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 USA Screened Equity 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-Vorschriften 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 USA Screened Equity UCITS ETF (der „Fonds“), einem separaten Teilfonds der Gesellschaft, dem die HSBC USA Screened Equity 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, Bankmanager, 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.

Interessierte 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 Direkthandels- (Bartransaktions-) Gebühr von bis zu 3 % der Zeichnungs- und Rücknahmebeträge anfällt, wenn Anteile direkt mit dem Fonds gehandelt werden.

Der FTSE USA ESG Low Carbon Select Index profitiert auf keine Weise von der Förderung, Unterstützung oder Werbung und wird von FTSE International Limited (nachstehend „FTSE“), London Stock Exchange Plc, The Financial Times Limited oder Research Affiliates LLC (zusammen die „Inhaber“) nicht angeboten. Die Inhaber geben keine Garantie und machen keine ausdrückliche oder stillschweigende Zusage hinsichtlich der Erträge, die durch die Verwendung des FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (nachfolgend der „Index“) erzielt werden können, und/oder hinsichtlich der Positionierung des Index zu einem bestimmten Zeitpunkt oder Tag oder anderweitig. Der Index wird von oder im Namen von FTSE berechnet. Die Inhaber sind nicht haftbar (selbst bei Fahrlässigkeit oder aus einem anderen Grund) für irgendwelche Fehler im Index und sind nicht verpflichtet, irgendjemanden über die Fehler im Index zu benachrichtigen. „FTSE®", „FT-SE®“ und „Footsie®“ sind eingetragene Marken von London Stock Exchange Plc und The Financial Times Limited, die FTSE ihre Verwendung gestatten. „RAFI™“ und „Research Affiliates™“ sind Marken von Research Affiliates LLC, die FTSE ihre Verwendung gestatten.

INHALT

Seite

ALLGEMEINE INFORMATIONEN 3
ANLAGEZIELE UND ANLAGEPOLITIK 6
ANLAGERISIKEN 8
ZEICHNUNGEN 9
UMTAUSCH 10
RÜCKNAHMEN 11
GEBÜHREN UND KOSTEN 11
DIE ANTEILSKLASSEN 11
INDEXBESCHREIBUNG 12

PUBLIC

ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Für den Fonds gelten die folgenden Bestimmungen:

Basiswährung	US-Dollar („**USD**“)
Bewertungszeitpunkt	23.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag. 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 oder ein anderer Tag bzw. andere Tage, den/die der Verwaltungsrat festlegt, ausgenommen von Tagen, an denen die wichtigen Märkte geschlossen sind und/oder der Index nicht verfügbar ist. Dies muss dem Anteilinhaber 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 die für angemessener erachtet.
Handelsschluss	16.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag (sofern vom Verwaltungsrat nichts anderes beschlossen und dem Anteilinhaber im Voraus nichts anderes mitgeteilt wurde und in jedem Fall vor dem Bewertungszeitpunkt) für die Basiswährung und nicht währungsgesicherte Anteilsklassen und 14.30 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag (sofern vom Verwaltungsrat nichts anderes beschlossen und dem Anteilinhaber im Voraus nichts anderes mitgeteilt wurde und in jedem Fall vor dem Bewertungszeitpunkt) für abgesicherte Anteilsklassen. 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 dem Anteilinhaber im Voraus mitteilt, wobei innerhalb von 14 Tagen mindestens ein (1) Tag ein Handelstag sein muss.
Index	FTSE USA ESG Low Carbon Select Index
Indexanbieter	FTSE International Limited
Nachbildung	Der Fonds ist bestrebt, im selben Verhältnis in die Bestandteile des Index zu investieren, wie diese im Index vertreten sind. Es können jedoch Umstände bestehen, in denen es für den Fonds nicht möglich oder praktikabel ist, in alle Bestandteile des

PUBLIC

	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.
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	Die Anlage in den 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 den Fonds sollte ein Anleger seine Toleranz gegenüber den täglichen Kursschwankungen am Markt abwägen. Die Anleger sollten bereit sein, Verluste zu tragen. Die Anteile des Fonds werden sowohl privaten als auch institutionellen Anlegern angeboten.
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.

PUBLIC

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 spätestens 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

PUBLIC

ANLAGEZIELE UND ANLAGEPOLITIK

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Performance des FTSE USA ESG Low Carbon Select 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 Teilindex des FTSE USA Index (der „**Hauptindex**“) und misst die Performance von Unternehmen in den Vereinigten Staaten, wie vom Indexanbieter definiert. Wie im Abschnitt „**Indexbeschreibung**“ des Nachtrags beschrieben, prüft der Indexanbieter einmal jährlich alle Wertpapiere anhand von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien und gewichtet die Unternehmen, um das Engagement in Unternehmen mit höheren CO2-Emissionen und fossilen Brennstoffreserven innerhalb des Index zu verringern und das Engagement in Bezug auf die Einhaltung günstiger FTSE Russell-Ratings für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („**ESG**“) im Vergleich zum Hauptindex zu verbessern. Darüber hinaus werden die Ausschlusskriterien des United Nations Global Compact (UNGC) vierteljährlich (d. h. zu jedem Neugewichtungstermin) auf den Index angewandt.

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

Um seine Anlageziele zu erreichen, strebt der Fonds Anlagen in die Bestandteile des Index an, die in der Regel den Verhältnissen entsprechen, in denen die sie im Index enthalten sind. Der Fonds bewirbt 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.

Der Fonds wird die erhöhten Diversifizierungsgrenzen gemäß Vorschrift 71 der OGAW-Vorschriften nutzen und es ist auch möglich, dass er aufgrund außergewöhnlicher Marktbedingungen bis zu 35 % des Nettoinventarwerts des Fonds in einem Bestandteil des Index hält, der von demselben Emittenten begeben wird (d. h., der Emittent macht einen ungewöhnlich großen Anteil an diesem vom Index gemessenen Markt aus).

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 und 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 Größenverhältnissen 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 die zugrunde liegende Exposure 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, angezeigt sowie auf zahlreichen Websites, die Aktienmarktdaten enthalten, darunter www.reuters.com. Für den Fonds gelten die für bestimmte Indexfonds geltenden höheren Anlagegrenzen wie in Absatz 4 des Abschnitts „**Anlagebeschränkungen**" im Prospekt beschrieben.

Der Fonds kann Derivate, einschließlich unter anderem Futures, Terminkontrakte, Devisenkontrakte (einschließlich Kassa- und Terminkontrakte), Aktienoptionen, Differenzkontrakte, Total Return Swaps, Zertifikate, Schuldverschreibungen und Optionsscheine einsetzen, die dazu verwendet werden können, den Tracking Error zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu reduzieren. 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 Derivate einsetzt, besteht eventuell das Risiko, dass die Volatilität des Fonds zunimmt. Es wird jedoch nicht davon ausgegangen, dass der Fonds aufgrund seiner Nutzung von Derivaten oder seiner Anlagen in diese ein überdurchschnittliches Risikoprofil aufweisen wird. Derivate werden innerhalb der von der irischen Zentralbank vorgegebenen Grenzen und wie im Prospekt im Abschnitt „**Einsatz von Derivaten**" dargelegt eingesetzt. Dementsprechend besteht, obwohl Derivate eine Hebelung bewirken können, der primäre Zweck der Verwendung von Derivaten darin, den Tracking Error zu verringern, und obwohl der Fonds infolge seiner Anlagen in Derivaten eine Hebelwirkung aufweisen wird, darf das mittels des Commitment-Ansatzes berechnete, durch Derivate bedingte Gesamtrisiko des Fonds (wie in den OGAW-Vorschriften der Zentralbank vorgeschrieben) 100 % des Gesamtnettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

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-Vorschriften. 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. Differenzkontrakte und Total Return Swaps können zur Absicherung verwendet werden oder anstelle eines physischen Wertpapiers, um ein Engagement gegenüber einem bestimmten Aktienwert zu erzielen. Zertifikate können anstelle von physischen Wertpapieren eingesetzt werden, um ein Engagement in einer Aktie oder einem Aktienkorb zu erzielen. Schuldverschreibungen und Optionsscheine können anstelle eines physischen Wertpapiers verwendet werden, um ein Engagement gegenüber 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 Nettoinventarwerts 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, wie beispielsweise die Richtlinie von HSBC Global Asset Management in Bezug auf verbotene Waffen (gemäß Angaben im Prospekt im Abschnitt: ANLAGEBESCHRÄNKUNGEN – Sonstige Beschränkungen) 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 Index wird vierteljährlich neu ausgerichtet, um die oben beschriebenen Ausschlusskriterien sowie Änderungen des Hauptindex zu berücksichtigen, und das Anlageportfolio des Fonds wird danach so schnell wie möglich neu ausgerichtet.

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 0,10 %. 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 Wertentwicklung schließen.

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

Total Return Swaps, Differenzkontrakte 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 und Differenzkontrakten anlegen, wobei jedoch im Allgemeinen nicht davon auszugehen ist, dass solche Anlagen 5 % des Nettovermögens des Fonds übersteigen.

ANLAGERISIKEN

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

Risiken in Verbindung mit Derivaten

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

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

Der Index

Die Anlage in den 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.

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, der vom 1. Mai 2025 bis zum 31. Oktober 2025 (oder einem anderen Datum, das vom Verwaltungsrat festgelegt werden kann) läuft, ausgegeben. Danach werden Fondsanteile zum Nettoinventarwert je Anteil zuzüglich eines angemessenen Betrags für Gebühren und Abgaben und gemäß den im Prospekt und in diesem Nachtrag dargelegten Bestimmungen ausgegeben.

Die USD-Anteilsklasse des Fonds wird zum Nettoinventarwert je Anteil zuzüglich eines angemessenen Betrags für Gebühren und Abgaben und gemäß den im Prospekt und in dem Nachtrag dargelegten Bestimmungen ausgegeben.

Handelsterminplan

Frist für Antragsformular für alle Zeichnungen	16.00 Uhr (irische Ortszeit) an jedem Handelstag für die Basiswährung und nicht währungsgesicherte Anteilsklassen; 14.30 Uhr (irische Ortszeit) für abgesicherte Anteilsklassen.
Barzeichnungen – Eingangsfrist für Bargeld	Bis 15.00 Uhr (irische Ortszeit) innerhalb von einem Geschäftstag 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 einem Geschäftstag nach dem Handelstag oder einem anderen, eventuell vom Verwaltungsrat festgelegten Datum, vorausgesetzt, dass die entsprechenden frei verfügbaren Zeichnungsgelder für Barzeichnungen (einschließlich des Baranteils einer Zeichnung gegen Sacheinlagen, wo relevant) vor Ablauf der Abrechnungsfrist der maßgeblichen Clearing-Plattform eingegangen sind, oder bis 15.00 Uhr (irische Ortszeit) bei elektronischen 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). Unabhängig von der Vorgehensweise müssen

	Zeichnungen am selben Geschäftstag nach dem Handelstag, an dem die Abrechnung erforderlich ist, ausgeführt werden, sofern der USD-Devisenmarkt an diesem Tag nicht geschlossen ist. Falls Letzteres der Fall ist, erfolgt die Abrechnung am auf die Schließung des USD-Devisenmarktes folgenden Geschäftstag.

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, kann der Anteilinhaber beantragen, seine 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 der Anteilinhaber den Umtausch von Anteilen zur Erstanlage in einen Teilfonds der Gesellschaft beantragt, sollte er 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 Anteilsumtauschs 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

Der Anteilinhaber kann 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 zehn 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 währungsgesicherte Anteilsklassen	Bis zu 0,12 %
Abgesicherte Anteilsklassen	Bis zu 0,15 %

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 hat verschiedene Anteilsklassen, die im Abschnitt „Die Anteile“ des Prospekts beschrieben werden. Zum Datum des Nachtrags können nur bestimmte Anteilsklassen zur Zeichnung verfügbar sein. Zusätzliche Anteilklassen können in Zukunft in Übereinstimmung mit den Auflagen der Zentralbank hinzugefügt werden. Eine aktuelle Liste der aufgelegten Anteilsklassen 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	IE00BKY40J65
CHF Hedged	Eine auf CHF abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
EUR Hedged	Eine auf EUR abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
GBP Hedged	Eine auf GBP abgesicherte Klasse	Thesaurierend	
USD	Eine auf die Basiswährung lautende Klasse	Ausschüttend	
CHF Hedged	Eine auf CHF abgesicherte Klasse	Ausschüttend	
EUR Hedged	Eine auf EUR abgesicherte Klasse	Ausschüttend	
GBP Hedged	Eine auf GBP abgesicherte Klasse	Ausschüttend	

Ausschüttungsanteile zahlen in der Regel Dividenden auf halbjährlicher Basis im Januar/Februar und Juli/August gemäß dem Abschnitt „Ausschüttungspolitik“ des Prospekts.

Informationen über währungsabgesicherte Klassen befinden sich unter der Überschrift „Devisengeschäfte“ 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 USD-Anteilsklassen wurde am 5. Juni 2020 in die amtliche Liste der UK 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

*Dieser Abschnitt fasst die wesentlichen Merkmale des FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (der „**Index**“) zusammen und stellt keine vollständige Beschreibung des Index dar.*

Allgemeines

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

Der Index strebt eine Reduzierung der CO2-Emissionen und der Belastung durch fossile Brennstoffreserven und eine Verbesserung des ESG-Ratings des FTSE Russell Index im Vergleich zum Hauptindex an.

Der Index erreicht dies auf folgende Weise:

1. Jedes Jahr im September werden Titel aufgrund von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien aus dem Index gestrichen. Die folgenden Arten von Unternehmen werden jährlich aufgrund von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien aus dem Index gestrichen, wobei für einige Kriterien Schwellenwerte gelten können:

    a. Unternehmen, die an der Lieferung von wesentlichen Waffensystemen oder Komponenten/Dienstleistungen, die als maßgeschneidert und wesentlich für verbotene und umstrittene Waffen angesehen werden (darunter Anti-Personen-Minen, blendende Laserwaffen, Atomwaffen, Streuwaffen, biologische und chemische Waffen, abgereichertes Uran, nicht aufzuspürende Fragmente, und weiße Phosphor-Munition) beteiligt sind;
    b. Unternehmen, die an der Herstellung von Tabakerzeugnissen beteiligt sind;
    c. Unternehmen, die an der Bereitstellung maßgeschneiderter Produkte und/oder Dienstleistungen oder maßgeschneiderter Komponenten für konventionelle Militärwaffen beteiligt sind;
    d. Unternehmen, die an der Förderung von und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle beteiligt sind;
    e. Unternehmen, die an der Stromerzeugung aus Kernkraft beteiligt sind; und
    f. Unternehmen, die gegen eines oder mehrere der Prinzipien des United Nations Global Compact (weithin akzeptierte Nachhaltigkeitsprinzipien in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) verstoßen;
    g. Unternehmen, die am Besitz oder Betrieb einer Glücksspieleinrichtung beteiligt sind oder spezielle Produkte ausschließlich für den Glücksspielbereich herstellen oder unterstützende Produkte/Dienstleistungen für den Glücksspielbetrieb bereitstellen; und
    h. Unternehmen, die an der Produktion oder dem Betrieb von Einrichtungen für Unterhaltung für Erwachsene oder am Vertrieb von Unterhaltungsmaterial für Erwachsene beteiligt sind.

2. Jedes Jahr im September werden die Gewichtungen der verbleibenden Unternehmen innerhalb des Hauptindex entsprechend den CO2-Emissionen[1], der Belastung durch fossile Brennstoffreserven und nach Kriterien [2]auf Basis der ESG-Ratings des FTSE Russell angepasst. Der Index zielt auch darauf ab, branchenbezogene Abweichungen gegenüber dem Hauptindex zu begrenzen, indem er Aktiengewichtungen von höchstens 10 % und mindestens 0,5 Basispunkten aufrecht erhält[3]; und

3. Einmal im Vierteljahr werden Unternehmen, die als nicht konform mit einem oder mehreren der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen angesehen werden, aus dem Index gestrichen.

Aufgrund der oben genannten Bewertungskriterien und Ausschlüsse wird der Index eine geringere Anzahl von Bestandteilen haben als der Hauptindex. Er wird daher wahrscheinlich ein anderes Performance- und Risikoprofil aufweisen. Da einige der Ausschlüsse erst nach der jährlichen Neugewichtung angewendet werden, ist es zudem unwahrscheinlich, dass der Index die Begrenzungskriterien des Hauptindex aufrecht erhalten kann. Darüber hinaus kann sich das Ausmaß der ESG-Verbesserungen, der CO2-Reduzierung und der Belastung durch fossile Brennstoffreserven gegenüber den ursprünglich festgelegten Werten ändern. Alle oben genannten Werte variieren auch im Laufe der Zeit aufgrund der Aktienkursbewegungen.
Der Index wird vierteljährlich (d. h. im März, Juni und Dezember) neu ausgerichtet, um die oben beschriebenen UNGC-Ausschlusskriterien sowie Änderungen des Hauptindex zu berücksichtigen. Die CO2-Bilanz, die Belastung durch fossile Brennstoffreserven und das FTSE Russell ESG-Rating jedes Unternehmens werden jährlich bewertet.

Veröffentlichung des Index

---

[1] CO2-Emissionen werden als Scope-1- und Scope-2-Emissionen gemäß dem Greenhouse Gas (GHG) Protocol gemessen und als operative CO2-Emissionen in Tonnen pro Million Dollar Umsatz berechnet.

[2] Jedes Unternehmen im Index erhält ein ESG-Rating auf Basis der ESG-Ratings des FTSE Russell. Bei Unternehmen mit einem höheren ESG-Rating wird die Gewichtung erhöht, während die Gewichtung von Unternehmen mit einem niedrigeren ESG-Rating verringert wird.

[3] Die Gewichtung von Branchen (und Aktien) wird sich aufgrund der Anwendung der Ausschlusskriterien und auch aufgrund von Aktienkursbewegungen gegenüber dem Hauptindex verändern.

Der Index wird täglich auf Basis der Schlusskurse berechnet, wobei die offiziellen Schlusskurse der im Index enthaltenen Aktien verwendet werden. Des Weiteren wird der Index an jedem Handelstag auf Echtzeitbasis berechnet. Der Schlusskurs des Index, seine Bestandteile, die Häufigkeit seiner Neuausrichtung und seine Performance sind auf der Website von FTSE® angegeben: https://www.ftserussell.com/.

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