

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

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

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

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

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

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

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

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0,00 % an nachhaltigen Investitionen

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

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



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

Durch die Nachbildung der Wertentwicklung des Bloomberg Euro Treasury 1-3 Year Carbon Tilted Index (der „Index“) bewirbt der Teilfonds das folgende ökologische und/oder soziale Merkmal:

- Unterstützung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch die angestrebte Verbesserung des CO₂-Emissionsprofils gegenüber jenem des Bloomberg Euro Aggregate Treasury 1-3 Year Index (der „Hauptindex“).

Der Teilfonds ist bestrebt, dieses Merkmal zu bewerben, indem er die Wertentwicklung des Index nachbildet, der einen CO₂-Tilt zu Ländern mit einem niedrigeren CO₂-Ausstoß pro Kopf im Vergleich zum Hauptindex aufweist. Der Index wendet CO₂-Tilts an, um ein verbessertes CO₂-Profil gegenüber dem Hauptindex zu erreichen, und beschränkt ein übermäßiges Engagement in kleinen Märkten mit begrenzter Liquidität. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden für jedes Land bzw. jede Region unabhängig vom Indexuniversum anhand einer logistischen Funktion berechnet. Bei der Funktion wird der „Intensitätswert pro Kopf“ berücksichtigt, ein Wert zwischen 0 und 10, der sich aus der Normalisierung des CO₂-Ausstoßes pro Kopf ergibt. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden zur Festlegung der endgültigen Indexgewichtungen verwendet.

Der Index wurde als Referenzwert für die Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

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

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

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

Der nachstehend angegebene Nachhaltigkeitsindikator wird verwendet, um die Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen, wobei insbesondere Folgendes gemessen wird:

- der CO₂-Ausstoß pro Kopf des Teilfonds im Vergleich zum Hauptindex, der CO₂-Ausstoß pro Kopf des Teilfonds voraussichtlich unter dem des Hauptindex liegen wird.

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

Nicht zutreffend.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.

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

Nicht zutreffend.

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

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

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



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

- Ja, das Universum der in Frage kommenden Bestandteile wendet einen CO₂-Tilt an, der das Engagement in Bezug auf die Treibhausgasintensität (PAI 15) der Länder, in die investiert wird, und letztlich das Engagement in fossilen Brennstoffen reduzieren soll.

Optionale Indikatoren werden nicht berücksichtigt.

- Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Teilfonds wird passiv verwaltet und ist bestrebt, die Wertentwicklung des Index nachzubilden und dabei den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und jener des Index so weit wie möglich zu minimieren und ökologische und soziale Merkmale im

Sinne von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung zu bewerben. Der Teilfonds setzt Optimierungstechniken ein, die bei der Zusammenstellung des Portfolios den Tracking Error, Handelskosten und die Verfügbarkeit von Indexbestandteilen berücksichtigen. Weitere Einzelheiten zur Optimierung sind im Abschnitt „Anlagetechniken“ des Prospekts dargelegt.

Der Index besteht aus festverzinslichen Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating aus Mitgliedstaaten der Europäischen Union, die auch an der Europäischen Währungsunion teilnehmen. Der Index enthält nur Wertpapiere mit Laufzeiten zwischen 1 und 3 Jahren. Der Index strebt eine Verbesserung der CO₂-Emissionen gegenüber dem Bloomberg Euro Aggregate Treasury 1-3 Year Index (der „Hauptindex“) an. Die Währung des Index ist EUR und die Renditen sind nicht abgesichert. Der Index wird anhand der Gesamrendite gemessen, ist marktwertgewichtet und wird monatlich neu gewichtet.

Der Index basiert auf der Indexmethodik von Bloomberg, die auf der Grundlage mehrerer grundlegender Gestaltungsgrundsätze Zulassungskriterien anwendet (nämlich Wertpapiere, die den Markt repräsentieren und replizierbar, relevant, objektiv und transparent sind), die darauf ausgelegt sind, die zugrunde liegenden Indexbestandteile genau und umfassend zu messen. Der Index wird außer an Feiertagen täglich unter Verwendung des von Bloomberg evaluierten Preissystems (Bloomberg Valuation [BVAL]), bei dem bestimmte Wertpapiere von Drittanbietern bewertet werden, bewertet.

Der Index wendet auch einen CO₂-Tilt zugunsten von Ländern an, die im Vergleich zum Hauptindex einen niedrigeren CO₂-Ausstoß pro Kopf aufweisen. Der Index wendet CO₂-Tilts an, um ein verbessertes CO₂-Profil gegenüber dem Hauptindex zu erreichen, und beschränkt ein übermäßiges Engagement in kleinen Märkten mit begrenzter Liquidität. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden für jedes Land bzw. jede Region unabhängig vom Indexuniversum anhand einer logistischen Funktion berechnet. Bei der Funktion wird der „Intensitätswert pro Kopf“ für jedes Land berücksichtigt, ein Wert zwischen 0 und 10, der sich aus der Normalisierung des CO₂-Ausstoßes pro Kopf ergibt. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden zur Festlegung der endgültigen Indexgewichtungen verwendet.

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

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

Das verbindliche Element der Anlagestrategie besteht darin, die Wertentwicklung des Index nachzubilden und gleichzeitig den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Teilfonds und des Index soweit wie möglich zu minimieren.

Bei der Nachbildung der Wertentwicklung des Index wird die Indexmethodik verbindlich auf den Aufbau des Portfolios des Teilfonds angewendet, so dass:

1. die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, aus festverzinslichen Staatsanleihen mit Investment Grade von Mitgliedstaaten der Europäischen Union, die auch an der Europäischen Währungsunion teilnehmen, bestehen und nur Wertpapiere mit Laufzeiten zwischen 1 und 3 Jahren umfassen. Der Teilfonds strebt eine Verbesserung der CO₂-Emissionen gegenüber dem Bloomberg Euro Aggregate Treasury 1-3 Year Bond Index (der „Hauptindex“) an.
2. Die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, werden vom Indexanbieter gemäß der Indexmethodik von Bloomberg ausgewählt, die Zulassungskriterien auf der Grundlage mehrerer grundlegender Gestaltungsgrundsätze anwendet (nämlich Wertpapiere, die den Markt repräsentieren und replizierbar, relevant, objektiv und transparent sind). Diese sind darauf ausgelegt, die zugrunde liegenden Indexbestandteile genau und umfassend zu messen.
3. Die Wertpapiere, in die der Teilfonds investiert, haben einen vom Indexanbieter angewandten CO₂-Tilt zu Ländern mit einem niedrigeren CO₂-Ausstoß pro Kopf, um ein verbessertes CO₂-Profil gegenüber dem Hauptindex zu erreichen, wobei gleichzeitig ein übermäßiges Engagement in kleinen Märkten mit begrenzter Liquidität beschränkt wird. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden für jedes Land bzw. jede Region unabhängig vom Indexuniversum anhand einer logistischen Funktion berechnet. Bei der Funktion wird der „Intensitätswert pro Kopf“ für jedes Land berücksichtigt, ein Wert zwischen 0 und 10, der sich aus der Normalisierung des CO₂-Ausstoßes pro Kopf ergibt. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden zur Festlegung der endgültigen Indexgewichtungen verwendet.

Weitere Informationen zur Indexmethodik sind auf der Website des Indexanbieters verfügbar, die im Abschnitt „Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?“ in diesem Dokument angegeben ist.

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

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

Der Teilfonds verfügt über keinen verbindlichen Mindestsatz, um den Umfang der Investitionen zu reduzieren.

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

Nicht zutreffend, da der Teilfonds in staatliche Schuldtitel und nicht in Unternehmen investiert.



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

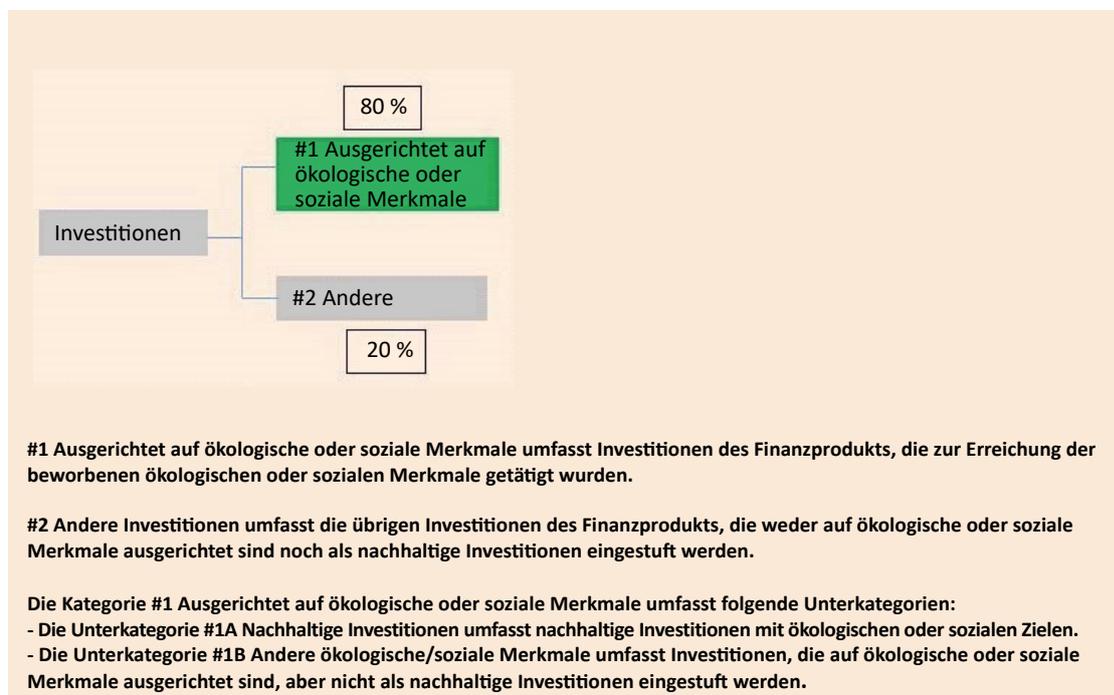
Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Um seine Anlageziele zu erreichen, strebt der Fonds Anlagen in den Bestandteilen des Index an, die in der Regel den Verhältnissen entsprechen, in denen sie im Index enthalten sind. Daher werden voraussichtlich mindestens 80 % des Fondsvermögens entweder in Wertpapiere innerhalb des Index oder in Wertpapiere, die die ESG-Kriterien des Index erfüllen („#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale“), investiert. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Vermögens in anderen Investitionen anlegen („#2 Andere Investitionen“).

Bei jeder Indexneugewichtung wird das Portfolio des Fonds entsprechend dem Index neu gewichtet, so dass mindestens 80 % des Fondsvermögens den ESG-Kriterien des Index entsprechen. Der Teilfonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale, strebt jedoch keine nachhaltigen Investitionen an.

Taxonomie konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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



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

Der Teilfonds verwendet keine Derivate, um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Teilfonds zu erreichen.



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

N. z. Der Teilfonds beabsichtigt nicht, sich zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel zu verpflichten, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**¹

- Ja In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

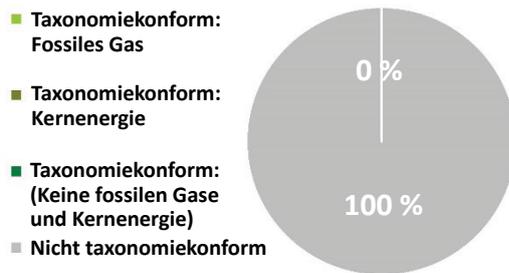
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten

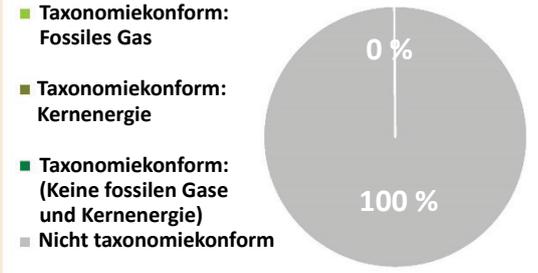
wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder

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

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

N. z.

Übergangstätigkeiten

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



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

N. z.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

N. z.



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



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

Barmittel und andere Instrumente wie zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen und/oder derivative Finanzinstrumente können zu Liquiditätszwecken, zur Absicherung und für eine effiziente Portfolioverwaltung eingesetzt werden. Für diese gibt es keinen ökologischen und/oder sozialen Mindestschutz.



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

Ja.

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des Bloomberg Euro Treasury 1-3 Year Carbon Tiltet Index nachzubilden

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

Der Referenzwert ist kontinuierlich auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet, indem er den CO₂-Tilt-Faktor für alle Emittenten innerhalb des Index anwendet, der einen Tilt zu Ländern mit einem niedrigeren CO₂-Ausstoß pro Kopf im Vergleich zum Hauptindex ermöglicht.

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

Um seine Investitionsziele zu erreichen, strebt der Teilfonds Anlagen in den Bestandteilen des Index an, die in der Regel den Verhältnissen entsprechen, in denen sie im Index enthalten sind. Die Zusammensetzung des Index wird monatlich neu ausgerichtet und erfolgt gemäß den von Bloomberg festgelegten, veröffentlichten Regeln zum Management des Index.

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

Der Index besteht aus festverzinslichen Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating aus Mitgliedstaaten der Europäischen Union, die auch an der Europäischen Währungsunion teilnehmen. Der Index enthält nur Wertpapiere mit Laufzeiten zwischen 1 und 3 Jahren. Der Index strebt eine Verbesserung der CO₂-Emissionen gegenüber dem Bloomberg Euro Aggregate Treasury 1-3 Year Index (der „Hauptindex“) an. Die Währung des Index ist EUR und die Renditen sind nicht abgesichert. Der Index wird anhand der Gesamrendite gemessen, ist marktwertgewichtet und wird monatlich neu gewichtet.

Der Index basiert auf der Indexmethodik von Bloomberg, die auf der Grundlage mehrerer grundlegender Gestaltungsgrundsätze Zulassungskriterien anwendet (nämlich Wertpapiere, die den Markt repräsentieren und replizierbar, relevant, objektiv und transparent sind), die darauf ausgelegt sind, die zugrunde liegenden Indexbestandteile genau und umfassend zu messen. Der Index wird außer an Feiertagen täglich unter Verwendung des von Bloomberg evaluierten Preissystems (Bloomberg Valuation [BVAL]), bei dem bestimmte Wertpapiere von Drittanbietern bewertet werden, bewertet.

Der Index wendet auch einen CO₂-Tilt zugunsten von Ländern an, die im Vergleich zum Hauptindex einen niedrigeren CO₂-Ausstoß pro Kopf aufweisen. Der Index wendet CO₂-Tilts an, um ein verbessertes CO₂-Profil gegenüber dem Hauptindex zu erreichen, und beschränkt ein übermäßiges Engagement in kleinen Märkten mit begrenzter Liquidität. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden für jedes Land bzw. jede Region unabhängig vom Indexuniversum anhand einer logistischen Funktion berechnet. Bei der Funktion

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

wird der „Intensitätswert pro Kopf“ für jedes Land berücksichtigt, ein Wert zwischen 0 und 10, der sich aus der Normalisierung des CO₂-Ausstoßes pro Kopf ergibt. Die CO₂-Tilt-Faktoren werden zur Festlegung der endgültigen Indexgewichtungen verwendet.

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

<https://www.bloomberg.com/professional/products/indices/fixed-income/>

Die Indexmethodik kann von Zeit zu Zeit vom Indexanbieter geändert werden. Informationen zur Indexmethodik sind auf der oben angegebenen Website verfügbar.



Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen zu diesem und allen anderen HSBC-Fonds finden Sie auf der Website. Gehen Sie zu www.assetmanagement.hsbc.com und wählen Sie Ihren Anlegertyp sowie Ihr Land/Ihren Standort aus. Bitte wählen Sie auf der Hauptnavigationsseite „Fonds“ aus, wo Sie mithilfe der Such- oder Filterfunktionen Ihren gewünschten Fonds finden.