



HSBC Global Funds ICAV - Multi-Factor Worldwide Equity Fund

Der Anlageverwalter prüft alle obligatorischen SFDR-Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, um zu beurteilen, ob sie für den Teilfonds relevant sind; diejenigen, die nicht als anwendbar angesehen werden, sind nicht Teil des eigenen systematischen Anlageprozesses. Die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren legt fest, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC ESG-Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Teilfonds investiert. HSBC identifiziert in Zusammenarbeit mit externen Screening-Dienstleistern Unternehmen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken.

Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen einschließlich der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bilden einen Schlüsselfaktor beim Anlageentscheidungsprozess und unterstützen somit auch die Beratung der Kunden.

Der oben beschriebene Ansatz führt dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft werden:

- das Engagement der Unternehmen für den Übergang zu kohlenstoffarmen Wirtschaften,
- die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern,
- die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüft, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern.

HSBC legt darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Corporate Governance und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Verwaltungsrats, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails.

Der Teilfonds bewirbt die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale:

1. Aktive Berücksichtigung von Investitionen mit geringer CO₂-Intensität im Vergleich zum Performance-Referenzindex.
2. Verantwortungsvolle Geschäftspraktiken in Übereinstimmung mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen.
3. Ökologische Mindeststandards durch den Ausschluss von umweltschädlichen Geschäftsaktivitäten.
4. Aktive Berücksichtigung von Umweltthemen durch Mitwirkung und Stimmrechtsausübung.
5. Ausschluss von umstrittenen Waffen und anderen ausgeschlossenen Aktivitäten.

Anlagestrategie und Aufteilung der Investitionen:

Das optimierte Portfolio strebt eine niedrigere CO₂-Intensität und einen höheren ESG-Score (jeweils berechnet als gewichteter Durchschnitt der CO₂-Intensitäten und ESG-

Scores der Anlagen des Teilfonds) an, als der gewichtete Durchschnitt der Bestandteile des Performance-Referenzindex. Der Performance-Referenzindex wird zur Messung der Kohlenstoffintensität und der ESG-Scores des Teilfonds verwendet, dient jedoch nicht als Referenzwert für die Erreichung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Teilfonds.

Der Anlageverwalter nutzt ein proprietäres, systematisches Anlageverfahren, um ein Portfolio aufzubauen, das sich auf die Risikoprämien im Rahmen eines Engagements in Faktoren wie Value, Qualität, Momentum, geringem Risiko und Größe konzentriert.

Im Anschluss an die Identifizierung und Einstufung des Anlageuniversums auf der Grundlage der vorstehenden Faktoren nutzt der Anlageverwalter ein HSBC-spezifisches systematisches Portfoliokonstruktionsverfahren, um ein optimiertes Portfolio zu erstellen.

Um das Engagement in Unternehmen mit hohem CO₂-Ausstoß zu verringern und den ESG-Score des Teilfonds zu verbessern, werden alle Positionen im Portfolio nach ihrer individuellen Kohlenstoffintensität und ihren ESG-Scores bewertet.

Methoden:

Das ESG-Datenteam von HSBC Asset Management nutzt seine eigenen Daten zur Erstellung interner ESG-Berichte, um sicherzustellen, dass die in der Produktmethodik verankerten nachhaltigen Ziele und Vorgaben sowie die zu deren Messung verwendeten Indikatoren erfüllt werden. Anhand dieser Daten führt HSBC Asset Management regelmäßige Überprüfungen mit dem jeweiligen Indexpartner durch, um die Richtigkeit der bereitgestellten Daten sicherzustellen.

Eine gute Unternehmensführung ist schon seit Langem Teil der unternehmenseigenen Fundamentaldatenanalyse von HSBC Asset Management. Das Stewardship-Team von HSBC Asset Management trifft sich regelmäßig mit Unternehmen, um unser Verständnis für ihr Geschäft und ihre Strategie zu verbessern, Unterstützung oder Bedenken bezüglich der Managementmaßnahmen zu signalisieren und Best Practices zu fördern. HSBC Asset Management ist der Ansicht, dass eine gute Unternehmensführung sicherstellt, dass Unternehmen im Einklang mit den langfristigen Interessen ihrer Anleger verwaltet werden.

Die Richtlinien von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren, unsere Mitwirkungspolitik und unseren Stewardship-Plan finden Sie unter www.assetmanagement.hsbc/responsible-investing/policies.