

## **Zusammenfassung der Angaben auf der Webseite**

**Ein Fondssegment, dass durch Investitionen in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautende Investment-Grade-Unternehmensanleihen eine langfristige Gesamtrendite erzielt und gleichzeitig ESG-Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung fördert. Referenzwert zur Messung der ESG Merkmale: Markit iBoxx EUR Corporates TR Index**

### **Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozialen Merkmale des Finanzprodukts**

Es werden mit dem Fondssegment ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.

### **Ökologische oder soziale Merkmale des Finanzprodukts**

Das Fondssegment investiert überwiegend in Vermögensgegenstände die unter nachhaltigen Gesichtspunkten ausgewählt wurden. Unter Nachhaltigkeit versteht man ökologische (Environment – E) und soziale (Social – S) Kriterien sowie gute Unternehmens- und Staatsführung (Governance – G). Entsprechende Kriterien sind unter anderem CO<sub>2</sub>-Emissionen, Schutz der natürlichen Ressourcen, der Biodiversität und der Gewässer (Umwelt), Maßnahmen zur Korruptionsbekämpfung, Steuertransparenz (Unternehmensführung) sowie Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz (Soziales). Bei der Berücksichtigung ökologischer und sozialer Merkmale investiert die Gesellschaft in Vermögensgegenstände von Emittenten, die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Der **Markit iBoxx EUR Corporates TR Index** (Referenzwert) wird zur Messung des ESG-Ratings und der Kohlenstoffgasintensität des Fondssegments verwendet – berechnet als gewichteter Durchschnitt der ESG-Ratings bzw. der Kohlenstoffintensität der Anlagen des Fondssegments im Verhältnis zum gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Bei dem Referenzwert handelt es sich um einen breiten Marktindex, nicht jedoch um einen ESG-Index. Für das Fondssegment wird kein konkreter ESG-Index als ESG-Referenzwert festgelegt.

### **Anlagestrategie**

Die Strategie des Fondssegments ist es, durch Investitionen in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautende Investment-Grade-Unternehmensanleihen eine langfristige Gesamtrendite zu erzielen und gleichzeitig ESG-Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung zu fördern. Hierzu wird in eine Vielzahl von Wertpapieren investiert, darunter unter anderem, aber nicht beschränkt auf fest und variabel verzinsliche Wertpapiere, vorrangige und nachrangige Wertpapiere, endfällige Wertpapiere, rückkaufbare und unbefristete Wertpapiere, die auf EUR lauten oder in EUR abgesichert sind. Darüber hinaus kann das Fondssegment zur Erreichung ihrer Investitions- und Risikoziele sowohl Zins- als auch Kreditderivate einsetzen. Das Fondssegment strebt ein besseres ESG-Rating und eine geringere Kohlenstoffintensität als der Referenzwert (Markit iBoxx EUR Corporates TR Index) an, berechnet als gewichteter Durchschnitt der ESG Ratings und der Kohlenstoffintensität der Unternehmensanleihen des Fondssegments im Geschäftsjahr im Vergleich zu dem gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts im Geschäftsjahr. Hierzu berücksichtigt die HSBC AM, nach Anwendung von Ausschlusskriterien, die ESG-Daten der Unternehmen als festen Bestandteil des Entscheidungsprozesses für Investitionen.

### **Aufteilung der Investitionen**

Das Fondssegment bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale, verpflichtet sich aber nicht zu einem Mindestprozentsatz an nachhaltigen Investitionen. Es wird einen Mindestanteil von 51 % an Investitionen halten, die auf die von dem Segment beworbene ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind. Die sonstigen Investitionen umfassen liquide Mittel (zusätzliche liquide Mittel, Bankguthaben, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds, sowie derivative Finanzinstrumente).

### **Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale**

Das Segment muss starke und/oder sich verbessernde ESG-Merkmale auf Emittenten- und Gesamtportfolioebene aufweisen. Diese Kriterien können quantitativ oder qualitativ sein und werden laufend überwacht. HSBC Asset Management führt sowohl auf Emittenten- als auch auf Gesamtportfolioebene eine kontinuierliche Überwachung des Segments durch. Emittenten mit ESG-Risikoscores, die eine gezielte Überprüfung erfordern, werden in einem internen

Version 1

Stand: 02.02.2026

Zuletzt aktualisiert: 02.02.2026

Governance-Forum bewertet. Das Fondssegment wird über ein ESG-Dashboard überwacht, um sicherzustellen, dass die Portfolios an den intern festgelegten Schwellenwerten ausgerichtet sind (z. B. durchschnittlicher ESG-Score des Portfolios, Ausschlüsse, verstärkte Due Diligence-Prüfung usw.).

## Methoden

Ein Mindestanteil der Investitionen des Segments muss bestimmte ESG-Standards erfüllen, die anhand eines Mindest-ESG-Gesamtscores sowie Mindest-E-, S- und G-Scores für jede einzelne Teilkomponente gemessen werden. Diese Bewertungen stellen das Management von ESG-Risiken oder -Chancen dar, die für den Sektor relevant sind, in dem der Emittent tätig ist. Bei den Emittenten mit sehr niedrigen Scores wird davon ausgegangen, dass sie ein schlechtes Management der ESG-Risiken und -Chancen aufweisen und sie werden daher vom Beitrag zur Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale des Segments ausgeschlossen.

## Datenquellen und -verarbeitung

HSBC Asset Management nutzt Daten von mehreren externen Drittparteien wie Sustainalytics, ISS, MSCI und Trucost, um sicherzustellen, dass die beworbenen ökologischen Merkmale erfüllt werden. HSBC Asset Management nutzt außerdem eine Reihe von ESG-Ratingagenturen für ein normenbasiertes Screening anhand der UNGC-Grundsätze. Die Daten werden von der umfassenden Research-Abteilung von HSBC Asset Management verifiziert und mithilfe der eigenen Research-Methode von HSBC Asset Management verarbeitet. HSBC Asset Management ist auf die Daten Dritter angewiesen, und obwohl wir die Daten überprüfen, können wir uns nicht zu Einschränkungen in Bezug auf die Methodik dieser Drittunternehmen äußern. HSBC Asset Management wendet keine Schätzung von Daten an.

## Einschränkungen bei Methoden und Daten

HSBC Asset Management ist keine Beschränkung bezüglich des Erreichens der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds bekannt.

## Sorgfaltspflicht

Investitionen in dem Segment werden unter Berücksichtigung der UNGC-Grundsätze auf ein Mindestmaß an guten Unternehmensführungspraktiken hin überprüft. Darüber hinaus werden gute Unternehmensführungspraktiken von Emittenten anhand von ESG- und G-Säulen-Scores geprüft. Investitionen, die als nachhaltige Investitionen angesehen werden, müssen eine zusätzliche Prüfung auf gute Unternehmensführung durchlaufen, bevor sie als solche bezeichnet werden können. Die Unternehmensführung wird anhand der im Anlageprozess festgelegten Kriterien beurteilt, unter anderem bezüglich Geschäftsethik, Kultur und Werten, Unternehmensführung sowie Bestechung und Korruption. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze werden durch eine ESG-Sorgfaltsprüfung sowie durch Screening-Verfahren beurteilt, die zur Identifizierung von Emittenten verwendet werden, von denen angenommen wird, dass sie eine schlechte Unternehmensführung aufweisen. Emittenten, die die Kriterien für nachhaltige Investitionen erfüllen, werden anhand von Mindest-Scores für die Unternehmensführung bewertet, um sicherzustellen, dass sie höhere Unternehmensführungsstandards erfüllen und nicht mit schweren Kontroversen in Verbindung gebracht werden. Sofern relevant, werden diese Emittenten dann einer weiteren Überprüfung, weiteren Maßnahmen und/oder einem weiteren Dialog unterzogen.

## Mitwirkungspolitik

Das Stewardship-Team von HSBC trifft sich regelmäßig mit Emittenten und Unternehmen, um das Verständnis von HSBC von deren Geschäft und deren Strategie zu verbessern, Unterstützung oder Bedenken bezüglich der Managementmaßnahmen zu signalisieren und Best Practices zu fördern. HSBC ist der Ansicht, dass eine gute Unternehmensführung sicherstellt, dass Emittenten und Unternehmen im Einklang mit den langfristigen Interessen ihrer Anleger verwaltet werden.

## Bestimmter Referenzwert

Der Markit iBoxx EUR Corporates TR Index (Referenzwert) wird zur Messung des ESG-Ratings und der Kohlenstoffgasintensität des Fondssegments verwendet – berechnet als gewichteter Durchschnitt der ESG-Ratings bzw. der Kohlenstoffintensität der Anlagen des Fondssegments im Verhältnis zum gewichteten Durchschnitt der Bestandteile des Referenzwerts. Bei dem Referenzwert handelt es sich um einen breiten Marktindex, nicht jedoch um einen ESG-Index. Für das Fondssegment wird kein konkreter ESG-Index als ESG-Referenzwert festgelegt.