BMO US Real Estate Equity Long/Short Fund	USD 39.898	USD 39.853
Eastern European Fund	USD 216.527	USD 212.601
F&C Global Emerging Markets Fund	USD 736.165	USD 787.930
F&C Emerging Asia Fund	USD 174	USD 202
F&C Global Unconstrained Equities Fund	USD 38.464	USD 42.875
F&C Macro Global Bond Fund (EUR)	EUR 60	EUR 58
F&C Macro Global Bond Fund (GBP)	GBP 1.016	GBP 3.915

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

2. Grundlagen der Aufstellung (Fortsetzung)

Geschlossene Teilfonds (Fortsetzung)

State Street Fund Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsstelle“) ist in ihrer Funktion als Transferstelle der Gesellschaft aktiv darum bemüht, die erforderlichen Unterlagen zur Verhinderung von Geldwäsche von den Anteilhabern einzuholen, damit alle ausstehenden Rücknahmeerlöse ausgezahlt werden können. Die Gesellschaft beabsichtigt, bei der Zentralbank die Aufhebung der Zulassung dieser Teilfonds zu beantragen, sobald ihre Vermögenswerte ausgezahlt sind.

3. Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten für den am 30. September 2022 abgeschlossenen Berichtszeitraum

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund in Tsd. EUR	Total in Tsd. EUR
Nettoertrag aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten					
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen	(2.098)	54.327	262	(215)	51.920
Veränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus Anlagen	(12.462)	(60.233)	(42.351)	(418)	(117.575)
Nettoverlust aus Währungen und Devisenterminkontrakten	54	(2.106)	5.269	(539)	3.173
	(14.506)	(8.012)	(36.820)	(686)	(62.481)

* für den Berichtszeitraum vom 1. April 2022 bis zur Schliessung des Teilfonds am 6. September 2022

Für den am 30. September 2021 abgeschlossenen Berichtszeitraum

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund in Tsd. EUR	Total in Tsd. EUR
Nettoertrag aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten					
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus Anlagen	3.960	(14.810)	74.571	(10)	64.357
Veränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts) aus Anlagen	2.341	27.267	(41.474)	215	(11.269)
Nettoverlust aus Währungen und Devisenterminkontrakten	(144)	(907)	(4.615)	(8)	(5.698)
	6.157	11.550	28.482	197	47.390

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

4. Gemeinkosten

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2022

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund in Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund* in Tsd. EUR	Total in Tsd. EUR
Gemeinkosten					
Registrierungs- und Notierungsgebühren	(15)	(58)	(27)	(6)	(109)
Publikations- und Druckkosten	(2)	(4)	-	(1)	(7)
Deutsche Abgeltungssteuer	(4)	(26)	(16)	(4)	(51)
Rechtshonorare	(1)	(37)	(31)	(11)	(80)
Transferstellengebühren	(17)	(56)	(46)	(2)	(124)
Sonstige Gebühren	(10)	(97)	(66)	(24)	(199)
Gemeinkosten	(49)	(278)	(186)	(48)	(570)

* für den Berichtszeitraum vom 1. April 2022 bis zur Schliessung des Teilfonds am 6. September 2022

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2021

	CT European Real Estate Securities Fund Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund Tsd. EUR	CT Multi- Strategy Global Equity Fund Tsd. EUR	CT Enhanced Income Euro Equity Fund Tsd. EUR	Total Tsd. EUR
Gemeinkosten					
Registrierungs- und Notierungsgebühren	(20)	(43)	(32)	(5)	(103)
Publikations- und Druckkosten	(3)	(9)	(5)	-	(17)
Deutsche Abgeltungssteuer	(25)	(27)	(14)	(8)	(78)
Rechtshonorare	(4)	(24)	(20)	(1)	(50)
Sonstige Gebühren	(14)	(59)	(23)	(12)	(111)
Summe der Gemeinkosten	(66)	(162)	(94)	(26)	(359)

5. Ausschüttungen

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2022 wurden die folgenden Ausschüttungen erklärt und ausgezahlt:

CT European Real Estate Securities FundAusschüttende GBP-
Klasse A

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
26.04.22	29.04.22	0,200	21.133	4.227	01.01.22 bis 31.03.22
				4.227*	
Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
26.04.22	29.04.22	0,230	437.318	100.583	01.01.22 bis 31.03.22
				100.583*	

* Die gesamten Ausschüttungen wurden dem Kapital entnommen.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

5. Ausschüttungen (Fortsetzung)

CT Enhanced Income Euro Equity Fund

Ausschüttende EUR-Klasse A

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil EUR	Anzahl Anteile	Betrag in EUR	Massgeblicher Zeitraum
22.04.22	29.04.22	0,096	105	10	01.01.22 bis 31.03.22
22.07.22	29.07.22	0,277	106	29	01.04.22 bis 30.06.22
				39	

Ausschüttende GBP-Klasse B

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
22.04.22	29.04.22	0,109	352.187	38.494	01.01.22 bis 31.03.22
22.07.22	29.07.22	0,287	354.882	101.820	01.04.22 bis 30.06.22
				140.314	

Ausschüttende EUR-Klasse D

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil EUR	Anzahl Anteile	Betrag in EUR	Massgeblicher Zeitraum
22.04.22	29.04.22	0,108	124.325	13.402	01.01.22 bis 31.03.22
22.07.22	29.07.22	0,284	95.638	27.132	01.04.22 bis 30.06.22
				40.534	

Ausschüttende EUR-Klasse R

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil EUR	Anzahl Anteile	Betrag in EUR	Massgeblicher Zeitraum
22.04.22	29.04.22	0,107	106	11	01.01.22 bis 31.03.22
22.07.22	29.07.22	0,282	107	30	01.04.22 bis 30.06.22
				41	

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2021 wurden die folgenden Ausschüttungen erklärt und ausgezahlt:

CT European Real Estate Securities Fund

Ausschüttende GBP-Klasse A

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
27.04.21	30.04.21	0,170	27.754	4.718	01.01.21 bis 31.03.21
				4.718*	

Ausschüttende GBP-Klasse C

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
27.04.21	30.04.21	0,200	472.233	94.447	01.01.21 bis 31.03.21
				94.447*	

* Die gesamte Ausschüttung wurde dem Kapital entnommen.

CT Enhanced Income Euro Equity Fund

Ausschüttende EUR-Klasse A

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil EUR	Anzahl Anteile	Betrag in EUR	Massgeblicher Zeitraum
23.07.21	30.07.21	0,106	100	11	01.01.21 bis 30.06.21
				11	

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

5. Ausschüttungen (Fortsetzung)

CT Enhanced Income Euro Equity Fund (Fortsetzung)

Ausschüttende GBP-Klasse B

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
23.07.21	30.07.21	0,104	99.231	10.343	01.01.21 bis 30.06.21
				10.343	

Ausschüttende EUR-Klasse D

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
23.07.21	30.07.21	0,109	500.100	54.318	01.01.21 bis 30.06.21

Ausschüttende EUR-Klasse R

Festsetzungsdatum	Zahlungsdatum	Betrag pro Anteil GBP	Anzahl Anteile	Betrag in GBP	Massgeblicher Zeitraum
23.07.21	30.07.21	0,122	100	12	01.01.21 bis 30.06.21

6. Anteilskapital

Zeichneranteile

Die Gesellschaft hat sieben Zeichneranteile zu je EUR 1,27 ausgegeben, die alle voll eingezahlt sind und im Namen der als Nominee auftretenden CT AM Capital (UK) Limited gehalten werden.

Das Zeichneranteilskapital ist nicht Teil der Teilfonds und wird hier lediglich zur Information angegeben.

Gewinnberechtigte Anteile

Die Gesellschaft hat ein genehmigtes Anteilskapital von 500 Millionen Anteilen ohne Nennwert. Das den ausgegebenen rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Anteilskapital entspricht stets dem Nettoinventarwert der Gesellschaft.

Rückzahlbare gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen der Anteilinhaber rückzahlbar und werden als finanzielle Verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen.

Erläuterung 9 enthält nähere Angaben zu den gewinnberechtigten Anteilen der einzelnen Anteilklassen.

7. Aufstellung der Bestandsveränderungen

Eine Aufstellung der Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlagenbestands wird den Anteilhabern auf Anfrage zugestellt. Am Ende dieses Abschlusses ist eine Analyse der wesentlichen Portfolioveränderungen aufgeführt. Die wesentlichen Portfolioveränderungen zeigen die wichtigsten Wertpapierkäufe und -verkäufe, die mindestens 1 % des Gesamtwerts aller Käufe bzw. Verkäufe ausmachen.

8. Direct Brokerage

Der Anlageverwalter und seine Beauftragten können mit Maklern zusammenarbeiten, die die Auftragsabwicklung sowie eine schnelle, faire und zügige Ausführung von Kundenaufträgen sicherstellen oder Research- bzw. Beratungsdienstleistungen erbringen, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie zur Erbringung von Anlagedienstleistungen beitragen und für die Gesellschaft bzw. die Teilfonds von Nutzen sind. Alle Geschäfte werden in Übereinstimmung mit den Standards für die bestmögliche Ausführung ausgeführt.

Die einzelnen Makler werden aus unterschiedlichen Gründen ausgewählt, wobei Faktoren wie bspw. finanzielle Sicherheit, Qualität und Umfang der Ausführungsdienstleistungen sowie Kosten und Reaktionsgeschwindigkeit bei der Behandlung von Kundenanfragen berücksichtigt werden.

Wird ein Makler ausschliesslich für Researchdienstleistungen entschädigt, werden diese Kosten vom betreffenden Anlageverwalter oder gegebenenfalls von einem seiner Beauftragten getragen und nicht auf die Gesellschaft oder einen Teilfonds überwält.

Es wurden für keinen Teilfonds neue Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen oder Direct Brokerage eingegangen, weder durch die Gesellschaft selbst noch durch die Anlageverwalter.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

9. Statistische Vergleichszahlen

Nettoinventarwert	Ungeprüft 30.09.2022	Geprüft 31.03.2022	Ungeprüft 30.09.2021
CT European Real Estate Securities Fund (in Tsd. GBP)	24.857	48.073	48.522
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (in Tsd. EUR)	482.856	547.630	482.612
CT Multi-Strategy Global Equity Fund (in Tsd. EUR)	303.024	360.069	396.536
CT Enhanced Income Euro Equity Fund (in Tsd. EUR)*	-	5.757	6.960

* am 6. September 2022 geschlossen

NIW pro Anteil**CT European Real Estate Securities Fund**

- Thesaurierende EUR-Klasse A*	€20,32	€30,92	€ 30,28
- Thesaurierende NOK-Klasse A*	NOK172,04	NOK261,70	NOK 254,28
- Thesaurierende GBP-Klasse A	£22,33	£33,84	£ 32,93
- Ausschüttende GBP-Klasse A	£18,09	£27,63	£ 27,02
- Thesaurierende EUR-Klasse B*	€21,53	€32,68	€ 31,90
- Thesaurierende GBP-Klasse B	£23,52	£35,56	£ 34,56
- Ausschüttende GBP-Klasse C	£18,56	£28,30	£ 27,65
- Thesaurierende GBP-Klasse D	£8,99	£13,57	£ 13,16

* abgesicherte Anteilsklasse

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

- Thesaurierende EUR-Klasse A	€12,38	€12,58	€ 12,36
- Thesaurierende SEK-Klasse A*	SEK102,60	SEK103,99	SEK 101,84
- Thesaurierende USD-Klasse A*	US\$13,80	US\$13,90	US\$ 13,60
- Thesaurierende EUR-Klasse B	€13,12	€13,29	€ 13,01
- Thesaurierende GBP-Klasse C	£13,96	£14,03	£ 13,69

* abgesicherte Anteilsklasse

CT Multi-Strategy Global Equity Fund

- Thesaurierende EUR-Klasse F	€19,49	€21,54	€ 21,74
-------------------------------	--------	--------	---------

CT Enhanced Income Euro Equity Fund*

- Ausschüttende EUR-Klasse A	-	€10,57	€ 11,22
- Ausschüttende GBP-Klasse B	-	£10,65	£ 11,23
- Ausschüttende EUR-Klasse D	-	€10,57	€ 11,21
- Ausschüttende EUR-Klasse R	-	€10,65	€ 11,23

* am 6. September 2022 geschlossen

Anzahl Anteile	Ungeprüft 30.09.2022	Geprüft 31.03.2022	Ungeprüft 30.09.2021
CT European Real Estate Securities Fund			
- Thesaurierende EUR-Klasse A*	98.180	102.927	94.571
- Thesaurierende NOK-Klasse A*	14.103	20.451	20.451
- Thesaurierende GBP-Klasse A	20.603	20.668	20.668
- Ausschüttende GBP-Klasse A	21.232	25.208	27.754
- Thesaurierende EUR-Klasse B*	35.905	38.615	38.940
- Thesaurierende GBP-Klasse B	571.943	840.955	889.525
- Ausschüttende GBP-Klasse C	422.351	438.690	442.826
- Thesaurierende GBP-Klasse D	10.199	10.199	10.199

* abgesicherte Anteilsklasse

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

9. Statistische Vergleichszahlen (Fortsetzung)

Anzahl Anteile (Fortsetzung)	Ungeprüft 30.09.2022	Geprüft 31.03.2022	Ungeprüft 30.09.2021
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund			
- Thesaurierende EUR-Klasse A	11.610.352	12.035.862	9.432.804
- Thesaurierende SEK-Klasse A*	875.134	915.505	5.297.806
- Thesaurierende USD-Klasse A*	430.780	469.326	400.047
- Thesaurierende EUR-Klasse B	21.816.076	25.608.066	21.210.151
- Thesaurierende GBP-Klasse C	2.426.317	2.465.674	2.014.699
* abgesicherte Anteilsklasse			
CT Multi-Strategy Global Equity Fund			
- Thesaurierende EUR-Klasse F	15.547.918	16.718.825	18.239.429
CT Enhanced Income Euro Equity Fund*			
- Ausschüttende EUR-Klasse A	-	105	101
- Ausschüttende GBP-Klasse B	-	352.187	99.240
- Ausschüttende EUR-Klasse D	-	124.325	504.894
- Ausschüttende EUR-Klasse R	-	106	101

* am 6. September 2022 geschlossen

10. Wechselkurse

Im Folgenden sind die bei der Erstellung dieses Jahresabschlusses verwendeten Wechselkurse zum Euro und zum Pfund Sterling am 30. September 2022 und am 31. März 2022 aufgeführt.

	Wechselkurs zum EUR Sept. 2022	Wechselkurs zum EUR März 2022	Wechselkurs zum GBP Sept. 2022	Wechselkurs zum GBP März 2022
Australischer Dollar	1,52	1,48	1,74	1,75
Brasilianischer Real	5,30	5,29	6,04	6,26
Kanadischer Dollar	1,35	1,39	1,53	1,64
Chinesischer Renminbi	6,95	7,06	7,92	8,35
Dänische Krone	7,44	7,44	8,47	8,80
Ägyptisches Pfund	-	-	-	24,07
Euro	-	-	1,14	1,18
Hongkong-Dollar	7,69	8,71	8,76	10,31
Ungarischer Forint	-	-	-	434,57
Indische Rupie	79,70	84,31	90,81	99,77
Indonesische Rupiah	14.917,62	15.980,44	16.998,45	18.910,39
Japanischer Yen	141,80	135,05	161,58	159,81
Koreanischer Won	1.401,58	1.348,59	1.597,09	1.595,85
Mexikanischer Peso	19,70	22,19	22,45	26,26
Neuer Taiwan-Dollar	31,10	31,88	35,44	37,72
Neue Türkische Lira	18,16	16,32	20,69	19,31
Nigerianischer Naira	426,64	462,86	486,15	547,73
Norwegische Krone	10,68	9,73	12,16	11,51
Philippinischer Peso	-	57,57	-	68,13
Polnischer Zloty	4,84	4,64	5,51	5,49
Russischer Rubel	59,88	91,63	68,23	108,43
Singapur-Dollar	1,41	1,51	1,60	1,78
Südafrikanischer Rand	17,61	16,26	20,06	19,24
Pfund Sterling	0,88	0,85	-	-
Schwedische Krone	10,87	10,37	12,39	12,27
Schweizer Franken	0,96	1,02	1,10	1,21

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

10. Wechselkurse (Fortsetzung)

	Wechselkurs zum EUR Sep 2022	Wechselkurs zum EUR März 2022	Wechselkurs zum GBP Sep 2022	Wechselkurs zum GBP März 2022
US-Dollar	0,98	1,11	1,12	1,32
Vietnamesischer Dong	23.379,34	25.413,49	26.640,49	30.072,96

Die folgende Tabelle zeigt die bei der Erstellung dieses Abschlusses ebenfalls verwendeten durchschnittlichen Wechselkurse zum Euro für die Rechnungsperioden zum 30. September 2022, 31. März 2022 und zum 30. September 2021.

	Wechselkurs zum EUR Sep 2022	Wechselkurs zum EUR März 2022	Wechselkurs zum EUR Sep 2022
Pfund Sterling		0,86	0,85

11. Derivate und andere Finanzinstrumente

Laut Abschnitt 11.27 des FRS 102 zur Offenlegung des beizulegenden Zeitwerts muss die Gesellschaft Angaben zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage der Zeitwerthierarchie machen, anhand derer Bemessungen des beizulegenden Zeitwerts für die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten kategorisiert werden. Diese Angaben stützen sich auf eine dreistufige Zeitwerthierarchie für die im Rahmen der Bewertungstechniken zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Bewertungsparameter.

Die Zeitwerthierarchie nach FRS 102 beruht auf den Bewertungsparametern, die zur Bemessung des Zeitwerts der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet werden, und auf der Marktaktivität jedes finanziellen Vermögenswerts und jeder finanziellen Verbindlichkeit. Die Stufen 1, 2 und 3 werden so definiert:

Stufe 1: Auf aktiven Märkten notierte, unangepasste Preise für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, die am Bewertungstag abgerufen werden können.

Stufe 2: Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert bzw. die Verbindlichkeit entweder direkt oder indirekt beobachtbar sind (d.h. abgeleitete Marktdaten), aber keine notierten Preise im Sinne der Stufe 1 sind.

Stufe 3: Bewertungsparameter, die für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten nicht beobachtbar sind (d. h. es sind keine Marktdaten verfügbar).

Die Ebene in der Zeitwerthierarchie, der die Bewertung des beizulegenden Zeitwerts gesamthaft zugeteilt wird, richtet sich nach der niedrigsten Stufe eines Bewertungsparameters, der für die Bemessung des beizulegenden Zeitwerts von Bedeutung ist.

Hierfür wird die Massgeblichkeit eines Bewertungsparameters im Verhältnis zur gesamten Zeitwertbemessung beurteilt. Wenn zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts beobachtbare Parameter verwendet werden, die bedeutende Anpassungen auf der Grundlage von nicht beobachtbaren Eingabedaten erfordern, ist die Bewertung der 3. Stufe zuzuordnen. Bei der Beurteilung der Bedeutung eines bestimmten Parameters für die vollumfängliche Bewertung des beizulegenden Zeitwerts müssen die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifischen Faktoren berücksichtigt werden. Was als beobachtbar gilt, liegt im Wesentlichen im Ermessen des Anlageverwalters.

Der Verwaltungsrat hält solche Daten für „beobachtbar“, die am Markt leicht verfügbar, zuverlässig, nachprüfbar und unternehmensunspezifisch sind, regelmässig veröffentlicht oder aktualisiert werden und aus unabhängigen, aktiv am Markt vertretenen Quellen stammen.

Zum 30. September 2022 hielt der CT Multi-Strategy Global Equity Fund ein Beteiligungspapier: Moscow Exchange MICEX-RTS mit einem Marktwert von null. Dieser Titel wurde aufgrund des Konflikts zwischen Russland und der Ukraine auf null heruntergeschrieben und ist weiterhin in der Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordnet.

Im am 30. September 2022 abgeschlossenen Berichtszeitraum wurden keine Übertragungen zwischen den Stufen vorgenommen. Im Geschäftsjahr zum 31. März 2022 wurde Moscow Exchange MICEX-RTS, ein Wertpapier des CT Multi-Strategy Global Equity Fund, von Stufe 1 zu Stufe 3 übertragen.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

11. Derivate und andere Finanzinstrumente (Fortsetzung)

Die nachfolgenden Tabellen zeigen, wie sich die zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 30. September 2022 (je nach Art) auf die Zeitwerthierarchie verteilen:

CT European Real Estate Securities Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP
Beteiligungspapiere	16.726	-	-	16.726
Derivate – Differenzkontrakte	-	393	-	393
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	37	-	37
Total Vermögenswerte	16.726	430	-	17.156
Verbindlichkeiten				
Derivate – Differenzkontrakte	-	(3.096)	-	(3.096)
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	(76)	-	(76)
Total Verbindlichkeiten	-	(3.172)	-	(3.172)
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Anleihen	-	39.986	-	39.986
Beteiligungspapiere	119.092	-	-	119.092
Derivate – Differenzkontrakte	-	22.040	-	22.040
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	1.950	-	1.950
Total Vermögenswerte	119.092	63.976	-	183.068
Verbindlichkeiten				
Derivate – Differenzkontrakte	-	(29.022)	-	(29.022)
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	(758)	-	(758)
Total Verbindlichkeiten	-	(29.780)	-	(29.780)
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Beteiligungspapiere	302.314	-	-	302.314
Derivate – Futures	1.342	-	-	1.342
Total Vermögenswerte	303.656	-	-	303.656
Passiva				
Derivate – Futures	(1.138)	-	-	(1.138)
Total Verbindlichkeiten	(1.138)	-	-	(1.138)

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

11. Derivate und andere Finanzinstrumente (Fortsetzung)

Die nachfolgenden Tabellen zeigen, wie sich die zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Teilfonds zum 31. März 2022 (je nach Art) auf die Zeitwerthierarchie verteilen:

CT European Real Estate Securities Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP	in Tsd. GBP
Beteiligungspapiere	33.203	-	-	33.203
Derivate – Differenzkontrakte	-	1.144	-	1.144
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	7	-	7
Total Vermögenswerte	33.203	1.151	-	34.354
Verbindlichkeiten				
Derivate – Differenzkontrakte	-	(606)	-	(606)
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	(163)	-	(163)
Total Verbindlichkeiten	-	(769)	-	(769)
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Anleihen	-	20.032	-	20.032
Beteiligungspapiere	162.712	-	-	162.712
Derivate – Differenzkontrakte	-	8.153	-	8.153
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	1.043	-	1.043
Total Vermögenswerte	162.712	29.228	-	191.940
Verbindlichkeiten				
Derivate – Differenzkontrakte	-	(10.563)	-	(10.563)
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	(2.947)	-	(2.947)
Total Verbindlichkeiten	-	(13.510)	-	(13.510)
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Beteiligungspapiere	359.557	-	-	359.557
Derivate – Futures	739	-	-	739
Total Vermögenswerte	360.296	-	-	360.296
Verbindlichkeiten				
Derivate – Futures	(922)	-	-	(922)
Total Verbindlichkeiten	(922)	-	-	(922)
CT Enhanced Income Euro Equity Fund*	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Total
Vermögenswerte	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR	in Tsd. EUR
Beteiligungspapiere	5.681	-	-	5.681
Derivate – Futures	4	-	-	4
Derivate – Devisenterminkontrakte	-	4	-	4
Total Vermögenswerte	5.685	4	-	5.689
Verbindlichkeiten				
Derivate – Indexoptionen	(7)	-	-	(7)
Total Verbindlichkeiten	(7)	-	-	(7)

* am 6. September 2022 geschlossen

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

11. Derivate und andere Finanzinstrumente (Fortsetzung)

Gewinnberechtignte Anteile (Fortsetzung)

Überleitung Stufe 3

In der folgenden Tabelle ist die Überleitung für alle Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Finanzinstrumente der Stufe 3 im Berichtszeitraum zum 30. September 2022 sowie im Berichtsjahr zum 31. März 2022 aufgeführt:

	30.09.2022 in Tsd. EUR	31.03.2022 in Tsd. EUR
CT Multi-Strategy Global Equity Fund		
Eröffnungssaldo	-	-
Im Berichtszeitraum/-jahr erfasste Gewinne und Verluste	-	-
Käufe	-	-
Verkäufe	-	-
Übertragungen aus der Stufe 3	-	-
Übertragungen in Stufe 3	-	-*
Endsaldo	-	-

* Moscow Exchange MICEX-RTS wurde infolge der Einstellung des Handels in Stufe 3 umklassifiziert und der Marktwert des Titels auf null heruntergeschrieben.

12. Wertpapierleihe

Das Wertpapierleihprogramm der Gesellschaft wird von State Street Bank and Trust Company (die „Wertpapierleihstelle“) verwaltet. Die an die Wertpapierleihstelle verliehenen Wertpapiere können durch Barsicherheiten oder unbare Sicherheiten besichert werden.

Bei unbaren Sicherheiten sollte es sich um übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente (jeglicher Laufzeit) handeln, die eine hohe Liquidität aufweisen und an einem geregelten Markt oder über ein multilaterales Handelssystem mit transparenter Preisgestaltung gehandelt werden, sodass sie schnell und zu einem stabilen Preis, der nahe bei ihrer vor dem Verkauf erfolgten Bewertung liegt, veräußert werden können.

Für bare und unbare Sicherheiten müssen jederzeit die im Abschnitt „Sicherheitenverwaltung“ des Prospekts erläuterten Kriterien eingehalten werden,

Zum 30. September 2022 und zum 31. März 2022 handelt es sich bei den Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte um Staatsanleihen. Der Wert der zum 30. September 2022 und zum 31. März 2022 verliehenen Wertpapiere und der erhaltenen Sicherheiten ist in der untenstehenden Tabelle aufgeführt. Die unbaren Sicherheiten, die von einzelnen Emittenten erhalten wurden, betragen am 30. September 2022 und am 31. März 2022 jeweils maximal 20 % des NIW des betreffenden Teilfonds.

Verliehene Wertpapiere

	30.09.2022 in Tsd. EUR	31.03.2022 in Tsd. EUR
CT Multi Strategy Global Equity Fund	8.130	5.169

Erhaltene Sicherheiten

	30.09.2022 in Tsd. EUR	31.03.2022 in Tsd. EUR
CT Multi Strategy Global Equity Fund	8.683	5.605

Gemäss den Bestimmungen der Wertpapierleihvereinbarung hat die Wertpapierleihstelle das Recht, einen Teil der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften einzubehalten, um die Gebühren und Kosten in Zusammenhang mit den Wertpapierleihgeschäften zu decken. Alle durch Wertpapierleihe erwirtschafteten Erträge, abzüglich der direkten und indirekten Betriebskosten, werden jedoch dem entsprechenden Teilfonds zugeführt.

Die Gesellschaft, die Wertpapierleihstelle und der Anlageverwalter erhalten jeweils 75 %, 15 % bzw. 10 % der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

12. Wertpapierleihe (Fortsetzung)

Die Gesellschaft erhielt Erträge aus Wertpapierleihgeschäften in Höhe von:

	2022 in Tsd. EUR	2021 in Tsd. EUR
CT Multi Strategy Global Equity Fund	17	8

Die Wertpapierleihstelle erhielt Erträge aus Wertpapierleihgeschäften in Höhe von:

	2022 in Tsd. EUR	2021 in Tsd. EUR
CT Multi Strategy Global Equity Fund	3	1

Der Anlageverwalter erhielt Erträge aus Wertpapierleihgeschäften in Höhe von:

	2022 in Tsd. EUR	2021 in Tsd. EUR
CT Multi Strategy Global Equity Fund	2	1

Mit Wertpapierleihgeschäften verbundene Risiken

Wie bei jeder Kreditgewährung bestehen Zahlungsverzögerungs- und Ausfallrisiken. Kommt der Leihnehmer seinen finanziellen Verpflichtungen nicht nach oder verletzt er seine Pflichten aus dem Wertpapierleihgeschäft, so wird auf die geleistete Sicherheit zurückgegriffen. Die Sicherheit wird so ausgelegt, dass sie wertmässig dem Wert der übertragenen Wertpapiere entspricht oder diesen übertrifft. Es besteht jedoch das Risiko, dass der Wert der Sicherheit unter den Wert der übertragenen Wertpapiere fällt. Da Teilfonds zudem Barsicherheiten, die sie erhalten haben, in Übereinstimmung mit den von der irischen Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen anlegen dürfen, sind die Teilfonds, die Sicherheiten anlegen, den Risiken ausgesetzt, die mit solchen Anlagen verbunden sind, wie z. B. dem Risiko, dass der Emittent des jeweiligen Wertpapiers säumig ist oder seine Pflichten verletzt.

13. Geschäftsvorfälle mit nahestehenden Personen

Die Gesellschaft hat Thames River Capital LLP und Columbia Threadneedle Management Limited als Anlageverwalter bestellt. Alle an die Anlageverwalter gezahlten Gebühren werden in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung separat ausgewiesen.

Herr Stuart Woodyatt ist Mitarbeiter der Columbia Threadneedle Management Limited. Drew Newman sitzt im Verwaltungsrat von mit Columbia Threadneedle Investments verbundenen Unternehmen.

Am 30. September 2022 hielt der Anlageverwalter Columbia Threadneedle Management Limited 1000 Anteile des CT Real Estate Equity Market Neutral Fund (31. März 2022: 1000) und null Anteile des CT Enhanced Income Euro Equity Fund (31. März 2022: 1.369 Anteile).

Ameriprise Financial Inc, die ultimative Muttergesellschaft des Anlageverwalters, hielt am 30. September 2022 null Anteile des CT Enhanced Income Euro Equity Fund (31. März 2022: 252.903 Anteile).

Der CT (Lux) Diversified Growth, ein Teilfonds des Columbia Threadneedle (Lux) III Fund, welcher von Columbia Threadneedle Management Limited verwaltet wird, hielt am 30. September 2022 695.534 Anteile des CT Multi-Strategy Global Equity Fund (31. März 2022: 695.534 Anteile).

BMO Investments Inc. gehörte bis am 8. November 2021 derselben Unternehmensgruppe an wie die Anlageverwalter. Am 30. September 2022 hielt BMO Investments Inc. null Anteile des CT Enhanced Income Euro Equity Fund (31. März 2022: 124.220 Anteile).

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

13. Geschäftsvorfälle mit nahestehenden Personen (Fortsetzung)

Legt ein Teilfonds in Anteilen anderer Anlagefonds („OGA“) an, die direkt oder per Auftrag vom Anlageverwalter oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit welcher der Anlageverwalter durch eine gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist („eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung“ kann als Beteiligung definiert werden, die mehr als 10 % des Kapitals oder der Stimmrechte repräsentiert), so darf der Anlageverwalter oder die andere Gesellschaft dem Teilfonds für die Verwaltung, die Zeichnung, den Umtausch oder die Rücknahme von Anteilen dieses OGA keine Gebühren belasten. Am 30. September 2022 und am 31. März 2022 hielt keiner der Teilfonds Anteile an einem mit der Gesellschaft verbundenen OGA.

Investieren die Teilfonds in andere Fonds, werden meistens Rabattvereinbarungen mit dem Anlageverwalter getroffen, aufgrund derer die für den zugrundeliegenden Fonds erhobene Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise rückerstattet wird.

Zum 30. September 2022 und zum 31. März 2022 wurden keine Rabatte gewährt.

Mit Wirkung ab dem 17. Dezember 2021 wurde KBA Consulting Management Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) zur Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft ernannt. Die Gebühren der Verwaltungsgesellschaft werden in der Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen. Bis zum 16. Dezember 2021 hat KB Associates für die Gesellschaft Dienstleistungen im Bereich der Geschäftsführung erbracht und dafür im Berichtszeitraum zum 30. September 2021 Gebühren in Höhe von EUR 22.558 erhalten.

Am 30. September 2022 gab es bei den folgenden Teilfonds Anteilinhaber, deren Besitz mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds ausmachte:

Teilfonds	Anzahl	
	Anteilinhaber	Beteiligung in %
CT European Real Estate Securities Fund	3	49,40
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	2	95,53

Am 31. März 2022 gab es bei den folgenden Teilfonds Anteilinhaber, deren Besitz mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds ausmachte:

Teilfonds	Anzahl	
	Anteilinhaber	Beteiligung in %
CT European Real Estate Securities Fund	4	55,59
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	2	95,83
CT Enhanced Income Euro Equity Fund	3	99,71

Im Berichtszeitraum wurden der Gesellschaft Verwaltungsratshonorare in Höhe von EUR 114.066 (30. September 2021: EUR 106.232) in Rechnung gestellt. Diese werden in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen. Die zahlbaren Verwaltungsratshonorare betragen am Ende des Berichtszeitraums zum 30. September 2022 EUR 80.734 (am 31. März 2022: EUR 2.678).

In einem früheren Geschäftsjahr wurde festgestellt, dass Thames River Capital LLP für ihre Funktion als Anlageverwalter des CT Real Estate Equity Market Neutral Fund seit der Auflegung dieses Teilfonds EUR 727.424 zu viel Performancegebühr erhalten hat. Die Gesellschaft hat entschieden, dass der Anlageverwalter von diesem Betrag EUR 620.328 direkt an die Anteilinhaber zurückzuzahlen hat, bei denen der Wert ihre Anteile an diesem Teilfonds durch diese Überbezahlung beeinträchtigt worden war, und dass die restlichen EUR 107.096 nach der Erstattung an die Anteilinhaber an den Teilfonds zurückzuzahlen sind.

Bis zum 30. September 2022 wurden EUR 107.096 vollumfänglich an den Teilfonds und EUR 579.686 an die Anteilinhaber rückerstattet (31. März 2022: EUR 579.686). Somit stand am Ende des Berichtszeitraums noch ein Betrag von EUR 40.642 (31. März 2022: EUR 40.642) zur Rückzahlung aus. Die restlichen an die Anteilinhaber zahlbaren Beträge werden als „Bankguthaben“ und als „Kreditoren“ im ungeprüften Nettovermögensausweis des Teilfonds aufgeführt.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

14. Besteuerung

Nach derzeitigem Recht und derzeitiger Praxis erfüllt die Gesellschaft die Voraussetzungen eines Anlageorganismus im Sinne von Section 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 („TCA“) in seiner jeweils gültigen Fassung. Er unterliegt daher keiner irischen Ertrags- und Kapitalgewinnsteuer.

Bei Eintreten eines steuerpflichtigen Ereignisses kann jedoch eine irische Steuer anfallen. Zu steuerpflichtigen Ereignissen zählen Ausschüttungen an Anteilinhaber sowie die Einlösung, Rücknahme, Annullierungen, oder Übertragung von Anteilen, sowie jede fiktive Veräusserung von Anteilen, die zu irischen Steuerzwecken dann eintritt, wenn Anteile der Gesellschaft während mindestens acht Jahren gehalten wurden.

In Verbindung mit einem steuerpflichtigen Ereignis entsteht in Irland keine Steuerpflicht in Bezug auf:

- (a) Anteilinhaber, die in Irland weder steueransässig sind noch ihren ständigen Aufenthalt haben, vorausgesetzt, dass der Gesellschaft bei Eintreten eines steuerpflichtigen Ereignisses entsprechende gültige Erklärungen gemäss Anhang 2B TCA vorliegen oder dass die irische Steuerbehörde der Gesellschaft die Genehmigung erteilt hat, ohne entsprechende Erklärung Bruttozahlungen zu leisten, oder
- (b) bestimmte in Irland ansässige steuerbefreite Anteilinhaber (gemäss Definition in Section 739D TCA), die der Gesellschaft bei Eintreten des steuerpflichtigen Ereignisses die gesetzlich erforderlichen unterschriebenen Erklärungen gemäss Anhang 2B TCA eingereicht haben.

Etwaige von der Gesellschaft aus Anlagen vereinnahmte Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne können Quellen- und Kapitalgewinnsteuern unterliegen, die vom Ursprungsland dieser Anlageerträge bzw. -gewinne erhoben werden. Solche Steuern können von der Gesellschaft und ihren Anteilhabern möglicherweise nicht zurückgefordert werden.

15. Haftungstrennung zwischen den Teilfonds

Die Gesellschaft ist ein Umbrella-Fonds mit Haftungstrennung zwischen den Teilfonds. Daher können nach irischem Recht die einem bestimmten Teilfonds zuzuordnenden Verbindlichkeiten nur aus dem Vermögen dieses Teilfonds erfüllt werden und das Vermögen anderer Teilfonds darf nicht zur Erfüllung solcher Verbindlichkeiten herangezogen werden. Ausserdem enthält jeder von der Gesellschaft abgeschlossene Vertrag kraft des Gesetzes eine stillschweigend eingeschlossene Bedingung, wonach der Vertragskontrahent nicht auf Vermögenswerte eines anderen Teilfonds als des/der Teilfonds, für den/die der Vertrag abgeschlossen wurde, zurückgreifen kann. Diese Bestimmungen sind für Gläubiger und im Falle von Zahlungsunfähigkeit verbindlich. Dennoch kann nicht garantiert oder versichert werden, dass die Haftungstrennung zwischen den Teilfonds aufrechterhalten wird, wenn bei einem Gericht eines anderen Rechtshoheitsgebiets gegen die Gesellschaft Klage eingereicht wird.

16. Strategie bei der Verwendung von Finanzinstrumenten

Die Anlageverwalter haben im Rahmen ihrer Anlagestrategien Derivate für Anlagezwecke und zur Absicherung von Risiken eingesetzt. Im Berichtszeitraum wurden Differenzkontrakte („CFD“), Futures, und Devisenterminkontrakte („Devisenforwards“) eingesetzt. Die Derivate wurden als kosteneffiziente Alternative zu der direkten Investition in die entsprechenden Wertpapiere bei der Zusammenstellung des Anlagenportfolios verwendet oder um das Engagement auf eine Weise zu erhöhen oder zu reduzieren, die mit dem Direktbesitz der Wertpapiere nicht möglich ist. Einige der so eingegangenen Positionen sind gehebelt oder Short-Positionen und bergen daher ein grösseres Verlustrisiko als eine gewöhnliche Long-Position, deren Risiko sich in der Regel auf das ursprünglich investierte Kapital begrenzt.

Aufgrund ihrer Anlagen sind die Teilfonds verschiedenen Risiken ausgesetzt. Alle Anlagen bergen ein Kapitalverlustrisiko. Diese Risiken umfassen unter anderem Kursrisiken, Zinsrisiken, Kreditrisiken und Liquiditätsrisiken. Der Anlageverwalter jedes Teilfonds ist für die Überwachung der Risiken zuständig und erstattet diesbezüglich dem Verwaltungsrat regelmässig Bericht. Der Jahresabschluss zum 31. März 2022 enthält umfassendere Angaben zu den Risiken der Teilfonds.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

16. Strategie bei der Verwendung von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Alle Teilfonds setzten Devisenterminkontrakte zu Anlageverwaltungs- und Währungsabsicherungszwecken ein. Die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste aus allen Devisenterminkontrakten werden in Erläuterung 3 ausgewiesen. Die Erträge aus diesen Kontrakten können nicht von der Gesamrendite des Finanzinstruments abgespalten werden und ferner kann auch nicht zwischen Erträgen aus Transaktionen zu Anlagezwecken und Erträgen aus Transaktionen zur Währungsabsicherung unterschieden werden. Die Transaktionskosten von Terminkontrakten sind in ihrem Kurs enthalten und können nicht separat im Abschluss ausgewiesen werden.

Bei offenen Futures-Kontrakten werden Änderungen des Kontraktwertes durch Neubewertung auf der Grundlage des aktuellen Marktkurses am Bilanzstichtag ermittelt und als nicht realisierte Gewinne oder Verluste verbucht und in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung im „Nettoertrag/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten“ ausgewiesen. Bei Glattstellung des Kontraktes wird die Differenz zwischen dem Erlös aus (oder den Kosten) der Glattstellungstransaktion und der ursprünglichen Transaktion als realisierter Gewinn bzw. Verlust erfasst. Die geleisteten Einschüsse auf offene Futures sind im ungeprüften Nettovermögensausweis gesondert ausgewiesen. Der beizulegende Zeitwert von Futures wird anhand von bei einem Kursanbieter eingeholten Preisen ermittelt.

Offene CFD werden zu dem gemäss Kontrakt an die bzw. von der Gegenpartei zahlbaren Nettobetrag einschliesslich des nicht realisierten Wertzuwachses oder -verlusts aus der Veränderung des beizulegenden Zeitwerts der Referenzaktien angesetzt und im ungeprüften Nettovermögensausweis als Derivate unter den zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten ausgewiesen. Realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste erscheinen als „Nettoertrag/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten“ in der ungeprüften Gesamterfolgsrechnung.

Hält die Gesellschaft Long-Positionen in Differenzkontrakten, erhält sie die auf die zugrundeliegenden Aktien anfallenden Dividenden und zahlt Zinsen an die Gegenpartei. Bei Short-Positionen in Differenzkontrakten erhält die Gesellschaft Zinsen auf den Kontraktwert und die Dividendenaufwendungen aus Differenzkontrakten sind im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten enthalten.

Die Kontrakte werden anhand des Marktwerts des zugrundeliegenden Wertpapiers bewertet.

Die Gegenparteien von OTC-Derivaten werden am Schluss des ungeprüften Anlagenbestandes jedes Teilfonds aufgeführt und die damit verbundenen Sicherheitsleistungen und Guthaben auf Margin-Konten werden im ungeprüften Nettovermögensausweis angegeben.

17. Meldefonds-Status

Bestimmte Anteilklassen der Teilfonds haben den Status als berichtende Fonds gemäss der Regelung des Vereinigten Königreichs für Offshore-Fonds.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

18. Bedeutende Ereignisse im Berichtszeitraum

Am 4. Juli 2022 veröffentlichte die Gesellschaft einen aktualisierten Prospekt, um der Namensänderung von BMO Investment III (Ireland) plc in Columbia Threadneedle (Irl) III plc und der wie folgt dargelegten Umbenennung der einzelnen Teilfonds Rechnung zu tragen:

Früherer Name

BMO Enhanced Income Euro Equity Fund
BMO European Real Estate Securities Fund
BMO Multi-Strategy Global Equity Fund
BMO Real Estate Equity Market Neutral Fund

Neuer Name

CT Enhanced Income Euro Equity Fund
CT European Real Estate Securities Fund
CT Multi-Strategy Global Equity Fund
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

Zum selben Datum änderte die Anlageverwaltungsgesellschaft der Gesellschaft BMO Asset Management Limited ihren Namen in Columbia Threadneedle Management Limited.

David Hammond und John Fitzpatrick sind am 6. September 2022 aus dem Verwaltungsrat zurückgetreten.

Drew Newman, Eimear Cowhey und Liam Miley wurden am 6. September 2022 in den Verwaltungsrat gewählt. Der CT Enhanced Income Euro Equity Fund wurde am 6. September 2022 geschlossen.

Im Berichtszeitraum sind keine weiteren für die Gesellschaft bedeutenden Ereignisse eingetreten.

19. Bedeutende Ereignisse nach Abschluss des Berichtszeitraums

Der CT European Real Estate Securities Fund nahm für seine zwei ausschüttenden Anteilklassen eine Ausschüttung vor. Ex-Datum war der 24. Oktober 2022 und Zahlungsdatum der 28. Oktober 2022. Insgesamt wurden GBP 67.871 ausgeschüttet.

Am 28. Oktober 2022 wurde die Verwaltungsgesellschaft KBA Consulting Management Limited ein Mitglied der Waystone Group.

Seit Ende des Berichtszeitraums sind keine weiteren für die Gesellschaft bedeutenden Ereignisse eingetreten.

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

20. Geschäftsvorfälle mit verbundenen Parteien

Gemäss den OGAW-Verordnungen müssen sämtliche Transaktionen zwischen einem OGAW und einer verbundenen Partei a) zu branchenüblichen Bedingungen wie zwischen voneinander unabhängigen Geschäftsparteien und b) im besten Interesse der Anteilhaber des OGAW ausgeführt werden. Als „verbundene Parteien“ gelten die Verwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle eines OGAW, ihre Beauftragten und Unterbeauftragten (mit Ausnahme der von einer Verwahrstelle bestellten Unterdepotstellen, die nicht zur selben Gruppe gehören) sowie sonstige assoziierte oder Konzerngesellschaften dieser Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle, Beauftragten oder Unterbeauftragten.

Die Verwaltungsgesellschaft hat sich davon überzeugt, dass Vorkehrungen getroffen und durch schriftliche Verfahren belegt wurden, um sicherzustellen, dass diese Vorschriften auf alle Geschäftsvorfälle mit verbundenen Parteien angewendet werden, und dass diese Vorschriften bei allen im Berichtszeitraum mit verbundenen Parteien abgeschlossenen Geschäften eingehalten wurden.

21. Sicherheitsleistungen

Zum 30. September 2022 waren die folgenden Barsicherheiten für Derivate hinterlegt:

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	Total in Tsd. EUR
State Street	2.532*	55.000	57.885
Goldman Sachs	3.383	16.491	20.346
	5.915	71.491	78.231

*Goldman Sachs hat ein Pfandrecht auf die als Pfand bei der Verwahrstelle hinterlegten Barsicherheiten für den Fall, dass ein Teilfonds zahlungsunfähig wird.

Zum 31. März 2022 waren die folgenden Barsicherheiten für Derivate hinterlegt:

	CT European Real Estate Securities Fund in Tsd. GBP	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund in Tsd. EUR	Total in Tsd. EUR
State Street	2.531*	50.000	52.995
Goldman Sachs	1.127	22.012	23.346
	3.658	72.012	76.341

*Goldman Sachs hat ein Pfandrecht auf die als Pfand bei der Verwahrstelle hinterlegten Barsicherheiten für den Fall, dass ein Teilfonds zahlungsunfähig wird.

Am 30. September 2022 und am 31. März 2022 standen gegenüber Brokern keine Barsicherheiten aus.

Von den Teilfonds als Sicherheiten hinterlegte Wertpapiere werden in den Anlagenbeständen der jeweiligen Teilfonds zum beizulegenden Zeitwert erfasst und ggf. am Schluss der ungeprüften Anlagenbestände entsprechend ausgewiesen.

22. Genehmigung des Abschlusses

Der Abschluss wurde am 25. November 2022 vom Verwaltungsrat genehmigt.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

WESENTLICHE BESTANDSVERÄNDERUNGEN

für das Halbjahr zum 30. September 2022

CT European Real Estate Securities Fund

	Käufe Nominal GBP	Verkäufe Nominal GBP
Aedifica	522.779	172.861
Argan	405.126	-
Aroundtown	489.693	580.281
Atrium Ljungberg	170.458	-
Befimmo	-	198.706
Care Property Invest	-	195.201
Carmila	113.669	-
Castellum	1.015.812	690.085
Catena	162.102	342.236
Cibus Nordic	-	747.228
Cofinimmo	479.587	1.116.897
Deutsche EuroShop	-	347.596
Dios Fastigheter	-	585.270
Fabege	282.279	-
Fastighets Balder (Klasse B)	155.136	820.177
Grand City Properties	193.485	312.538
Home	149.652	-
Inmobiliaria Colonial Socimi	110.424	-
Klepierre	886.117	175.051
Kojamo	-	611.739
LEG Immobilien	-	1.056.626
LXI	-	908.390
Merlin Properties Socimi	-	769.818
Mobimo Holding	377.926	328.221
NSI	208.089	246.772
Nyfosa	-	259.525
Pandox	149.519	-
PSP Swiss Property	-	376.740
Sagax	342.758	467.980
Samhallsbyggnadsbolaget I Norden	-	251.602
Supermarket Income	753.685	659.627
Swiss Prime Site	451.469	178.074
TAG Immobilien	607.733	-
Unibail-Rodamco-Westfield	825.395	-
VGP	-	488.299
Vonovia	1.078.912	852.824
Warehouses De Pauw	513.728	1.361.961
Xior Student Housing	-	296.482

Diese Aufstellung enthält die Gesamtkäufe und -verkäufe von Anlagen, die 1 % des gesamten Kauf- und Verkaufswerts im Berichtszeitraum überschreiten, oder mindestens die 20 grössten Käufe und Verkäufe.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

WESENTLICHE BESTANDSVERÄNDERUNGEN

für das Halbjahr zum 30. September 2022

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

	Käufe Nominal EUR	Verkäufe Nominal EUR
Aedifica	11.052.741	-
Agree Realty	2.297.408	-
Aroundtown	3.157.531	-
Atrium Ljungberg	2.585.031	-
Care Property Invest	-	3.972.328
Carmila	2.460.890	1.984.721
Castellum	19.290.874	6.840.464
Catena	3.573.579	2.901.049
Cibus Nordic	-	12.181.612
Cofinimmo	10.894.355	11.280.691
Digital Realty Trust	1.904.538	-
Dios Fastigheter	-	8.180.084
Duke Realty	2.040.118	4.562.298
Equinix	-	1.946.794
Fastighets Balder (Klasse B)	3.339.318	9.805.235
First Industrial Realty Trust	2.532.768	2.320.999
Healthpeak Properties	2.138.810	-
Home	3.432.528	2.902.338
Inmobiliaria Colonial Socimi	3.191.415	-
LEG Immobilien	21.381.131	1.744.494
LXI	-	9.371.157
Merlin Properties Socimi	-	6.972.884
National Retail Properties	2.280.216	4.217.472
NSI	3.947.626	-
Park Hotels & Resorts	1.595.653	-
Prologis	-	1.780.729
Realty Income	2.105.683	2.459.908
Rexford Industrial Realty	3.368.790	-
Sunstone Hotel Investors	-	1.927.746
Supermarket Income	12.262.059	12.649.067
TAG Immobilien	8.519.232	-
VGP	-	7.896.926
Warehouses De Pauw	1.705.719	1.651.400
Xior Student Housing	-	3.047.906

Diese Aufstellung enthält die Gesamtkäufe und -verkäufe von Anlagen, die 1 % des gesamten Kauf- und Verkaufswerts im Berichtszeitraum überschreiten, oder mindestens die 20 grössten Käufe und Verkäufe.

In der Tabelle der wesentlichen Bestandsveränderungen für diesen Teilfonds wurden die Käufe, Verkäufe und Fälligkeiten der französischen Schatzwechsel, die im Berichtszeitraum vom Teilfonds als kurzfristige liquide Ersatzpositionen gehalten wurden, nicht berücksichtigt.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

WESENTLICHE BESTANDSVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

CT Multi-Strategy Global Equity Fund

	Käufe Nominal EUR	Verkäufe Nominal EUR
Aflac	727.337	-
American Tower	-	1.925.545
Anthem	962.751	-
AP Moller (Klasse B)	-	1.137.945
Apple	1.330.178	-
Bank of China (Klasse H)	922.920	-
Cadence Design Systems	-	1.406.209
Canadian Imperial Bank of Commerce	-	1.678.104
CBRE	2.221.981	-
Cerner	-	2.359.983
Charter Communications	-	1.379.247
China Construction Bank (Klasse H)	953.035	-
ConocoPhillips	879.402	949.879
CRH	-	1.162.759
CSL	910.409	-
Darden Restaurants	971.616	-
Deutsche Telekom	-	3.530.209
Eli Lilly	2.677.286	1.880.870
Fortinet	-	1.473.102
Grab Holdings	1.128.261	984.547
Hologic	901.541	-
Home Depot	-	1.419.211
Hoya	-	974.150
Humana	-	1.337.699
Illumina	-	2.057.160
Jack Henry & Associates	821.958	-
Jazz Pharmaceuticals	740.952	-
Mercedes-Benz Group	2.043.251	-
MetLife	1.280.558	1.595.632
Morgan Stanley	776.693	-
National Australia Bank	1.043.793	-
Nippon Telegraph & Telephone	-	4.175.488
NortonLifeLock	1.287.269	-
Novo Nordisk (Klasse B)	702.485	1.180.830
Owens Corning	-	1.596.695
Petroleo Brasileiro	3.421.840	-
Rio Tinto	2.135.401	-
Roche Holding	710.434	1.619.631
SK Hynix	1.459.946	-
Snowflake	1.043.915	-
Tencent Holdings	1.983.115	2.625.473
Toronto-Dominion Bank	1.473.581	1.448.899
Trimble	2.078.380	-
Umicore	-	1.754.237
Vinci	1.195.686	-
Weyerhaeuser	1.478.419	-
ZoomInfo Technologies	712.412	-

Diese Aufstellung enthält die Gesamtkäufe und -verkäufe von Anlagen, die 1 % des gesamten Kauf- und Verkaufswerts im Berichtszeitraum überschreiten, oder mindestens die 20 grössten Käufe und Verkäufe.

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

WESENTLICHE BESTANDSVERÄNDERUNGEN (Fortsetzung)

für das Halbjahr zum 30. September 2022

CT Enhanced Income Euro Equity Fund*

	Käufe Nominal** EUR	Verkäufe Nominal EUR
Adyen	-	82.742
Air Liquide	-	124.327
Airbus	-	109.238
Allianz	-	134.119
Anheuser-Busch InBev	-	82.760
ASML Holding	1.813	375.659
AXA	-	94.115
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	-	57.440
Banco Santander	-	80.588
BASF	-	75.748
Bayer	-	99.252
BNP Paribas	-	103.044
CRH	-	54.269
Danone	-	65.526
Deutsche Boerse	-	61.621
Deutsche Post	-	68.424
Deutsche Telekom	-	125.599
Enel	-	70.650
Eni	-	58.005
EssilorLuxottica	-	86.037
Hermes International	-	84.590
Iberdrola	-	121.884
Infineon Technologies	-	60.978
ING Groep	-	65.796
Intesa Sanpaolo	-	60.763
Kering	-	69.419
Koninklijke Ahold Delhaize	-	55.233
L'Oréal	-	158.412
Linde	-	274.027
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	-	321.560
Mercedes-Benz Group	-	93.499
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft	-	66.126
Pernod Ricard	-	73.942
Prosus	2.397	102.866
Safran	-	73.484
Sanofi	-	179.793
SAP	-	177.576
Schneider Electric	-	130.424
Siemens	-	149.940
Stellantis	-	58.285
TotalEnergies	-	259.055
Vinci	-	105.409
Volkswagen	-	51.303
Vonovia	1.313	-

* am 6. September 2022 geschlossen

* In der Berichtsperiode zum 30. September 2022 fanden keine weiteren Käufe statt.

Diese Aufstellung enthält die Gesamtkäufe und -verkäufe von Anlagen, die 1 % des gesamten Kauf- und Verkaufswerts im Berichtszeitraum überschreiten, oder mindestens die 20 grössten Käufe und Verkäufe.

ANHANG 1– VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN

1. Marktwert von in Wertpapierfinanzierungsgeschäften investierten Vermögenswerten zum 30. September 2022

Die nachfolgende Aufstellung zeigt, welcher Anteil des Vermögens in welche Kategorie von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („WFG“) – zu Offenlegungszwecken einschliesslich Differenzkontrakten („CFD“) und verliehenen Wertpapieren – investiert wurde, und zwar als absoluter Betrag und als Anteil am verwalteten Vermögen des Teilfonds:

Differenzkontrakte

CT European Real Estate Securities Fund	Währung	Differenzkontrakte	% des verwalteten
		In Tsd. EUR	Vermögens
	Euro	(253)	(1,02)
	Pfund Sterling	(2.599)	(10,45)
	Schwedische Krone	109	0,44
	Schweizer Franken	40	0,16
		(2.703)	(10,87)

CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	Währung	Differenzkontrakte	% des verwalteten
		in Tsd. EUR	Vermögens
	Euro	(7.346)	(1,50)
	Pfund Sterling	(10.332)	(2,16)
	Schwedische Krone	1.456	0,29
	Schweizer Franken	2.168	0,45
	US-Dollar	7.072	1,48
		(6.982)	(1,44)

Wertpapierleihgeschäfte

CT Multi-Strategy Global Equity Fund	Währung	Wertpapierleih-	% des verwalteten
		geschäfte	Vermögens
		in Tsd. EUR	
	Pfund Sterling	27	0,01
	Kanadischer Dollar	330	0,11
	Euro	255	0,08
	Japanischer Yen	7.518	2,48
		8.130	2,68

2. Die 10 wichtigsten Gegenparteien der von der Gesellschaft getätigten WFG am 30. September 2022*

In der nachfolgenden Liste sind die 10 wichtigsten Gegenparteien von WFG aufgeführt, zusammen mit dem Bruttowert der ausstehenden Geschäfte und dem Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist.

Differenzkontrakte

	Währung	Gegenpartei	Bruttowert der	Bruttowert der	Gründungs-
			ausstehenden	ausstehenden	
			Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	land
CT European Real Estate Securities Fund	£000	Goldman Sachs	393	(3.096)	USA
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	€000	Goldman Sachs	22.040	(29.022)	USA

ANHANG 1– VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)

2. Die 10 wichtigsten Gegenparteien der von der Gesellschaft getätigten WFG am 30. September 2022* (Fortsetzung)

Wertpapierleihgeschäfte

	Währung	Gegenpartei	Bruttowert der ausstehenden Vermögenswerte	Bruttowert der ausstehenden Verbindlichkeiten	Gründungsland
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	€000	Citigroup Global Markets	4.555	-	USA
	€000	HSBC Bank Plc	330	-	USA
	€000	Merrill Lynch	3.245	-	USA

* Diese Liste führt die Gegenparteien aller am 30. September 2022 gehaltenen WFG auf.

3. Abrechnung/Clearing der WFG

Bilateral.

4. Fälligkeitsprofil der WFG

Die Laufzeiten der WFG werden in die folgenden Fristigkeiten gegliedert: weniger als 1 Tag, 1 Tag bis 1 Woche, 1 Woche bis 1 Monat, 1 Monat bis 3 Monate, 3 Monate bis 1 Jahr, länger als 1 Jahr und unbegrenzte Laufzeit.

Differenzkontrakte

CT European Real Estate Securities Fund
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund

Fälligkeitsprofil

unbegrenzte Laufzeit
unbegrenzte Laufzeit

Wertpapierleihgeschäfte

CT Multi-Strategy Global Equity Fund

Fälligkeitsprofil

unbegrenzte Laufzeit

5. Fälligkeitsprofil der für WFG verpfändeten/erhaltenen Sicherheiten

Für Differenzkontrakte verpfändete Sicherheiten

	CT European Real Estate Securities Fund In Tsd. Pfund	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund In Tsd. Euro
ohne feste Laufzeit	7.515	71.491

Für Wertpapierleihgeschäfte erhaltene Sicherheiten

	CT Multi-Strategy Global Equity Fund In Tsd. Pfund
1 Woche bis 1 Monat	243
3 Monate bis 1 Jahr	19
länger als 1 Jahr	8.421

ANHANG 1– VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)

6. Aufstellung der Art, Qualität und Währung der am 30. September 2022 für WFG verpfändeten/erhaltenen Sicherheiten

Für Differenzkontrakte verpfändete Sicherheiten

	Art	Bonität	Währung
CT European Real Estate Securities Fund	Barsicherheiten	kein Rating	GBP
	Wertpapiersicherheiten	kein Rating	EUR
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	Barsicherheiten	kein Rating	EUR

Für Wertpapierleihgeschäfte erhaltene Sicherheiten

	Art	Bonität	Währung
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	Wertpapiersicherheiten	AAA	USD
	Wertpapiersicherheiten	AA+	USD
	Wertpapiersicherheiten	AA	USD
	Wertpapiersicherheiten	AA-	USD
	Wertpapiersicherheiten	A	USD
	Wertpapiersicherheiten	kein Rating	USD

7. Wiederanlage von erhaltenen Sicherheiten

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2022 fand keine Weiterverleihung von in Bezug auf Wertpapierleihgeschäfte erhaltenen Sicherheiten statt.

8. Verwahrung verpfändeter/erhaltener Sicherheiten

Die nachfolgende Tabelle enthält nähere Angaben zur Verwahrung der von den Teilfonds zugunsten der betreffenden Gegenparteien verpfändeten/von den Gegenparteien erhaltenen Sicherheiten für die von den Teilfonds getätigten WFG.

Für Differenzkontrakte verpfändete Sicherheiten

	CT European Real Estate Securities Fund In Tsd. Pfund	CT Real Estate Equity Market Neutral Fund In Tsd. Euro
Gesamtwert der verpfändeten Sicherheiten	7.515	71.491
Gegenpartei	Goldman Sachs	Goldman Sachs
auf Einzelkonten gehaltener Anteil	-	-
auf Sammelkonten gehaltener Anteil	4.983	16.491
auf anderen Konten gehaltener Anteil	2.532	55.000
Total	7.515	71.491

Für Wertpapierleihgeschäfte erhaltene Sicherheiten

	CT Multi-Strategy Global Equity Fund In Tsd. Euro
Verwahrstelle der Sicherheit	
Citigroup	4.815
Merrill Lynch	3.516
HSBC Bank Plc	352
Total	8.683

ANHANG 1– VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (Fortsetzung)

8. Verwahrung verpfändeter/erhaltener Sicherheiten (Fortsetzung)

Für Wertpapierleihgeschäfte erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)

	CT Multi- Strategy Global Equity Fund In Tsd. Euro
Emittenten der als Sicherheiten erhaltenen Anleihen	
Österreich	–
Belgien	795
Kanada	–
Finnland	–
Frankreich	3.829
Deutschland	849
Niederlande	320
Schweden	26
Vereinigtes Königreich	838
Vereinigte Staaten von Amerika	2.025
Total	8.683

9. Erträge und Kosten von WFG

Differenzkontrakte

	Währung	Gewinne/ (Verluste)*	Angefallene Kosten**	Nettorendite
CT European Real Estate Securities Fund	in Tsd. EUR	(1.561)	–	(1.561)
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund	in Tsd. EUR	76.516	–	76.516

Wertpapierleihgeschäfte

	Währung	Gewinne/ (Verluste)*	Angefallene Kosten**	Nettoertrag
CT Multi-Strategy Global Equity Fund	in Tsd. EUR	17	–	17

* Der Nettobetrag aus gezahlten und erhaltenen Zinsen ist in den realisierten Gewinnen/(Verlusten) enthalten.

** Die in Verbindung mit WFG anfallenden Kosten können nicht separat ermittelt und im Abschluss ausgewiesen werden.

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die Angaben in diesem Abschnitt sind selektiv und sollten in Verbindung mit dem Verkaufsprospekt gelesen werden.

Informationen zur Gesellschaft

Die Teilfonds werden an jedem Handelstag bewertet, und Anteile können normalerweise auf Antrag an einem Handelstag gekauft oder veräußert werden. Handelstage sind jeder Geschäftstag und/oder sonstige vom Verwaltungsrat gegebenenfalls festgelegten Tage. Ein Geschäftstag ist jeder Tag, der kein Samstag oder Sonntag ist, an dem Banken sowohl in Dublin als auch in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Bei allen Teilfonds sind öffentliche Feiertage eines Landes, durch welche die Bewertung eines Grossteils der im Teilfonds gehaltenen Vermögenswerte aufgrund geschlossener lokaler Wertpapierbörsen und -märkte erschwert wird, keine Handelstage. Ausserdem können an den folgenden Geschäftstagen keine Anteile gezeichnet werden: Gründonnerstag, der Freitag vor Heiligabend, wenn Heiligabend in dem betreffenden Geschäftsjahr auf einen Samstag oder Sonntag fällt, Heiligabend in jedem Jahr.

Bei der Zeichnung von Anteilen aller Teilfonds wird ein Ausgabeaufschlag von bis zu 5 % des Nettoinventarwerts pro Anteil erhoben. Die Gesellschaft erhebt keinerlei Rücknahmegebühren.

Informationen für Anleger in Norwegen und der Schweiz

In Anbetracht einer Empfehlung der EU-Kommission hat der norwegische Investmentfonds-Verband (NMFA) einen neuen Abschnitt in seine Branchenstandards eingefügt. Die Branchenstandards enthalten jetzt Vorschriften für die halbjährliche Veröffentlichung der Gesamtkostenquote (TER) von Teilfonds.

Carnegie Fund Services S.A., 11, Rue du Général-Dufour, 1204 Genf, Schweiz, wurde zum Vertreter in der Schweiz und die Banque Cantonale de Genève, Quai de l'Île 17, Postfach 2251, 1211 Genf 2, Schweiz, zur Schweizer Zahlstelle bestellt.

Der Verkaufsprospekt, die Satzung, der Jahres- und der Halbjahresbericht sowie eine Aufstellung aller Käufe und Verkäufe während der Berichtsperiode können kostenlos beim Vertreter in der Schweiz bezogen werden.

Die Gesellschaft muss Performancedaten in Übereinstimmung mit der Transparenzrichtlinie der Asset Management Association Switzerland („AMAS“) vom 27. Juli 2004 bereitstellen. Diese Daten sind nachfolgend aufgeführt.

Gesamtkostenquoten für den Berichtszeitraum zum 30. September 2022

		TER
	ohne Performance- gebühr	inkl. Performance- gebühr
CT European Real Estate Securities Fund		
Thesaurierende EUR-Klasse A	2,08%	2,08%
Thesaurierende NOK-Klasse A	2,07%	2,07%
Thesaurierende GBP-Klasse A	2,05%	2,05%
Ausschüttende GBP-Klasse A	2,04%	2,04%
Thesaurierende EUR-Klasse B	1,58%	1,58%
Thesaurierende GBP-Klasse	1,53%	1,53%
Ausschüttende GBP-Klasse C	1,55%	1,55%
Thesaurierende GBP-Klasse D	1,20%	1,20%
CT Real Estate Equity Market Neutral Fund		
Thesaurierende EUR-Klasse A	1,99%	1,99%
Thesaurierende SEK-Klasse A	1,99%	1,99%
Thesaurierende USD-Klasse A	2,02%	2,02%
Thesaurierende EUR-Klasse B	1,24%	1,24%
Thesaurierende GBP-Klasse C	1,27%	1,27%
CT Multi-Strategy Global Equity Fund		
Thesaurierende EUR-Klasse F	0,53%	0,53%

Columbia Threadneedle (Irl) III plc (vormals BMO Investments III (Ireland) plc)

ANFRAGEN

Weitere Auskünfte erhalten Sie vom Columbia Threadneedle Management Limited Sales Support Team:

**Thames River Capital LLP
Exchange House
Primrose Street
London EC2A 2NY
Vereinigtes Königreich**

Columbia Threadneedle Management Limited
Exchange House
Primrose Street
London EC2A 2NY
Vereinigtes Königreich

Tel: +44 (0)20 7464 5667

Fax: +44 (0)20 7628 8118

E-Mail: client.service@columbiathreadneedle.com

Website: www.columbiathreadneedle.com

Die Thames River Capital LLP und die Columbia Threadneedle Management Limited sind von der Financial Conduct Authority zugelassen und unterstehen deren Aufsicht.

Anteilshandel
State Street Fund Services (Ireland) Limited
Tel: +353 (0) 1 242 5529

Kundendienst
Columbia Threadneedle Management
Limited Tel: +44 (0) 20 7011 4444



©2022 Columbia Threadneedle Management. Columbia Threadneedle Management ist ein eingetragener Handelsname für mehrere Tochtergesellschaften von Columbia Threadneedle Management (EMEA), die Anlageverwaltungsdienstleistungen erbringen, institutionelle Kunden betreuen und Sicherheitsprodukte zur Verfügung stellen. Werbung für Finanzprodukte zu Marketing- und Informationszwecken wird im Vereinigten Königreich von Columbia Threadneedle Management Limited, die von der Financial Conduct Authority zugelassen ist und deren Aufsicht untersteht, herausgegeben; in der EU von BMO Asset Management Netherlands B.V., die der Aufsicht der niederländischen Finanzmarktbehörde (AFM) untersteht; und in der Schweiz von BMO Global Asset Management (Swiss) GmbH als Vertretung von Columbia Threadneedle Management Limited. Diese Unternehmen sind hundertprozentige Tochtergesellschaften von Columbia Threadneedle Investments UK International Limited, deren direkter Mutterkonzern die in den USA gegründete Ameriprise Inc. ist. Vormalig gehörten sie zur CT Financial Group und verwenden gegenwärtig die Marke „CT“ unter Lizenz.