

Die Gesellschaft und die im Abschnitt „**Management und Verwaltung**“ des Prospekts genannten Verwaltungsratsmitglieder von HSBC ETFs PLC (der „**Verwaltungsrat**“) übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen. Nach bestem Wissen und Gewissen der Gesellschaft und des Verwaltungsrats (der mit angemessener Sorgfalt sichergestellt hat, dass dies der Fall ist) entsprechen die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen den Tatsachen und lassen keine Angaben aus, die die Bedeutung dieser Informationen beeinflussen könnten. Die Gesellschaft und der Verwaltungsrat übernehmen die entsprechende Verantwortung.

HSBC NASDAQ GLOBAL CLIMATE TECH UCITS ETF

(Ein Teilfonds von HSBC ETFs PLC, ein von der irischen Zentralbank gemäß den European Communities [Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities] Regulations von 2011 in der jeweils gültigen Fassung zugelassener Umbrellafonds mit getrennter Haftung der Teilfonds.)

30. April 2025

Der vorliegende Nachtrag ist für die Zwecke der OGAW-Verordnungen Bestandteil des Prospekts. Sofern nicht anders in diesem Nachtrag angegeben, haben alle hierin enthaltenen Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt. Dieser Nachtrag sollte zusammen und in Verbindung mit dem Prospekt gelesen werden und enthält Informationen zum HSBC NASDAQ GLOBAL CLIMATE TECH UCITS ETF (der „Fonds“), einem separaten Teilfonds der Gesellschaft, dem die HSBC NASDAQ GLOBAL CLIMATE TECH UCITS ETF-Anteile der Gesellschaft (die „Anteile“) entsprechen. In Anhang A finden Sie eine Liste der anderen Teilfonds der Gesellschaft, in Anhang B eine Liste der von der Verwaltungsgesellschaft ernannten Zahlstellen und in Anhang C eine Liste der von der Verwahrstelle ernannten Unterverwahrstellen.

Interessierte Anleger sollten diesen Nachtrag und den Prospekt sorgfältig und vollständig durchlesen. Interessierte Anleger sollten in Bezug auf folgende Aspekte einen Börsenmakler, Bankberater, Anwalt, Steuerberater oder sonstigen Finanzberater konsultieren: (a) die Rechtsvorschriften in ihrem eigenen Land für den Kauf, Besitz, Umtausch, die Rücknahme oder Veräußerung von Anteilen; (b) die Devisenbeschränkungen, denen sie in ihrem Land hinsichtlich des Kaufs, Besitzes, Umtauschs, der Rücknahme oder Veräußerung von Anteilen unterliegen; (c) die rechtlichen, steuerlichen, finanziellen oder sonstigen Folgen des Kaufs, Besitzes, Umtauschs, der Rücknahme oder Veräußerung von Anteilen; und (d) die Bestimmungen dieses Nachtrags und des Prospekts.

Interessierte Anleger sollten vor der Anlage in diesen Fonds die im Prospekt und in diesem Fondsnachtrag dargelegten Risikofaktoren berücksichtigen. Eine Anlage in dem Fonds sollte keinen erheblichen Teil eines Portfolios ausmachen und ist eventuell nicht für alle Anleger geeignet.

Potenzielle Anleger sollten den Anhang zu diesem Fondsnachtrag bezüglich der ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds lesen.

Anleger sollten beachten, dass bei Barzahlung eventuell eine Direkthandelsgebühr (Bartransaktionsgebühr) von bis zu 3 % der Zeichnungs- und Rücknahmebeträge anfällt, wenn Anteile direkt mit dem Fonds gehandelt werden.

Der Fonds wird nicht von der Nasdaq Inc. oder ihren Tochtergesellschaften (Nasdaq und ihre Tochtergesellschaften werden zusammen als „Unternehmen“ bezeichnet) gesponsert, unterstützt, verkauft oder gefördert. Die Unternehmen haben die Rechtmäßigkeit oder Eignung sowie die Richtigkeit oder Angemessenheit der Beschreibungen und Angaben im Zusammenhang mit dem Fonds nicht geprüft. Die Unternehmen geben weder gegenüber den Inhabern des Fonds noch gegenüber der Öffentlichkeit, weder ausdrücklich noch stillschweigend, eine Garantie dafür oder machen eine Zusage dahingehend, dass eine Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder dem Fonds im Besonderen empfehlenswert oder dass der Nasdaq CTA Global Climate Technology Index geeignet ist, die Performance der allgemeinen Aktienmärkte abzubilden. Die einzige Beziehung der

Unternehmen zu HSBC Global Asset Management Limited („Lizenznehmer“) liegt in der Lizenzierung der Nasdaq®- und bestimmter Handelsnamen der Unternehmen und der Nutzung des Nasdaq CTA Global Climate Technology Index, der von der Nasdaq ohne Berücksichtigung des Lizenznehmers oder des Fonds festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Nasdaq ist nicht verpflichtet, die Belange des Lizenznehmers oder der Inhaber des Fonds bei der Bestimmung, Zusammensetzung oder Berechnung des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index zu berücksichtigen. Die Unternehmen sind weder für die Festlegung des Zeitpunkts, der Preise oder der auszugebenden Anzahl an Anteilen des Fonds noch für die Ermittlung oder Berechnung der Gleichung, nach der der Fonds in Bargeld umgewandelt werden soll, verantwortlich und waren nicht daran beteiligt. Die Unternehmen haften nicht im Zusammenhang mit der Verwaltung, Vermarktung des oder dem Handel mit dem Fonds.

Die Unternehmen garantieren nicht die Richtigkeit und/oder kontinuierliche Berechnung des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index oder der darin enthaltenen Daten. Die Unternehmen übernehmen keine Garantie, weder ausdrücklich noch stillschweigend, hinsichtlich der Ergebnisse, die der Lizenznehmer, die Eigentümer des Fonds oder eine andere Person oder Organisation aus der Verwendung des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index oder der darin enthaltenen Daten erhalten. Die Unternehmen übernehmen weder ausdrücklich noch stillschweigend eine Gewährleistung und lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistung für die Marktfähigkeit oder Eignung für einen bestimmten Zweck oder eine bestimmte Nutzung in Bezug auf den NASDAQ CTA Global Climate Technology Index ® oder damit verbundener Daten ab. Ohne Einschränkung der vorstehenden Bestimmungen sind die Unternehmen nicht einmal dann in irgendeiner Weise für besondere, indirekte beiläufige Schäden, Folgeschäden, entgangene Gewinne oder Schäden durch Schadensersatz mit Strafcharakter haftbar, wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden in Kenntnis gesetzt wurden.

INHALT

	Seite
ALLGEMEINE INFORMATIONEN	4
ANLAGEZIELE UND ANLAGEPOLITIK	7
ANLAGERISIKEN	9
ZEICHNUNGEN	11
UMTAUSCH	12
RÜCKNAHMEN	12
GEBÜHREN UND KOSTEN	13
DIE ANTEILSKLASSEN	13
INDEXBESCHREIBUNG	14

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Für den Fonds gelten die folgenden Bestimmungen:

Basiswährung	US-Dollar („USD“)
Bewertungszeitpunkt	23.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem auf den Handelstag folgenden Geschäftstag. Der Schlusskurs ist der zuletzt gehandelte Kurs von Aktienwerten auf der Grundlage der Schlussauktion oder der zu Börsenschluss maßgebliche Mittelkurs der besten Geld- und Briefkurse.
Direkthandels- (Bartransaktions-)Gebühr	Bis zu 3 %. Es liegt im freien Ermessen des Verwaltungsrats, diese Gebühr allgemein oder in Einzelfällen ganz oder teilweise zu erlassen.
Geschäftstag	Ein Tag, an dem die Märkte in London geöffnet sind bzw. ein anderer Tag bzw. andere Tage, den/die der Verwaltungsrat festlegt, ausgenommen Tage, an denen die wichtigen Märkte geschlossen sind und/oder der Index an dem auf den Handelstag folgenden Geschäftstag nicht verfügbar ist. Dies muss den Anteilhabern im Voraus mitgeteilt werden. Ein „ wichtiger Markt “ ist ein Markt bzw. eine Börse oder eine Kombination von Märkten bzw. Börsen, bei denen der Wert der Anlagen des Fonds an diesen Märkten bzw. Börsen 30 % des (jährlich bestimmten und im Abschluss der Gesellschaft ausgewiesenen) Nettoinventarwerts des Fonds übertrifft, sofern die Verwaltungsgesellschaft nicht einen anderen Prozentsatz oder ein anderes Datum bestimmt, den/das sie für angemessener erachtet.
Handelsschluss	16.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag (sofern vom Verwaltungsrat nichts anderes beschlossen und den Anteilhabern im Voraus nichts anderes mitgeteilt wurde und in jedem Fall vor dem Bewertungszeitpunkt). Am Handelstag vor dem 25. Dezember und dem 1. Januar müssen Zeichnungsanträge am entsprechenden Handelstag des Fonds bis spätestens 12.00 Uhr (irische Ortszeit) eingehen. Alle ordnungsgemäß ausgefüllten Anträge, die nach dem Handelsschluss bei der Verwaltungsstelle eingehen, werden erst am nächsten Handelstag angenommen.
Handelstag	Jeder Geschäftstag oder sonstige Tag bzw. sonstige Tage, den/die der Verwaltungsrat festlegt und der Verwaltungsstelle und den Anteilhabern im Voraus mitteilt, wobei innerhalb von 14 Tagen mindestens ein (1) Tag ein Handelstag sein muss. Da der Bewertungszeitpunkt (wie nachstehend definiert) an dem Geschäftstag nach dem Handelstag liegt, ist der Fonds an einem Geschäftstag, der vor der Schließung eines bedeutenden Marktes liegt, nicht für die Entgegennahme von Handelsanträgen geöffnet. Der Fonds ist jedoch an einem Tag, an dem ein bedeutender Markt geschlossen ist, für die Entgegennahme von Handelsanträgen geöffnet, da der Bewertungszeitpunkt in Bezug auf diesen Handelstag an dem auf die Schließung des bedeutenden Marktes folgenden Geschäftstag liegt, auch wenn dieser Handelstag selbst nicht als Geschäftstag angesehen wird.

Index	NASDAQ CTA Global Climate Technology Index
Indexanbieter	NASDAQ
Nachbildung	<p>Der Fonds ist bestrebt, im selben Verhältnis in die Bestandteile des Index zu investieren, wie diese im Index vertreten sind.</p> <p>Es können jedoch Umstände bestehen, in denen es für den Fonds nicht möglich oder praktikabel ist, in alle Bestandteile des Index zu investieren. Zu diesen Umständen können unter anderem folgende Fälle zählen: (i) eine begrenzte Verfügbarkeit von Indexbestandteilen; (ii) Aussetzungen des Handels von Indexbestandteilen; (iii) Kosteneffizienzen; (iv) wenn das verwaltete Vermögen des Fonds relativ gering ist, oder (v) wenn interne oder aufsichtsrechtlich veranlasste Handelsbeschränkungen vorliegen (wie in den Abschnitten „Anlagebeschränkungen“ und „Anlagebeschränkungen – Sonstige Beschränkungen“ des Prospekts beschrieben), die für den Fonds oder Anlageverwalter, jedoch nicht für den Index gelten.</p>
Preis je Auflegungseinheit	Der Nettoinventarwert je Anteil multipliziert mit der Anzahl der in einer Auflegungseinheit enthaltenen Anteile. Der Nettoinventarwert je Anteil wird an jedem Handelstag auf der Website veröffentlicht.
Profil des typischen Anlegers	<p>Die Anlage in dem Fonds kann für Anleger geeignet sein, die über einen Anlagehorizont von fünf Jahren vorwiegend durch Anlagen in Aktien, die an anerkannten Märkten (wie im Prospekt definiert) notiert sind oder gehandelt werden, ein Kapitalwachstum anstreben. Vor einer Anlage in dem Fonds sollte ein Anleger seine Toleranz gegenüber den täglichen Kursschwankungen am Markt abwägen. Die Anleger sollten bereit sein, Verluste zu tragen.</p> <p>Die Anteile des Fonds werden sowohl privaten als auch institutionellen Anlegern angeboten.</p>
Steuern und Abgaben	Sämtliche Stempelsteuern und anderen Steuern, staatlichen Abgaben, Auflagen, Erhebungen, Devisenkosten und -provisionen (einschließlich Devisenspreads), Depotbank- und Unterdepotbankgebühren, Übertragungsgebühren und -kosten, Vertretungsgebühren, Maklergebühren, Provisionen, Bankgebühren, Eintragungsgebühren oder andere Aufwendungen und Gebühren, gleich ob zahlbar im Zusammenhang mit der Gründung, der Erhöhung oder Senkung der Barmittel oder sonstigen Vermögenswerten der Gesellschaft, oder bei Auflegung, Erwerb, Ausgabe, Umwandlung, Umtausch, Kauf, Besitz, Rückkauf, Rücknahme, Verkauf oder Übertragung von Anteilen oder Wertpapieren durch die Gesellschaft bzw. im Namen der Gesellschaft, und gegebenenfalls sämtliche Rückstellungen für den Spread oder die Differenz zwischen dem Preis, zu dem eine Anlage zum Zweck der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil eines Fonds bewertet wurde, und dem geschätzten oder tatsächlichen Preis, zu dem diese Anlage im Falle von Zeichnungen des jeweiligen Fonds gekauft oder im Falle von Rücknahmen des jeweiligen Fonds verkauft werden kann, einschließlich, zur Klarstellung, sämtlicher Aufwendungen oder Kosten, die aus Anpassungen von Swap- oder sonstigen Derivatekontrakten

	entstehen, die infolge einer Zeichnung oder Rücknahme erforderlich sind, oder im Hinblick auf die Ausgabe oder Stornierung oder sonstige Behandlung von Anteilszertifikaten, die vor oder bei Durchführung einer Transaktion, eines Handels oder einer Bewertung zahlbar sind oder werden.
Transaktionsgebühr für Sachtransaktionen	Informationen zur Transaktionsgebühr für Sachtransaktionen sind auf Anfrage bei der Verwaltungsstelle erhältlich. Es liegt im freien Ermessen des Verwaltungsrats, diese Gebühr allgemein oder in Einzelfällen ganz oder teilweise zu erlassen.
Umtauschtransaktionsgebühr	Es kann eine Umtauschgebühr von bis zu 3 % des Nettoinventarwerts je Anteil erhoben werden, wobei der Verwaltungsrat gegebenenfalls ganz oder teilweise auf diese Gebühr verzichten kann.
Veröffentlichungszeit für das Verzeichnis der Portfolioanlagen	Bis 8.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Geschäftstag.
Verzeichnis der Portfolioanlagen	Das Verzeichnis der Portfolioanlagen stellt der Anlageverwalter auf Anfrage zur Verfügung. Die im Verzeichnis der Portfolioanlagen aufgeführten Wertpapiere entsprechen dem Anlageziel und der Anlagepolitik des Fonds. Siehe nachstehend unter „ Anlageziele und Anlagepolitik “.
Verzeichnis des Portfoliovermögens	Das Verzeichnis des Portfoliovermögens steht auf der Website zur Verfügung.
Website	www.etf.hsbc.com

ANLAGEZIELE UND ANLAGEPOLITIK

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Performance des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index (der „**Index**“) nachzubilden und gleichzeitig den Tracking Error zwischen der Performance des Fonds und des Index so weit wie möglich zu minimieren. Der Index ist ein modifizierter Marktkapitalisierungsindex, der die Wertentwicklung einer Auswahl von im Bereich der globalen Klimatechnologie tätigen Unternehmen messen soll, die für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft von entscheidender Bedeutung sind, wie vom Indexanbieter festgelegt. Die in den Index aufgenommenen Unternehmen, in die der Fonds investiert, werden auf der Grundlage der Klassifizierung durch die Consumer Technology Association (CTA) ausgewählt, wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ weiter unten näher erläutert.

Einige der Märkte, in denen die Unternehmen ihren Sitz haben, gelten als Schwellenländer und unterliegen daher den im nachstehenden Abschnitt „Anlagerisiken“ dargelegten Risiken. Der Fonds kann mehr als 20 % seiner neuen Vermögenswerte in Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern anlegen. Der Fonds kann in chinesische A-Aktien investieren: (A) über Shanghai-Hong Kong Stock Connect; oder (b) indirekt über CAAP; oder (c) über zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen.

Im Rahmen der Nachbildung der Performance des Index bewirbt der Fonds bestimmte ökologische, soziale und/oder Unternehmensführungsmerkmale (wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ beschrieben), und er wurde als Fonds gemäß Artikel 8 im Sinne der Offenlegungsverordnung eingestuft.

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. Der Fonds fördert bestimmte ökologische, soziale und/oder Unternehmensführungsmerkmale (wie im Abschnitt „Indexbeschreibung“ dargelegt). Informationen zu den Merkmalen des Index und zur Bestimmung nachhaltiger Anlagen finden Sie im nachfolgenden Abschnitt „Indexbeschreibung“.

Es können jedoch Umstände bestehen, in denen es für den Fonds nicht möglich oder praktikabel ist, in alle Bestandteile des Index zu investieren. Zu diesen Umständen können unter anderem folgende Fälle zählen: (i) eine begrenzte Verfügbarkeit von Indexbestandteilen; (ii) Aussetzungen des Handels von Indexbestandteilen; (iii) Kostenineffizienzen; (iv) wenn das verwaltete Vermögen des Fonds relativ gering ist, oder (v) wenn interne oder aufsichtsrechtlich veranlasste Handelsbeschränkungen vorliegen (wie in den Abschnitten „Anlagebeschränkungen“ und „Anlagebeschränkungen – Sonstige Beschränkungen“ des Prospekts beschrieben), die für den Fonds oder Anlageverwalter, jedoch nicht für den Index gelten.

Da der Fonds in manche der Indexbestandteile nicht investiert, kann er: (i) ein Engagement indirekt über andere Vermögenswerte oder Instrumente erzielen (einschließlich: (a) American Depositary Receipts, European Depositary Receipts und Global Depositary Receipts, die normalerweise von einer Bank oder einer Treuhandgesellschaft ausgegebene Zertifikate sind und den Anteilsbesitz an einem Nicht-US-Emittenten nachweisen; (b) zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen, die ein ähnliches Anlageziel oder eine ähnliche Anlagestrategie aufweisen wie der Fonds, darunter Organismen, die vom Anlageverwalter oder seinen verbundenen Unternehmen verwaltet werden; oder (c) Finanzderivate („**Derivate**“), die nach Ansicht des Anlageverwalters den Fonds beim Erreichen seines Anlageziels unterstützen und Alternativen für den direkten Kauf der im Index enthaltenen Basiswerte sind, und/oder (ii) die investierbaren Indexbestandteile in vom Index abweichenden Mengenverhältnissen halten und/oder (iii) in Wertpapiere investieren, die keine Bestandteile des Index sind und von denen nach Ansicht des Anlageverwalters den nicht investierbaren Indexbestandteilen ähnliche Performance- und Risikoeigenschaften zu erwarten sind, und/oder (iv) Barmittel oder Zahlungsmitteläquivalente, einschließlich Geldmarktfonds, die zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen sind, halten. Der Fonds darf zu Zwecken des Anlage- und/oder Liquiditätsmanagements nicht mehr als 10 % seines Nettovermögens in zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen investieren.

Der Fonds investiert überwiegend in Wertpapiere, die an anerkannten Märkten gemäß der Definition im Prospekt notiert sind oder gehandelt werden. Daher bezieht sich das zugrunde liegende Engagement auf die Emittenten der im Index vertretenen Aktienwerte. Der indikative Nettoinventarwert je Anteil des Fonds wird in mindestens einem Terminal der wichtigen Marktdatenanbieter, z. B.

Bloomberg, sowie auf zahlreichen Websites angezeigt, die Aktienmarktdaten enthalten, darunter www.reuters.com.

Wenn die Vermögenswerte des Fonds unter eine Größe fallen, bei der es der Anlageverwalter als nicht mehr möglich erachtet, eine voll replizierte Strategie beizubehalten, kann der Anlageverwalter das Engagement in bestimmten Wertpapieren im Index reduzieren. Er wird jedoch versuchen sicherzustellen, dass das Vermögensportfolio des Fonds die Erträge des Index nachbildet. Unter solchen Umständen engagiert sich der Fonds jedoch möglicherweise nicht in allen im Index enthaltenen Wertpapieren, da der Index so viele Wertpapiere enthält, dass diese nicht in effizienter Weise gekauft werden könnten, und manche der im Index enthaltenen Wertpapiere bisweilen schwierig an anerkannten Märkten zu kaufen sind.

Der Fonds kann die folgenden Derivate einsetzen: Futures, Terminkontrakte, Devisenkontrakte (einschließlich Kassa- und Terminkontrakte), Aktienoptionen und Total Return Swaps, die dazu verwendet werden können, den Tracking Error zwischen der Performance des Fonds und des Index zu verringern. Diese Instrumente können zur effizienten Portfolioverwaltung und/oder zu Anlagezwecken verwendet werden. Die Hauptanlagepolitik des Fonds besteht darin, im Index enthaltene Wertpapiere zu kaufen, wie oben dargelegt, wobei allerdings der Einsatz von Derivaten zulässig ist, wenn der direkte Erwerb von Wertpapieren nicht möglich ist oder der Tracking Error durch den Einsatz von Derivaten besser minimiert werden kann. Sofern der Fonds DFI einsetzt, besteht eventuell das Risiko, dass die Volatilität des Fonds zunimmt. Es wird jedoch nicht davon ausgegangen, dass der Fonds aufgrund seiner Nutzung von DFI oder seiner Anlagen in diese ein überdurchschnittliches Risikoprofil aufweisen wird. DFI werden innerhalb der von der irischen Zentralbank vorgegebenen Grenzen und wie im Prospekt im Abschnitt **„Einsatz von Derivaten“** dargelegt eingesetzt. Dementsprechend besteht, obwohl DFI eine Hebelung bewirken können, der primäre Zweck der Verwendung von DFI darin, den Tracking Error zu verringern, und obwohl der Fonds infolge seiner Anlagen in DFI eine Hebelwirkung aufweisen wird, darf das mittels des Commitment-Ansatzes berechnete, durch DFI bedingte Gesamtrisiko des Fonds (wie in den OGAW-Verordnungen der Zentralbank vorgeschrieben) 100 % des Gesamtnettinventarwerts des Fonds nicht übersteigen. Der Fonds beabsichtigt nicht, in Optionsscheine zu investieren, es ist jedoch möglich, dass der Fonds aufgrund von Kapitalmaßnahmen Optionsscheine hält.

Der Begriff „effiziente Portfolioverwaltung“ steht für Techniken und Instrumente, die sich auf übertragbare Wertpapiere beziehen, die folgende Kriterien erfüllen: Sie sind wirtschaftlich angemessen, was bedeutet, dass sie in kostengünstiger Weise realisiert werden können, und die Anlageentscheidungen hinsichtlich eingegangener Geschäfte verfolgen eines oder mehrere der folgenden besonderen Ziele: (i) die Verringerung des Risikos (z. B. die Absicherung der Anlage bezüglich eines Teils eines Portfolios); (ii) die Senkung von Kosten (z. B. kurzfristiges Cashflow-Management oder taktische Vermögensallokation); und (iii) die Generierung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für die Gesellschaft bei angemessenem Risiko, unter Berücksichtigung des in diesem Nachtrag und im Prospekt beschriebenen Risikoprofils des Fonds sowie den allgemeinen Bestimmungen der OGAW-Verordnungen. Derivate können insbesondere dazu eingesetzt werden, den Tracking Error, d. h. das Risiko, dass die Rendite des Fonds von der Rendite des Index abweicht, zu minimieren. Aktienfutures, Indexfutures und Devisenfutures können zur Absicherung gegen Marktrisiken verwendet werden oder um am zugrunde liegenden Markt zu partizipieren. Terminkontrakte können zur Absicherung eingesetzt werden, oder um an einer Wertsteigerung einer Anlage, einer Währung oder einer Einlage zu partizipieren. Devisenkontrakte können eingesetzt werden, um die Währung der zugrunde liegenden Anlagen der einzelnen Fonds in die Basiswährung umzuwandeln und um in einer anderen als der Basiswährung des Fonds erhaltene Dividenden zwischen dem Ex-Tag und dem Abrechnungstag abzusichern. Aktienoptionen können zur Absicherung eingesetzt werden, oder anstelle von physischen Wertpapieren, um ein Engagement auf einem bestimmten Markt zu erzielen. Total Return Swaps können zur Absicherung verwendet werden oder anstelle eines physischen Wertpapiers, um ein Engagement in einem bestimmten Aktienwert zu erzielen.

Der Verwaltungsrat darf alle Kreditaufnahmebefugnisse der Gesellschaft gemäß dem Abschnitt „Kreditaufnahmepolitik“ im Prospekt ausüben. Eine solche Kreditaufnahme erfolgt nur temporär und darf 10 % des Nettinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

Der Tracking Error ist die annualisierte Standardabweichung der Differenz zwischen den monatlichen (oder täglichen) Renditen des Fonds und des Index.

Verschiedene Faktoren können zu einem Tracking Error führen:

- Transaktionskosten, operative Kosten, Verwahrungskosten, Steuern, Änderungen der Anlagen des Fonds und Neugewichtungen des Index, Kapitalmaßnahmen, Währungsschwankungen, Cashflow in und aus dem Fonds aus Dividenden/Wiederanlagen und Kosten und Aufwendungen, die in die Berechnung des Index nicht einfließen.
- Interne Beschränkungen, z. B. die Richtlinie von HSBC Global Asset Management über verbotene Waffen (wie im Prospektabschnitt: „Anlagebeschränkungen – Sonstige Beschränkungen“ beschrieben) oder sonstige vom Markt oder aufsichtsrechtlich vorgeschriebene Handelsbeschränkungen, die für einen Fonds, jedoch nicht für den entsprechenden Index gelten.

Darüber hinaus ist im Falle einer vorübergehenden Aussetzung oder Unterbrechung des Handels mit den Titeln, aus denen sich der Index zusammensetzt, oder von Marktunterbrechungen eine Neuausrichtung des Anlageportfolios des Fonds nicht immer möglich, was zu Abweichungen von den Renditen des Index führen kann.

Der Fonds wird passiv verwaltet. Es besteht keine Garantie dafür, dass das Anlageziel des Fonds erreicht wird. Insbesondere bietet kein Finanzinstrument die Möglichkeit, die Erträge des Index genau nachzubilden.

Der erwartete Tracking Error ist die erwartete Standardabweichung der Differenzen zwischen den Renditen des Fonds und des Index.

Zum Datum dieses Nachtrags beträgt der unter normalen Marktbedingungen für den Fonds erwartete Tracking Error bis zu 0,20 %. Abweichungen zwischen dem erwarteten und realisierten Tracking Error werden im Jahresbericht für den entsprechenden Zeitraum erläutert.

Der erwartete Tracking Error für den Fonds lässt nicht auf die künftige Performance schließen.

Das Volatilitätsniveau des Fonds wird in einer starken Korrelation mit demjenigen des Index stehen.

Total Return Swaps und Wertpapierleihgeschäfte

Der Fonds kann vorbehaltlich der Anforderungen der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, der OGAW-Verordnungen und der OGAW-Verordnungen der Zentralbank Wertpapierleihgeschäfte tätigen. Eine ausführlichere Beschreibung befindet sich im Prospekt im Abschnitt „*Total Return Swaps, Differenzkontrakte und Wertpapierleihgeschäfte*“. Bis zu 30 % des Nettovermögens des Fonds können gleichzeitig Gegenstand von Wertpapierleihgeschäften sein, wobei jedoch im Allgemeinen nicht davon auszugehen ist, dass der Betrag, der Gegenstand von Wertpapierleihgeschäften ist, 0 bis 25 % des Nettovermögens des Fonds übersteigt. Darüber hinaus kann der Fonds bis zu 10 % seines Nettovermögens in Total Return Swaps anlegen, wobei jedoch im Allgemeinen nicht davon auszugehen ist, dass solche Anlagen 5 % des Nettovermögens des Fonds übersteigen.

ANLAGERISIKEN

Eine Anlage in dem Fonds ist mit einem gewissen Risiko verbunden, einschließlich der im Prospekt unter „**Risikofaktoren**“ beschriebenen Risiken und der unten aufgelisteten spezifischen Risikofaktoren. Diese Anlagerisiken erheben keinen Anspruch auf Vollständigkeit, daher sollten interessierte Anleger den Prospekt und den vorliegenden Nachtrag sorgfältig durchlesen und ihre professionellen Berater konsultieren, bevor sie Fondsanteile zeichnen. Die Anlage in dem Fonds ist nicht für Anleger gedacht, die den Verlust ihrer gesamten Anlage oder eines wesentlichen Teils derselben nicht in Kauf nehmen können.

Vor einer Anlage in dem Fonds sollte ein Anleger seine Toleranz gegenüber den täglichen Kursschwankungen am Markt abwägen.

DFI

Der Einsatz von DFI zur effizienten Portfolioverwaltung oder zu Anlagezwecken könnte das Risikoprofil des Fonds erhöhen.

Informationen zu den mit dem Einsatz von DFI verbundenen Risiken finden Sie im Abschnitt **„Risikofaktoren – Besondere mit Derivaten verbundene Risiken“** im Prospekt.

Der Index

Die Anlage in dem Fonds setzt die Anleger den mit den Schwankungen des Index und des Werts der im Index vertretenen Wertpapiere verbundenen Marktrisiken aus. Der Wert des Index kann sowohl steigen als auch fallen und der Wert einer Anlage schwankt entsprechend. Es besteht keine Garantie dafür, dass der Fonds sein Anlageziel erreicht. Der Fonds unterliegt wie im Prospekt dargelegt einem Tracking Error, d. h. dem Risiko, dass seine Renditen nicht genau denen des Index entsprechen. Darüber hinaus kann eine eventuelle Neugewichtung des Index das Risiko eines Tracking Errors erhöhen.

Die bisherige Performance des Index lässt nicht auf seine zukünftige Performance oder die Performance des Fonds schließen.

Schwellenländer

Die Volkswirtschaften der Schwellenländer, in denen der Fonds investiert, können positiv oder negativ von den Volkswirtschaften von Industrieländern abweichen. Anlagen in Schwellenmärkten sind mit Risiken verbunden, einschließlich der Möglichkeit politischer oder sozialer Instabilität, nachteiliger Veränderungen der Anlage- oder Börsenaufsichtsbestimmungen, der Enteignung und des Einbehaltens von Dividenden. Darüber hinaus werden solche Wertpapiere eventuell weniger häufig und in geringerem Umfang gehandelt als Unternehmens- und Staatspapiere aus stabilen entwickelten Ländern. Investitionen in diese Märkte können außerdem von Gesetzen, Börsenpraktiken oder durch eine aufsichtsrechtliche Kontrolle beeinträchtigt werden, die nicht mit denen in weiter entwickelten Ländern vergleichbar sind.

Infolge seiner Investitionen in Schwellenländern kann der Fonds politischen, Abrechnungs-, Liquiditäts-, Devisen- und Verwahrungsrisiken sowie Risiken in Bezug auf die Rechnungslegungsstandards unterliegen. Einzelheiten zu den mit Investitionen in diesen Ländern verbundenen politischen, Währungs- und Verwahrungsrisiken entnehmen Sie bitte den Abschnitten **„Politische und/oder aufsichtsrechtliche Risiken“** und **„Verwahrungsrisiko“** und **„Besondere mit Anlagen in chinesischen Wertpapieren verbundene Risiken“** des Prospekts. Die mit der Abrechnung und Liquidität sowie den Rechnungslegungsstandards verbundenen Risiken werden im Folgenden dargelegt.

Abrechnungs- und Liquiditätsrisiken

Die Anteilinhaber sollten beachten, dass die Abrechnungsmechanismen in Schwellenländern im Allgemeinen weniger entwickelt und zuverlässig sind als die in weiter entwickelten Ländern, und dass dies daher das Risiko eines Glattstellungsausfalls erhöht, was für den Fonds zu erheblichen Verlusten bei Anlagen in Schwellenländern führen kann. Darüber hinaus sind die Glattstellungsmechanismen in bestimmten Schwellenländern eventuell noch nicht erprobt. Manche Schwellenmärkte nutzen physische Glattstellungsverfahren zur Übertragung von Anteilen und unter diesen Umständen kann es bei der Eintragung und Übertragung von Anteilen zu Verzögerungen kommen und es kann eventuell nicht sichergestellt werden, dass die Übertragung gegen Zahlung erfolgt.

Anteilinhaber sollten außerdem beachten, dass die Wertpapiere von Unternehmen aus Schwellenländern weniger liquide und volatil sind als weiter entwickelte Aktienmärkte und dass dies zu Schwankungen beim Preis der Anteile des Fonds führen kann.

Rechnungslegungsgrundsätze

Die rechtliche Infrastruktur und die Rechnungslegungs-, Prüfungs- und Berichterstattungsgrundsätze in den Schwellenländern, in denen der Fonds eventuell investiert, bieten Anlegern eventuell nicht dasselbe Maß an Informationen wie dies international im Allgemeinen der Fall wäre. Insbesondere die Bewertung von Anlagen, Abschreibungen, Wechselkursdifferenzen, latente Steuern, Eventualverbindlichkeiten und Konsolidierung können anders behandelt werden als im Rahmen internationaler Rechnungslegungsstandards.

Das vorliegende Dokument enthält keine detaillierten Informationen zum politischen, wirtschaftlichen und rechtlichen Umfeld der Schwellenmärkte, in denen der Fonds eventuell investiert. Interessierte Anleger sollten in Bezug auf die jeweiligen Bedingungen und die mit einer Investition in Schwellenmärkte im Allgemeinen verbundenen Risiken einen Aktienmakler, Bankmanager, Anwalt, Steuerberater oder anderen Finanzberater konsultieren.

ZEICHNUNGEN

Während des Erstausgabezeitraums werden Anteilsklassen des Fonds zuerst zum Preis des Index multipliziert mit einem Faktor von 0,01 zum Bewertungszeitpunkt am ersten Geschäftstag nach dem Ende des Erstausgabezeitraums vom 1. Mai 2025 bis zum 31. Oktober 2025 (oder einem anderen Datum, das vom Verwaltungsrat festgelegt werden kann) ausgegeben und ihr Preis kann beim Anlageverwalter angefordert werden. Danach werden die Anteile des Fonds zum Nettoinventarwert je Anteil zuzüglich eines angemessenen Betrags für Gebühren und Abgaben und gemäß den im Prospekt und in diesem Nachtrag dargelegten Bestimmungen ausgegeben.

Handelsterminplan

Frist für Antragsformular für alle Zeichnungen	16.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag.
Barzeichnungen – Eingangsfrist für Bargeld:	Bis 15.00 Uhr (irische Ortszeit) innerhalb von zwei Geschäftstagen nach dem Handelstag
Zeichnungen gegen Sacheinlagen:	Zeichnungen gegen Sacheinlagen sind ausnahmsweise bei ausdrücklicher vorheriger Vereinbarung mit dem Anlageverwalter zulässig.
Abrechnung für gezeichnete Anteile	Innerhalb von zwei Geschäftstagen nach dem Handelstag oder dem anderen, vom Verwaltungsrat festgelegten Datum, sofern die jeweiligen frei verfügbaren Zeichnungsgelder für Barzeichnungen (ggf. einschließlich des Baranteils einer Sacheinlage) nicht später als zur Abrechnungsfrist der maßgeblichen Clearing-Plattform oder nicht später als 15.00 Uhr (irische Ortszeit) für elektronische Überweisungen (oder nicht später als mit dem Anlageverwalter für die Portfolioeinlage einer Zeichnung gegen Sacheinlagen vereinbart, wenn eine Zeichnung gegen Sacheinlagen vom Anlageverwalter akzeptiert wurde) eingegangen sind. Zeichnungen über eine der genannten Methoden müssen an demselben Geschäftstag nach dem Handelstag erfolgen, an dem die Abrechnung durchgeführt werden soll, sofern der USD-Devisenmarkt an diesem Tag nicht geschlossen ist. In diesem Fall erfolgt die Abrechnung an dem Geschäftstag, der auf die Schließung des USD-Devisenmarkts folgt.

Sämtliche Zahlungen sollten eindeutig kenntlich gemacht werden, wobei für jede Zeichnungstransaktion eine separate Zahlung erfolgen sollte.

Am Handelstag vor dem 25. Dezember und dem 1. Januar müssen Zeichnungsanträge am entsprechenden Handelstag des Fonds bis spätestens 12.00 Uhr (irische Ortszeit) eingehen. Wenn ein Zeichnungsantrag nach 12.00 Uhr (irische Ortszeit) eingeht, wird die Zeichnung erst am nächsten Handelstag bearbeitet.

Tage, an denen der USD-Devisenmarkt geschlossen ist

Es gelten die oben genannten Fristen für den Erhalt von Barmitteln und, wenn der Anlageverwalter eine Zeichnung gegen Sacheinlagen akzeptiert, für den Erhalt einer Portfolioeinlage, sofern der Handelstag nicht auf einen Tag fällt, an dem der USD-Devisenmarkt geschlossen ist. In diesem Fall müssen die Barmittel (einschließlich des Baranteils einer Zeichnung gegen Sacheinlagen, sofern diese vom Anlageverwalter akzeptiert wurde) zur entsprechenden Ablauffrist an dem Geschäftstag eingehen, der auf die Schließung des USD-Devisenmarkts folgt. Bareinzahlungen, die nach 15.00 Uhr (irische Ortszeit) eingehen, gelten als verspätet und werden erst am nächsten Geschäftstag abgerechnet und dem Konto des Fonds gutgeschrieben. In diesem Fall hat der Anleger die Gesellschaft und die Verwaltungsstelle für sämtliche Verluste zu entschädigen, die aufgrund der verspäteten Zahlung der Zeichnungsbeträge durch den Anleger entstehen. Die Verwahrstelle haftet nicht für Verluste, die aufgrund der verspäteten Zahlung von Zeichnungsgeldern an den Fonds entstehen.

UMTAUSCH

Ein Umtauschantrag wird als Antrag auf Barrücknahme für die ursprüngliche Anteilsklasse und als Barzeichnungsantrag für die neue Anteilsklasse in diesem Fonds oder einem anderen Teilfonds der Gesellschaft behandelt. Auf dieser Basis, und sofern die ursprüngliche und die neue Anteilsklasse dieselbe Basiswährung haben, können die Anteilinhaber beantragen, ihre Anteile sämtlicher Klassen des Fonds an jedem Handelstag, ganz oder teilweise in Anteile einer anderen Klasse des Fonds oder in einen anderen Teilfonds der Gesellschaft umzutauschen, sofern der Handel mit den entsprechenden Anteilen nicht unter den im Prospekt beschriebenen Umständen vorübergehend ausgesetzt wurde und die von dem Umtausch betroffenen Anteilsklassen der Teilfonds der Gesellschaft denselben Handelsschluss haben. Bitte beachten Sie die Bestimmungen zur Zeichnung und Rücknahme in den jeweiligen Fondsnachträgen.

Wenn Anteilinhaber den Umtausch von Anteilen zur Erstanlage in einen Teilfonds der Gesellschaft beantragen, sollten sie sicherstellen, dass der gesamte Nettoinventarwert je Anteil der umgetauschten Fondsanteile mindestens der Mindestbeteiligung des jeweiligen Teilfonds entspricht. Wenn eine Beteiligung nur teilweise umgetauscht wird, muss die verbleibende Beteiligung ebenfalls mindestens der Mindestbeteiligung des jeweiligen Teilfonds entsprechen. Wenn es sich bei der Anzahl der bei dem Umtausch auszugebenden Anteile der neuen Klasse nicht um eine ganzzahlige Anzahl von Anteilen handelt, kann die Gesellschaft Anteilsbruchteile für die neue Klasse ausgeben oder dem Anteilinhaber, der die Anteile der ursprünglichen Klasse umtauschen möchte, den Mehrbetrag zurückerstatten.

Umtauschgeschäfte sind mit einer Umtauschtransaktionsgebühr verbunden, die der Gebühr entspricht, die an die Verwaltungsstelle als Vertreter der Gesellschaft zu entrichten ist, wenn im Rahmen eines Anteils-umtauschs Anteile gegen Bargeld zurückgegeben werden und das Bargeld anschließend in Anteile eines anderen Teilfonds der Gesellschaft investiert wird. Die zu entrichtende Gebühr wird zu dem im entsprechenden Fondsnachtrag für den gezeichneten Teilfonds angegebenen Satz der Umtauschtransaktionsgebühr vom Rücknahmeerlös abgezogen.

RÜCKNAHMEN

Anteilinhaber können an jedem Handelstag die Rücknahme von Anteilen zum Nettoinventarwert abzüglich eines angemessenen Betrags für Gebühren und Abgaben beantragen, sofern bis spätestens zum Handelsschluss des jeweiligen Handelstages im Einklang mit den Bestimmungen im Abschnitt **„Zeichnungen, Bewertungen und Rücknahmen“** des Prospekts ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag bei der Verwaltungsstelle eingeht. Bartransaktionen werden gemäß dem Prospekt und Sachtransaktionen werden innerhalb von 10 Geschäftstagen ab dem jeweiligen Handelstag abgerechnet.

Laut den Bestimmungen des Prospekts werden Rücknahmeerlöse (Sach- und/oder Barleistungen) erst dann freigegeben, wenn der Verwaltungsstelle die Originale der vollständigen Unterlagen zur Verhinderung von Geldwäsche vorliegen.

GEBÜHREN UND KOSTEN

Einzelheiten zu den durch den Fonds zahlbaren Gebühren und Kosten finden Sie im Abschnitt „**Gebühren und Kosten**“ des Prospekts.

Die jährlichen Gebühren und Betriebskosten der Klassen (mit Ausnahme der bei der Neuausrichtung des Portfolios anfallenden Transaktionskosten und Steuern oder Abgaben, die alle separat aus dem Vermögen des Fonds bezahlt werden) (die „**Gesamtkostenquote**“ oder „**TER**“) sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Die TER wird täglich berechnet und ist am Monatsende nachträglich fällig. Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt (durch Rückerstattung an den Fonds) alle über die Gesamtkostenquote hinausgehenden Gebühren, Kosten oder Aufwendungen. Die von der Gesamtkostenquote gedeckten Gebühren, Kosten und Aufwendungen sind im folgenden Abschnitt dargelegt.

Klasse	TER p. a. des Nettoinventarwerts der Klasse
Basiswährung und nicht abgesicherte Anteilsklassen	Bis zu 0,50 %
Abgesicherte Anteilsklassen	Bis zu 0,53 %

Zu den aus der Gesamtkostenquote bezahlten Gebühren, Kosten und Aufwendungen gehören unter anderem an die Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwalter, den Verwalter, die Verwahrstelle, Aufsichtsbehörden und Abschlussprüfer bzw. deren Bevollmächtigten oder Vertreter bezahlte Gebühren und Aufwendungen sowie bestimmte Rechtskosten der Gesellschaft einschließlich ihrer Gründungskosten.

Bei Barzahlung fällt eventuell eine Direkthandels- (Bartransaktions-)Gebühr von bis zu 3 % der Zeichnungs- und Rücknahmebeträge an, wenn Anteile direkt mit dem Fonds gehandelt werden.

DIE ANTEILSKLASSEN

Der Fonds umfasst unterschiedliche Anteilsklassen, wie im Abschnitt „Die Anteile“ des Prospekts beschrieben. Zum Datum des Nachtrags stehen möglicherweise nur bestimmte Anteilsklassen zur Zeichnung zur Verfügung. Zusätzliche Anteilklassen können in Zukunft in Übereinstimmung mit den Auflagen der Zentralbank hinzugefügt werden. Eine aktuelle Liste der aufgelegten Klassen und der zum Kauf verfügbaren Klassen ist am eingetragenen Sitz des Anlageverwalters erhältlich.

Klasse	Art	Ausschüttungspolitik	ISIN
USD	Eine auf die Basiswährung lautende Klasse	Thesaurierend	
CHF Hedged	Eine in CHF abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
EUR Hedged	Eine in EUR abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
GBP Hedged	Eine in GBP abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
USD Hedged	Eine in USD abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
USD	Eine auf die Basiswährung lautende Klasse	Ausschüttend	
CHF Hedged	Eine in CHF abgesicherte Klasse	Ausschüttend	
EUR Hedged	Eine in EUR abgesicherte Klasse	Ausschüttend	
GBP Hedged	Eine in GBP abgesicherte Klasse	Ausschüttend	
USD Hedged	Eine in USD abgesicherte Klasse	Ausschüttend	

Ausschüttungsanteile zahlen in der Regel Dividenden auf vierteljährlicher Basis im Januar/Februar, April/Mai, Juli/August und Oktober/November gemäß dem Abschnitt „Ausschüttungspolitik“ des Prospekts.

Informationen über währungsabgesicherte Klassen befinden sich unter der Überschrift „Währungstransaktionen“ im Prospekt.

Die Anteile sind unter Einhaltung der Bestimmungen der Satzung und des Prospekts frei übertragbar.

Die Abwicklung des Handels mit den Anteilen erfolgt zentral über eine ICSD-Struktur. Die Anteile werden in der Regel nicht in stückeloser Form ausgegeben und es werden keine vorläufigen Eigentumsnachweise oder Anteilszertifikate ausgestellt, mit Ausnahme der Globalurkunde, die an den Nominee der gemeinsamen Verwahrstelle übermittelt wird und für das ICSD-Abwicklungsmodell erforderlich ist (die ICSD ist das anerkannte Clearing- und Abwicklungssystem, über das die Anteile abgewickelt werden). Wenn Anteile über ein oder mehrere anerkannte(s) Clearing- und Abrechnungssystem(e) in nicht physischer Form begeben werden, können diese Anteile nur durch Rückgabe über diese anerkannten Clearing- und Abrechnungssysteme zurückgenommen werden. Abgesehen von der an den Nominee der Gemeinsamen Verwahrstelle ausgegebenen Globalurkunde stellt die Gesellschaft keine individuellen Anteilszertifikate aus. Es liegt im freien Ermessen des Verwaltungsrats, Zeichnungen von Anteilen ganz oder teilweise abzulehnen.

Die Anteile werden gemäß Chapter 16 der UK Listing Rules in die offizielle Liste der United Kingdom Listing Authority aufgenommen und zum Handel am Hauptmarkt der London Stock Exchange zugelassen. Die Gesellschaft ist in Großbritannien für die Zwecke des Financial Services and Markets Act 2000 in der jeweils aktuellen Fassung als Investmentfonds zugelassen.

INDEXBESCHREIBUNG

In diesem Abschnitt werden die Hauptmerkmale des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index (der „Index“) zusammengefasst und stellt keine vollständige Beschreibung des Index dar.

Allgemeine Informationen

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance der Netto-Gesamtrendite des Index nachzubilden.

Der Index ist ein modifizierter, nach Streubesitz-Marktkapitalisierung gewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Performance einer Auswahl von im Bereich der globalen Klimatechnologie tätigen Unternehmen zu messen, die für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft von entscheidender Bedeutung sind, wie vom Indexanbieter festgelegt. Die Unternehmen werden auf der Grundlage der Klassifizierung durch die Consumer Technology Association („CTA“) für die Aufnahme in den Index ausgewählt, wie nachstehend näher erläutert.

Ein Unternehmen muss von der CTA als „Klimatechnologieunternehmen“ klassifiziert werden und insbesondere in eine der folgenden Kategorien fallen, um in den Index aufgenommen zu werden:

Enabler

Stromquellen und Stromspeicher – Unternehmen, die den Bereichen Stromquellen und Stromspeicher zugeordnet werden, ermöglichen den Übergang zu saubereren Energiequellen in der gesamten Wirtschaft, einschließlich in der Industrie, in Gebäuden (z. B. Wohn- und Gewerbegebäuden) und im Transportwesen. Stromquellen und Stromspeicher umfassen Unternehmen, die in den Bereichen Biokraftstoffe, Batterietechnologie, Brennstoffzellen, grüner Wasserstoff, Energiemanagement (einschließlich stromfokussierter Halbleiter) und Stromerzeugung aus erneuerbaren Quellen (z. B. Wasserkraft, Solar- und Windenergie) tätig sind.

Engager

Klima-Infrastruktur – Unternehmen, die dem Bereich Klima-Infrastruktur zugeordnet werden, beschäftigen sich mit Technologien, die sich auf die Reduzierung der Kohlenstoffauswirkungen von gewerblichen, industriellen und Wohngebäuden konzentrieren, einschließlich durch fortschrittliche Baumaterialien und mechanische Systeme (z. B. Heizung, Kühlung, Lüftung, Sanitär und Elektrik), Ladeinfrastruktur für Elektrofahrzeuge (z. B. öffentliche und private Ladelösungen), Prozessverbesserungen (z. B. Agrar-, Elektro- und Materialtechnologien, die die Kohlenstoffauswirkung

bestehender Baumethoden verbessern) und intelligente Städte/Stromnetze (z. B. Netzkommunikation und -Intelligenz, Laststeuerung, intelligente Messung).

Enhancer

Anpassung – Unternehmen, die dem Bereich Anpassung zugeordnet werden, bieten Beratungs-, Technologie- und/oder Softwarelösungen für Kunden an, um Projekte in Industrie, Gebäuden und Transportwesen zu entwickeln, zu bauen und nachzurüsten, darunter Weiterentwicklungen bei der Bereitstellung erneuerbarer Energien, der Stromerzeugung und dem Energieverbrauch.

Agrar- und Lebensmitteltechnologie (AgTech & FoodTech) – Unternehmen, die dem Bereich AgTech & FoodTech zugeordnet werden, befassen sich vornehmlich mit Technologien zur Reduzierung von Kohlenstoff- und Methanemissionen durch die Entwicklung von Produkten, die den herkömmlichen Fleischkonsum verdrängen sollen (z. B. alternative/pflanzliche Proteine und zelluläre Landwirtschaft als Ersatz für Rind-, Hühner-, Schweine- und Putenfleisch usw.), sowie mit Technologien zur Verringerung der Intensität herkömmlicher Anbaumethoden und der damit verbundenen logistischen/transportbedingten Auswirkungen durch den Einsatz von Indoor- und vertikalen Anbaumethoden.

Transport – Unternehmen, die dem Bereich Transport zugeordnet werden, fördern die Entwicklung von weniger kohlenstoffintensiven Transportprodukten (z. B. Batterien, Brennstoffzellen, erneuerbare Energien), einschließlich Makromobilität (z. B. Passagierflugzeuge, Busse, Züge und andere Formen des Massentransports) und Mikromobilität (Lufttaxi/Senkrechtstarter und Landbahnfahrzeuge, Pkw und Motorräder, Liefer-/Flotten-/Logistik-/Last-Mile-Lkw und -Fahrzeuge).

CTA legt fest, welche Unternehmen als Klimatechnologieunternehmen klassifiziert werden. Diese bilden dann das investierbare Universum des Indexanbieters (das „**anfängliche investierbare Universum**“). Unternehmen werden von der CTA auf der Grundlage verschiedener Faktoren ausgewählt, darunter Umsatz, Marktanteil, Finanzberichte, Fusionen und Übernahmen, Marktkapitalisierung, Patente, Produkteinführungen und andere frei zugängliche und öffentlich verfügbare Daten. CTA erhält diese Daten durch Datenabonnements, öffentliche Datenquellen und Datenüberwachung, um das investierbare Universum zu identifizieren.

Dann werden die folgenden Kriterien auf das anfängliche investierbare Universum angewendet, um den Index zu erstellen:

1. Um für eine Aufnahme in den Index infrage zu kommen:
 - a) müssen die Wertpapiere eine Streubesitz-Marktkapitalisierung von 300 Millionen US-Dollar aufweisen; bestehende Bestandteile müssen eine Streubesitz-Marktkapitalisierung von 240 Millionen US-Dollar aufrechterhalten; und
 - b) das durchschnittliche tägliche Handelsvolumen (ADTV) der Wertpapiere muss 1 Million US-Dollar betragen; bestehende Bestandteile müssen ein ADTV von mindestens 0,8 Millionen US-Dollar aufweisen.
2. Es werden die folgenden ESG-Ausschlüsse angewendet:
 - a) Unternehmen, die an umstrittenen Waffen beteiligt sind;
 - b) Unternehmen, die an Kraftwerkskohle beteiligt sind;
 - c) Unternehmen, die die UNGC-Grundsätze und damit verbundene internationale Normen und Standards, wie die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen (UN), nicht einhalten (zusammenfassend als „Nichteinhaltung des Global Compact“ bezeichnet);
 - d) Unternehmen mit einem Sustainability Controversy-Rating von 5;
 - e) Unternehmen, die an Exploration und Produktion, Raffination, Transport und/oder Lagerung von Öl und Gas beteiligt sind;
 - f) Unternehmen, die an der Exploration von arktischem Öl und Gas beteiligt sind;
 - g) Unternehmen, die an der Ölsandgewinnung beteiligt sind;

- h) Unternehmen, die an der Cannabisproduktion beteiligt sind und/oder eine bedeutende Beteiligung an einem anderen Unternehmen mit Beteiligung an der Entwicklung und dem Anbau von Cannabis haben; und
- i) Unternehmen, die an der Herstellung von Tabakerzeugnissen beteiligt sind.

Was „beteiligt“ ist, wird vom Indexanbieter festgelegt. Einzelheiten zu den für die ESG-Ausschlüsse geltenden Umsatzschwellen sind der Indexmethodik zu entnehmen.

Die obigen Ausschlüsse entsprechen den Ausschlüssen für Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte, wie sie in Artikel 12(1)(a) – (g) der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1818 der Kommission aufgeführt sind:

- (a) Unternehmen, die an Aktivitäten im Zusammenhang mit umstrittenen Waffen beteiligt sind;
- (b) Unternehmen, die am Anbau und an der Produktion von Tabak beteiligt sind;
- (c) Unternehmen, die nach Ansicht der Referenzwert-Administratoren gegen die Grundsätze der Initiative „Global Compact“ der Vereinten Nationen (UNGC) oder die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen;
- (d) Unternehmen, die 1 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Exploration, dem Abbau, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Stein- und Braunkohle erzielen;
- (e) Unternehmen, die 10 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Exploration, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Erdöl erzielen;
- (f) Unternehmen, die 50 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Exploration, der Förderung, der Herstellung oder dem Vertrieb von gasförmigen Brennstoffen erzielen;
- (g) Unternehmen, die 50 % oder mehr ihrer Einnahmen mit der Stromerzeugung mit einer THG-Emissionsintensität von mehr als 100 g CO₂ e/kWh erzielen.

Für die Zwecke des Buchstabens (a) gelten als umstrittene Waffen die in internationalen Verträgen und Übereinkommen, den Grundsätzen der Vereinten Nationen und gegebenenfalls den nationalen Rechtsvorschriften genannten umstrittene Waffen.

3. Jedes verbleibende Wertpapier erhält dann einen Klimatechnologie-Score, der Folgendes umfasst:

- **Thematischer Umsatz-Score** – Der thematische Umsatz-Score ist eine **quantitative** Bewertung des geschätzten Umsatzanteils jedes Unternehmens, der aus Klimatechnologie abgeleitet wird.
 - 0-24,9%: 0
 - 25-49,9%: 1
 - 50-74,9%: 2
 - 75-100%: 3
- **Übergangs-Score** – Der Übergangs-Score ist eine **qualitative** Bewertung des Grades des Übergangs zu einem vollständig kohlenstoffneutralen Produkt- und Dienstleistungsportfolio jedes Unternehmens.
 - Niedrig: 1
 - Mittel: 2
 - Hoch: 3
- **Innovations-Score** – der Innovations-Score ist eine **qualitative** Bewertung der Auswirkungen jedes Unternehmens hinsichtlich des Erreichens von Kohlenstoffneutralität.
 - Niedrig: 1
 - Mittel: 2
 - Hoch: 3

Alle übrigen Unternehmen werden wie folgt kategorisiert: (i) Tier 1; (ii) Tier 2; oder (iii) keiner der erstgenannten, basierend auf ihrem Klimatechnologie-Score:

- Ein Tier-1-Unternehmen erzielt mindestens 50 % seines Umsatzes aus Klimatechnologie, wie vom Indexanbieter definiert (Thematic Revenue Score ≥ 2); und
- Ein Tier-2-Emittent erzielt 25-50 % seines Umsatzes aus Klimatechnologie ($2 > \text{Thematischer Umsatzwert} \geq 1$), und die Summe aus dem Übergangs-Score und dem Innovations-Score beträgt 4 oder höher.

Alle Unternehmen, die die Liquiditätskriterien erfüllen, nicht anderweitig aus ESG-Gründen ausgeschlossen sind und als Tier 1 oder Tier 2 eingestuft werden, werden in den Index aufgenommen.

Die maximale Wertpapiergewichtung wird 4,5 % nicht überschreiten.

Die Zusammensetzung des Index wird halbjährlich im Juni und Dezember neu gewichtet.

Veröffentlichung des Index

Der Index wird täglich auf Basis der Schlusskurse berechnet, wobei die offiziellen Schlusskurse der im Index enthaltenen Aktien verwendet werden. Weitere Informationen zum Index, zu seinen Bestandteilen, zur Häufigkeit seiner Neuausrichtung und zu seiner Performance sind unter <https://indexes.nasdaqomx.com/Index/Overview/CLMTCHN> (für Indexbestandteile, Datenblätter, Indexmethodik und sonstige Informationen).

Die Indexmethodik kann von Zeit zu Zeit vom Indexanbieter geändert werden. Informationen zur Indexmethodik sind auf der oben angegebenen Website und unter folgender Adresse verfügbar: https://indexes.nasdaqomx.com/docs/methodology_CLMTCH.pdf

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 81,2 % 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?

Bei der Nachbildung der Wertentwicklung des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index (der „Index“) bewirbt der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- die Förderung von Klimatechnologie durch Investitionen in Unternehmen, bei denen das Ziel des Unternehmens entscheidend für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft ist („Klimatechnologie“). Der Fonds ist bestrebt, die Förderung dieser Merkmale zu erreichen, indem er die Wertentwicklung des Index nachbildet, der unter anderem Unternehmen umfasst, die als „Enabler“, „Enhancer“ und „Engager“ (wie vom Indexanbieter definiert und nachstehend näher erläutert) im Bereich der Klimatechnologie gelten, und der eine Reihe von ESG-bezogenen Ausschlüssen anwendet, darunter umstrittene Waffen, Cannabis, Kraftwerkskohle, Öl und Gas, schwerwiegende ESG-Kontroversen und Unternehmen, die sich nicht an die UNGC-Prinzipien halten, wie im nachfolgenden Abschnitt zu den verbindlichen Elementen näher erläutert.

Der Index wurde als Referenzwert ausgewiesen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen.

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

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

Der Nachhaltigkeitsindikator ist das ESG-Ratingsystem von HSBC Asset Management, das zur Messung der Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale verwendet wird, wobei insbesondere Folgendes gemessen wird:

- ESG-Score

HSBC Asset Management verwendet bei der Berichterstattung über den Fonds branchenbereinigte ESG-Scores von MSCI. HSBC erhält ESG-Scores für Emittenten von MSCI. HSBC ordnet dann diese ESG-Scores den Emittenten der Instrumente zu und aggregiert die Bestände des Fonds anhand eines Ansatzes mit gewichteten Durchschnittswerten.

- **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?**

Die von diesem Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen tragen unter anderem zu folgenden ökologischen und sozialen Zielen bei:

1. Reduzierung von Treibhausgas (THG)-Emissionen und Verringerung des CO₂-Fußabdrucks;
2. Übergang zu oder Nutzung von erneuerbarer Energien; und
3. Förderung von Menschenrechten.

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des Index nach, dessen Schwerpunkt auf der Auswahl von Unternehmen aus der globalen Klimatechnologiebranche liegt, die für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft entscheidend sind

Durch die Nachbildung der Wertentwicklung des Index tragen die Anlagen des Fonds zu diesen nachhaltigen Zielen bei.

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

Wie im nächsten Abschnitt dieses Anhangs näher erläutert, wird vom Indexanbieter im Rahmen der Indexkonstruktion keine Analyse in Bezug auf den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durchgeführt.

Der Index wird regelmäßig neu gewichtet. Vor der Neugewichtung des Index werden die nachstehend genannten Indikatoren in die Bewertung der Geschäftstätigkeit einbezogen.

Durch die Nachbildung der Wertentwicklung des Index führen die Investitionen des Fonds, die nachhaltige Investitionen sind, nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung des nachhaltigen Ziels der ökologischen und sozialen Investitionen.

Der Anlageverwalter führt einen Overlay-Prozess zur Überwachung der Anlagebeschränkungen, der nach Investitionen sucht, die den nachhaltigen Zielen erheblich schaden würden und die dazu führen könnten, dass der Anlageverwalter sie vor der Indexneugewichtung veräußert.

Wie in der Methodik des Indexanbieters dokumentiert, darf der Emittent eines Wertpapiers von Sustainalytics nicht positiv als eines der folgenden Merkmale aufweisend identifiziert werden:

1. Nichteinhaltung der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen;
2. Sustainalytics Controversy Rating von fünf (5); und/oder
3. Beteiligung oberhalb bestimmter Schwellenwerte oder Pauschalausschlüsse in Bezug auf umstrittene Waffen, Kraftwerkskohle, Öl und Gas oder Cannabis für den nicht medizinischen Gebrauch.

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAI“) wurden vom Indexanbieter bei der Bewertung der Geschäftsaktivitäten des anfänglichen Wertpapieruniversums verwendet. Bei der Bewertung der einzelnen Wertpapiere anhand von Mindestschwellenwerten oder pauschalen Ausschlüssen für Tätigkeiten, die in Bezug auf diese Indikatoren ermittelt wurden, wurden Umsatzdaten, die Beteiligung der Unternehmen und andere Datenquellen berücksichtigt.

Der Index wird auf der Grundlage der von CTA bereitgestellten Daten zusammengestellt. CTA legt fest, welche Unternehmen als Klimatechnologieunternehmen klassifiziert werden. Diese bilden dann das investierbare Universum des Indexanbieters (das „anfängliche investierbare Universum“). Unternehmen werden von CTA auf der Grundlage verschiedener Faktoren ausgewählt, darunter Umsatz, Marktanteil, Finanzberichte, Fusionen und Übernahmen, Marktkapitalisierung, Patente, Produkteinführungen und andere frei zugängliche und öffentlich verfügbare Daten. CTA erhält diese Daten durch Datenabonnements, öffentliche Datenquellen und Datenüberwachung, um das investierbare Universum zu identifizieren. Der Indexanbieter wendet dann ESG-Ausschlüsse an, darunter Ausschlüsse von umstrittenen Waffen, Kraftwerkskohle, Öl und Gas, schwerwiegende ESG-Kontroversen, Nichteinhaltung der UNGC-Prinzipien und Cannabis. Gemäß der Indexmethodik werden Wertpapiere, die an der Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle, Stromerzeugungskapazität und -förderung sowie Unternehmen, die an der Exploration und Förderung, der Raffination, dem Transport und/oder der Lagerung von Öl und Gas beteiligt sind, ab einem Mindestschwellenwert herausgefiltert, und kontroverse Waffen (PAI 14) sowie Cannabisproduktion und -besitz werden entfernt, bevor der endgültige Index berechnet wird. Darüber hinaus wird ein separates Kontroversen-Screening auf das Anfangsuniversum angewendet, um alle Wertpapiere zu entfernen, die gegen die Prinzipien des UNGC verstoßen (PAI 10).

Es werden keine optionalen Indikatoren berücksichtigt.

Darüber hinaus ist die aktive Beteiligung durch Engagement und die globale Stimmrechtsvertretung eine wichtige Säule des Ansatzes des Anlageverwalters im Hinblick auf verantwortungsvolle Investitionen. Stewardship-Aktivitäten konzentrieren sich auf den Schutz und die Steigerung der Investitionen der Kunden. Der Anlageverwalter arbeitet mit Unternehmen bei einer Reihe von ESG-Fragen zusammen und verfolgt die folgenden klaren Ziele in Bezug auf das Engagement:

- Verbesserung des Verständnisses der Geschäftstätigkeit und der Strategie des Unternehmens;
- Überwachung der Unternehmensleistung;
- Signalisieren von Unterstützung oder Äußern von Bedenken bezüglich der Unternehmensführung, Leistung oder Richtung; und
- Förderung guter Praktiken.

Die Themen des Engagements reichen von Fragen der Verfahrensweisen der Unternehmensführung, wie zum Beispiel dem Schutz der Rechte von Minderheitsaktionären, der Wahl von Verwaltungsratsmitgliedern und der Struktur von Verwaltungsräten über Umweltfragen, wie zum Beispiel der Anpassung an den Klimawandel und den Klimaschutz sowie dem Übergang zu kohlenstoffarmen Energien bis hin zu sozialen Themen wie Humankapitalmanagement, Ungleichheit und Datenschutz.

Der Anlageverwalter verfügt über ein spezielles Stewardship-Team mit Engagement-Spezialisten. Das Engagement ist auch ein wesentlicher Bestandteil des fundamentalen Research-Prozesses. Die Analysten und Portfoliomanager arbeiten im Rahmen des Investitionsprozesses mit den Emittenten zusammen und befassen sich in ihren Analysen und Diskussionen mit relevanten ESG-Themen.

Der Anlageverwalter ist bei seiner Berichterstattung über das Engagement und die Abstimmungsaktivitäten vollkommen transparent. Er veröffentlicht Abstimmungen vierteljährlich und zusammenfassende Informationen über seine Engagementaktivitäten jährlich.

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

Die Indexmethodik umfasst die Berücksichtigung schwerwiegender ESG-Kontroversen, die anhand von Daten von Sustainalytics ermittelt wurden, wobei unter Verwendung des Kontroversen-Ratings von Sustainalytics alle Unternehmen, die mit einem Score von 5 oder höher identifiziert wurden, sofort aus dem Index entfernt werden.

Die Methodik umfasst auch eine Kennzeichnung zum Entfernen von Unternehmen, die nicht die Prinzipien des UN Global Compact einhalten, welche standardmäßig Aktivitäten in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung umfasst. Dies sind auch Themen, die auch von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden.

Weitere Informationen zu den verwendeten Benchmarks, Daten und Standards sind auf der Website des Indexanbieters verfügbar.

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.



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

☐ Ja_

☒ Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Fonds wird passiv verwaltet. Das Anlageziel der Fonds ist es, die Performance des Index nachzubilden und gleichzeitig den Tracking Error zwischen der Performance des Fonds und des Index so weit wie möglich zu minimieren.

Der Index ist ein Aktienindex, der die weltweiten Aktienmärkte repräsentiert, wie vom Indexanbieter festgelegt. Der Index verwendet neben einer Reihe von ESG-bezogenen Kriterien einen Bewertungs-, Rating- und ausschlussbasierten Ansatz, der unter anderem Unternehmen berücksichtigt, die in der globalen Klimatechnologiebranche tätig und für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft entscheidend sind.

Die nach Anwendung der oben genannten Kriterien verbleibenden Unternehmen kommen für eine Aufnahme in den Index in Frage. Die in Frage kommenden Unternehmen werden nach Streubesitz-Marktkapitalisierung eingestuft und weisen einen Klimatechnologie-Score auf.

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?**

Die verbindlichen Elemente der Strategie sind wie folgt:

1. Ein Unternehmen muss von CTA als Klimatechnologieunternehmen klassifiziert werden und insbesondere in eine der folgenden Kategorien fallen, um in den Index aufgenommen zu werden:

Enabler

Stromquellen und Stromspeicher – Unternehmen, die den Bereichen Stromquellen und Stromspeicher zugeordnet werden, ermöglichen den Übergang zu saubereren Energiequellen in der gesamten Wirtschaft, einschließlich in der Industrie, in Gebäuden (z. B. Wohn- und Gewerbegebäuden) und im Transportwesen. Stromquellen und Stromspeicher umfassen Unternehmen, die in den Bereichen Biokraftstoffe, Batterietechnologie, Brennstoffzellen, grüner Wasserstoff, Energiemanagement (einschließlich stromfokussierter Halbleiter) und Stromerzeugung aus erneuerbaren Quellen (z. B. Wasserkraft, Solar- und Windenergie) tätig sind.

Engager

Klima-Infrastruktur – Unternehmen, die dem Bereich Klima-Infrastruktur zugeordnet werden, beschäftigen sich mit Technologien, die sich auf die Reduzierung der Kohlenstoffauswirkungen von gewerblichen, industriellen und Wohngebäuden konzentrieren, einschließlich durch fortschrittliche Baumaterialien und mechanische Systeme (z. B. Heizung, Kühlung, Lüftung, Sanitär und Elektrik), Ladeinfrastruktur für Elektrofahrzeuge (z. B. öffentliche und private Ladelösungen), Prozessverbesserungen (z. B. Agrar-, Elektro- und Materialtechnologien, die die Kohlenstoffauswirkung bestehender Baumethoden verbessern) und intelligente Städte/Stromnetze (z. B. Netzkommunikation und -Intelligenz, Laststeuerung, intelligente Messung).

Enhancer

Anpassung – Unternehmen, die dem Bereich Anpassung zugeordnet werden, bieten Beratungs-, Technologie- und/oder Softwarelösungen für Kunden an, um Projekte in Industrie, Gebäuden und Transportwesen zu entwickeln, zu bauen und nachzurüsten, darunter Weiterentwicklungen bei der Bereitstellung erneuerbarer Energien, der Stromerzeugung und dem Energieverbrauch.

Agrar- und Lebensmitteltechnologie (AgTech & FoodTech) – Unternehmen, die dem Bereich AgTech & FoodTech zugeordnet werden, befassen sich vornehmlich mit Technologien zur Reduzierung von Kohlenstoff- und Methanemissionen durch die Entwicklung von Produkten, die den herkömmlichen Fleischkonsum verdrängen sollen (z. B. alternative/pflanzliche Proteine und zelluläre Landwirtschaft als Ersatz für Rind-, Hühner-, Schweine- und Putenfleisch usw.), sowie mit Technologien zur Verringerung der Intensität herkömmlicher Anbaumethoden und der damit verbundenen logistischen/transportbedingten Auswirkungen durch den Einsatz von Indoor- und vertikalen Anbaumethoden.

Transport – Unternehmen, die dem Bereich Transport zugeordnet werden, fördern die Entwicklung von weniger kohlenstoffintensiven Transportprodukten (z. B. Batterien, Brennstoffzellen, erneuerbare Energien), einschließlich Makromobilität (z. B. Passagierflugzeuge, Busse, Züge und andere Formen des Massentransports) und Mikromobilität (Lufttaxis/Senkrechtstarter und Landbahnfahrzeuge, Pkw und Motorräder, Liefer-/Flotten-/Logistik-/Last-Mile-Lkw und -Fahrzeuge).

2. Es werden die folgenden ESG-Ausschlüsse angewendet:

- a) Unternehmen, die an umstrittenen Waffen beteiligt sind;
- b) Unternehmen, die an der Stromerzeugung, Stromerzeugungskapazität oder Förderung von Kraftwerkskohle beteiligt sind;
- c) Unternehmen, die die Prinzipien des UN Global Compact nicht einhalten;
- d) Unternehmen mit einem Sustainability Kontroversen-Score von 5;
- e) Unternehmen, die an Exploration und Produktion, Raffination, Transport und/oder Lagerung von Öl und Gas beteiligt sind; und
- f) Unternehmen, die an der Cannabisproduktion beteiligt sind und/oder eine bedeutende Beteiligung an einem anderen Unternehmen mit Beteiligung an der Entwicklung und dem Anbau von Cannabis haben.

Was „beteiligt“ bedeutet, wird vom Indexanbieter festgelegt. Einzelheiten zu den für die ESG-Ausschlüsse geltenden Umsatzschwellen sind der Indexmethodik zu entnehmen.

• Jedes verbleibende Wertpapier erhält dann einen Klimatechnologie-Score, der Folgendes umfasst:

• Thematischer Umsatz-Score – Der thematische Umsatz-Score ist eine quantitative Bewertung des geschätzten Umsatzanteils jedes Unternehmens, der aus der Klimatechnologie stammt.

- 0-24,9 %: 0
- 25-49,9 %: 1
- 50-74,9 %: 2
- 75-100 %: 3

• Übergangs-Score - Der Übergangs-Score ist eine qualitative Bewertung des Grades des Übergangs zu einem vollständig kohlenstoffneutralen Produkt- und Dienstleistungsportfolio jedes Unternehmens.

- Niedrig: 1
- Mittel: 2
- Hoch: 3

• Innovations-Score – Der Innovations-Score ist eine qualitative Bewertung der Auswirkungen jedes Unternehmens hinsichtlich des Erreichens von Kohlenstoffneutralität.

- Niedrig: 1
- Mittel: 2
- Hoch: 3

Alle übrigen Unternehmen werden wie folgt kategorisiert: (i) Tier 1; (ii) Tier 2; oder (iii) keiner der erstgenannten, basierend auf ihrem Klimatechnologie-Score:

• Ein Tier-1-Unternehmen erzielt mindestens 50 % seines Umsatzes mit Klimatechnologie, wie vom Indexanbieter definiert (Thematischer Umsatz-Score ≥ 2).

• Ein Tier-2-Emittent erzielt 25–50 % seines Umsatzes mit Klimatechnologie ($2 > \text{Thematischer Umsatz-Score} \geq 1$), und die Summe aus Übergangs-Score und Innovations-Score ist mindestens 4.

Alle Unternehmen, die die Liquiditätskriterien erfüllen, nicht anderweitig aus ESG-Gründen ausgeschlossen sind und als Tier 1 oder Tier 2 eingestuft werden, werden in den Index aufgenommen.

Die maximale Wertpapiergewichtung wird 4,5 % nicht überschreiten.

Die Zusammensetzung des Index wird halbjährlich im Juni und Dezember neu gewichtet.

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 Fonds verfügt nicht über einen zugesagten Mindestsatz, um den Umfang der Investitionen zu reduzieren.

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

Die folgenden Unternehmensführungsfaktoren werden als Teil der Indexmethodik betrachtet:

- o Schwerwiegende ESG-Kontroversen
- o Compliance-Bewertung des Global Compact der Vereinten Nationen

Die Unternehmensführung wird anhand der im Investitionsprozess festgelegten Kriterien bewertet, zu denen unter anderem Geschäftsethik, Kultur und Werte, gute Unternehmensführung sowie Bekämpfung von Bestechung und Korruption gehören. Kontroversen und Reputationsrisiken werden durch eine verstärkte Due-Diligence-Prüfung sowie durch Screening-Verfahren beurteilt, die zur Identifizierung von Emittenten verwendet werden, von denen angenommen wird, dass sie niedrige Governance-Bewertungen aufweisen. Diese Emittenten werden dann einer weiteren Überprüfung, weiteren Maßnahmen und/oder weiterem Engagement durch den Anlageverwalter unterzogen.

Gute Unternehmensführung ist seit langem Bestandteil der eigenen fundamentaldatenbasierten Unternehmensanalysen des Anlageverwalters. Das Stewardship-Team des Anlageverwalters trifft sich regelmäßig mit den Unternehmen, um das Verständnis für deren Geschäft und Strategie zu verbessern, Unterstützung oder Bedenken des Anlageverwalters in Bezug auf die Maßnahmen des Managements zu signalisieren und bewährte Verfahren zu bewerben. Der Anlageverwalter ist der Ansicht, dass eine gute Unternehmensführung sicherstellt, dass Unternehmen im Einklang mit den langfristigen Interessen ihrer Anleger verwaltet werden.

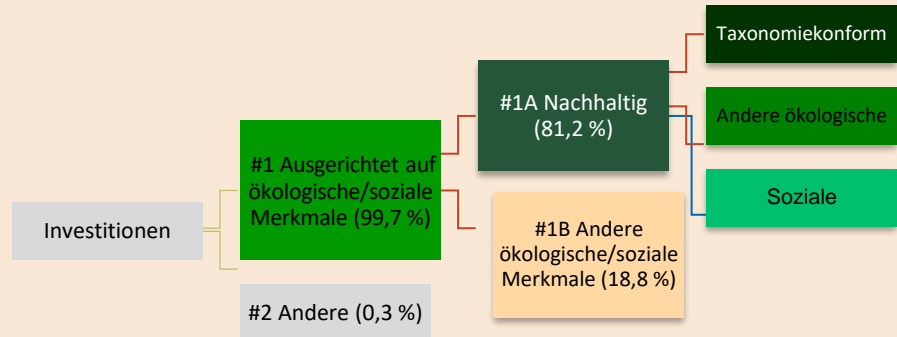


Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

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

Taxonomiekonforme 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 Portfoliounternehmen widerspiegeln.



#1 „Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale“ umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

„#2 Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie „**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale**“ deckt Folgendes ab:

- Die Unterkategorie „**#1A Nachhaltige Investitionen**“ umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B „Andere ökologische/soziale Merkmale“** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

Der Fonds verwendet keine Derivate, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu erreichen.



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

N. z. Der Fonds beabsichtigt nicht, sich zu einem Mindestanteil nachhaltiger 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?

☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

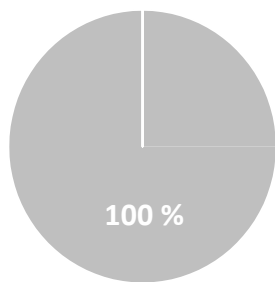
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend daraufhin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

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



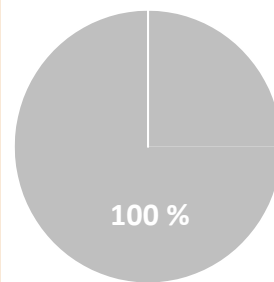
sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)
■ Nicht taxonomiekonform

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

N. z. Der Fonds hat keinen bestimmten Mindestanteil an Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten festgelegt.



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

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



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

N. z. Der Fonds beabsichtigt nicht, sich zu einem Mindestanteil an sozial nachhaltigen Investitionen zu verpflichten.



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

Zahlungsmittel und andere Instrumente wie American Depositary Receipts, European Depositary Receipts und Global Depositary Receipts, zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen und/oder Finanzderivate können für Liquidität, Hedging und ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, wobei diesbezüglich kein ökologischer und/oder sozialer Mindestschutz besteht.

Für diese Investitionen gibt es keinen ökologischen 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 Ziel des Fonds besteht darin, die Performance der Netto-Gesamtrendite des NASDAQ CTA Global Climate Technology Index nachzubilden.

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

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

Ein Unternehmen muss von CTA als Klimatechnologieunternehmen klassifiziert werden und insbesondere in eine der folgenden Kategorien fallen, um in den Index aufgenommen zu werden.

CTA legt fest, welche Unternehmen als Klimatechnologieunternehmen klassifiziert werden. Diese bilden dann das investierbare Universum des Indexanbieters (das „anfängliche investierbare Universum“). Unternehmen werden von CTA auf der Grundlage verschiedener Faktoren ausgewählt, darunter Umsatz, Marktanteil, Finanzberichte, Fusionen und Übernahmen, Marktkapitalisierung, Patente, Produkteinführungen und andere frei zugängliche und öffentlich verfügbare Daten. CTA erhält diese Daten durch Datenabonnements, öffentliche Datenquellen und Datenüberwachung, um das investierbare Universum zu identifizieren.

Der Index verwendet einen Bewertungs-, Rating- und ausschlussbasierten Ansatz, der unter anderem die Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Wirtschaft berücksichtigt.

Der Index wird halbjährlich neu gewichtet. Dies erfolgt gemäß den von NASDAQ festgelegten veröffentlichten Regeln zum Management des Index. Weitere Informationen über den Index, seine Bestandteile, die Häufigkeit seiner Neugewichtung und seine Performance sind auf der Website des Indexanbieters zu finden:

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

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. Die Zusammensetzung des Index wird halbjährlich neu ausgerichtet und erfolgt gemäß den von NASDAQ festgelegten veröffentlichten Regeln zum Management des Index.

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

Der Index ist ein modifizierter, nach Streubesitz-Marktkapitalisierung gewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung einer Auswahl von im Bereich der globalen Klimatechnologie tätigen Unternehmen zu messen, die für den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Weltwirtschaft von entscheidender Bedeutung sind, wie vom Indexanbieter festgelegt. Die Unternehmen werden auf der Grundlage der Klassifizierung durch die Consumer Technology Association (CTA) für die Aufnahme in den Index ausgewählt, wie vorstehend näher ausgeführt.

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

<https://indexes.nasdaqomx.com/Index/Overview/CLMTCHN> (für Indexbestandteile, Datenblätter, Indexmethodik und sonstige Informationen).

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 sind abrufbar unter:

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:
www.assetmanagement.hsbc.com