

ANHANG IV

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

Name des Produkts:
HSBC Euro Liquidity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800Y5VFXSGTYG1N11

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

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
☒ ☐ Ja	☒ ☒ Nein
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ____ % an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel 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	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ mit einem sozialen Ziel
	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



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

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Geschäftsjahres zum 30. April 2024 (der Bezugszeitraum) bewarb der Fonds¹ die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

1. Der Fonds prüfte und analysierte alle Emittenten im Hinblick auf ökologische Merkmale, insbesondere physische Risiken durch den Klimawandel und Personalmanagement.

¹ Mit Wirkung vom 24. April 2024 wurde der Fonds neu eingestuft, so dass er nun ökologische und/oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung (SFDR) bewirbt.

2. Der Fonds berücksichtigte verantwortungsvolle Geschäftspraktiken von Emittenten im Einklang mit den Grundsätzen des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC). Wurden potenzielle Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC festgestellt, wurden die Emittenten einer eigenen Due-Diligence-Prüfung hinsichtlich ESG-Themen unterzogen, um festzustellen, ob sie für die Aufnahme in das Portfolio des Fonds geeignet sind, und sie auszuschließen, falls sie als ungeeignet erachtet wurden.
3. Der Anlageverwalter berücksichtigte aktiv ökologische und/oder soziale Aspekte durch Engagement bei einer bestimmten Reihe von Emittenten, das von den HSBC-Teams für Credit Research, Engagement und Stewardship durchgeführt wurde. Das Engagement konzentrierte sich auf die spezifischen Faktoren, die zum Ausschluss der Emittenten von der Liste der zugelassenen Emittenten mit ESG-Beschränkungen des Anlageverwalters führten. Darüber hinaus berücksichtigte der Anlageverwalter klimabezogene Fragen, die Mitgliedschaft eines Emittenten in der Net Zero Banking Alliance, die Veröffentlichung zuverlässiger und konsistenter Scope-3-Treibhausgasemissionsdaten und den Klima-Anpassungs-Score eines Emittenten.
4. Der Fonds schloss Aktivitäten aus, die unter die Richtlinien für verantwortungsbewusstes Investieren von HSBC Asset Management (HSBC) fallen (ausgeschlossene Aktivitäten). Zu den ausgeschlossenen Tätigkeiten des Fonds während des Bezugszeitraums gehörten:

Ausgeschlossene Aktivität	Einzelheiten
Verbotene Waffen	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC an der Entwicklung, Produktion, Nutzung, Wartung, dem Verkaufsangebot, Vertrieb, Import oder Export, der Lagerung oder dem Transport verbotener Waffen beteiligt sind.
Umstrittene Waffen	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC an der Herstellung von umstrittenen Waffen oder von deren Hauptkomponenten beteiligt sind. Umstrittene Waffen sind unter anderem Antipersonenminen, Waffen mit abgereichertem Uran und weißer Phosphor, wenn dieser für militärische Zwecke verwendet wird.
Kraftwerkskohle 1 (Ausweitung)	Der Fonds nahm nicht an Börsengängen (Initial Public Offerings, IPOs) oder primären Festzinsfinanzierungen von Emittenten teil, die HSBC als an der Ausweitung der Kraftwerkskohleproduktion beteiligt erachtete.
Kraftwerkskohle 2 (Umsatzschwelle)	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, von denen HSBC annahm, dass sie über mehr als 10 % ihres Umsatzes aus der Verstromung oder Förderung von Kraftwerkskohle generieren, und die nach Ansicht von HSBC keinen glaubwürdigen Übergangsplan haben.

Arktisches Öl und Gas	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC mehr als 10 % ihres Umsatzes aus der Öl- und Gasförderung in der Arktis erwirtschaften und nach Ansicht von HSBC keinen glaubwürdigen Übergangsplan haben.
Ölsande	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC mehr als 10 % ihres Umsatzes aus der Ölsandförderung erwirtschaften und nach Ansicht von HSBC keinen glaubwürdigen Übergangsplan haben.
Schieferöl	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC über mehr als 35 % ihres Umsatzes aus der Förderung von Schieferöl generieren, und die nach Ansicht von HSBC keinen glaubwürdigen Übergangsplan haben.
Tabak	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC direkt an der Produktion von Tabak beteiligt sind.
UNGC	Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die nach Ansicht von HSBC als nicht konform mit den Prinzipien des UNGC Global Compact angesehen werden.

Der Ausschluss der vorstehend genannten Tätigkeiten trat ab dem Datum der Neuklassifizierung am 24. April 2024 in Kraft. Vor diesem Datum schloss der Fonds Emittenten aus, die (1) für die Produktion von Tabak und umstrittenen Waffen verantwortlich waren und (2) wesentliche Einnahmen (im Allgemeinen mehr als 10 %) aus bestimmten Sektoren wie der Förderung von Kraftwerkskohle erzielten. Darüber hinaus schloss der Fonds Emittenten aus, die für die Herstellung von Atomwaffen verantwortlich sind.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Abschneiden der Nachhaltigkeitsindikatoren, die der Fonds zur Messung der Erreichung der von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet, ist in der folgenden Tabelle dargestellt. Der ESG-Score des Fonds sollte (als Gesamtwert) über dem durchschnittlichen ESG-Score des investierbaren Universums liegen (wobei ein höherer Score für bessere ESG-Daten steht). Die Vergleichswerte für ESG-Scores sind:

- Der ESG-Score des Fonds wurde im Verhältnis zum durchschnittlichen ESG-Score des investierbaren Universums unter Verwendung des MSCI Industry Adjusted (IA)-Score gemessen. Der ESG-Score ist ein Maß für das Risiko des Fonds in Bezug auf ökologische, soziale und Unternehmensführungsaspekte (Spanne von 0–10) und wird im Vergleich zu den Scores des mit A1/P1/F1 bewerteten investierbaren Universums von kurzfristigen Geldmarktfonds (das investierbare Universum) dargestellt.
- Die Berücksichtigung einzelner (in der nachstehenden Tabelle nummerierter) wichtigster nachteiliger Auswirkungen (PAI) drückt sich darin aus, dass der Fonds eine niedrigere prozentuale Gewichtung als das investierbare Universum aufweist. Die bei der Berechnung der PAI-Werte verwendeten Daten stammen von externen Datenanbietern. Sie können auf Emittentenangaben basieren oder von den Datenanbietern geschätzt werden, wo keine solchen Emittentenangaben vorliegen.

Bitte beachten Sie, dass es nicht immer möglich ist, die Richtigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit der von Drittanbietern bereitgestellten Daten zu garantieren.

Alle Emittenten haben eine gute Unternehmensführung bewiesen, was sich am PAI-Score 10 unten ablesen lässt.

Indikator	Fonds	Investierbares Universum
ESG-Score	5,85 %	5,68
PAI 10. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	0,00 %	1,67 %
PAI 14. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	0,00 %	1,37 %

Stand der Daten: 30. April 2024. Da der Fonds am 24. April 2024 gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung neu eingestuft wurde, ist keine mittlerer Durchschnitts-Score verfügbar.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Da es sich um den ersten regelmäßigen Bericht bezüglich der Offenlegungsverordnung handelt, ist kein Vergleich mit vorangegangenen Zeiträumen möglich.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung zu tätigen.

Der Anlageverwalter förderte unter anderem ökologische und soziale Merkmale und investierte in Emittenten, die eine gute Unternehmensführung praktizieren.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Diese Frage ist für diesen Fonds nicht zutreffend, wir bestätigen jedoch, dass wir nachhaltige Vermögenswerte darauf geprüft haben, ob sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen können. Dies erfolgte im Rahmen des Standard-Anlageprozesses von HSBC und unter Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Diese Frage trifft nicht zu, der Anlageverwalter hat jedoch die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren befolgt, in der festgelegt ist, wie HSBC die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen identifiziert und darauf reagiert, und in welcher Form HSBC Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt, die sich negativ auf Wertpapiere auswirken können, in die der Fonds investiert. HSBC identifizierte in Zusammenarbeit mit externen Datenanbietern, wie Sustainalytics und MSCI Unternehmen und Regierungen mit schlechter Bilanz beim Management von ESG-Risiken, und wo potenzielle wesentlichen Risiken identifiziert wurden, führte HSBC zusätzliche Due Diligence-Prüfungen durch. Durch Screening identifizierte Nachhaltigkeitsauswirkungen waren ein wichtiger Aspekt im Anlageentscheidungsprozess.

Der oben beschriebene Ansatz führte dazu, dass unter anderem folgende Faktoren geprüft wurden:

- Engagement der Emittenten für den Übergang zu CO2-armen Wirtschaften, zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern, Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus großen Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Unternehmensführung und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Leitungs- oder Kontrollorgans, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails; und

- Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit folgenden Bereichen: demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Korruptionsbekämpfung und Bestechung), politische Stabilität und Staatsführung.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Diese Frage ist nicht anwendbar, da sich der Fonds nicht verpflichtet hat, nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung zu tätigen. HSBC setzte sich jedoch für die Anwendung und Förderung globaler Standards ein und konzentrierte sich dabei auf die Richtlinie von HSBC für verantwortungsbewusstes Investieren, die die zehn Grundsätze des UNGC umfasst. Diese Grundsätze stehen in Zusammenhang mit nicht finanziellen

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

Risiken in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung. HSBC gehört darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment. Diese bildeten den Rahmen für Ermittlung und Management von Nachhaltigkeitsrisiken beim Investmentansatz von HSBC. Von Emittenten, in die der Fonds investierte, wurde erwartet, dass sie die Anforderungen des UNGC und der damit verbundenen Standards erfüllen. Emittenten, die eindeutig gegen einen der zehn Grundsätze des UNGC verstoßen haben, wurden systematisch ausgeschlossen, es sei denn, sie haben eine Due-Diligence-Prüfung in Bezug auf ESG-Themen durchlaufen, um ihre Eignung für die Aufnahme in das Portfolio des Fonds zu bestimmen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Hierbei gelten spezifische von der Union definierte Kriterien.

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

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



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte die folgenden PAI, indem er sie als Nachhaltigkeitsindikatoren beobachtete:

PAI 10 - Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD)

PAI 14 - Anteil der Investitionen mit Beteiligung an umstrittenen Waffen

Der Ansatz zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beinhaltete unter anderem, dass HSBC das Engagement der Emittenten für den Übergang zu CO₂-armen Wirtschaften, die zuverlässige Einhaltung von Menschenrechten und faire Behandlung von Mitarbeitern sowie die Implementierung strenger Vorgaben für Praktiken innerhalb der Lieferkette prüfte, die unter anderem darauf abzielen, Kinder- und Zwangsarbeit zu verhindern. HSBC legte darüber hinaus Wert auf robuste Strukturen in den Bereichen Unternehmensführung und Unternehmenspolitik, bezogen unter anderem auf die Themen Unabhängigkeit des Leitungs- oder Kontrollorgans, Achtung der Rechte der Anteilhaber, Vorhandensein und Umsetzung strenger Antikorruptions- und Bestechungsrichtlinien sowie Audit-Trails. Ebenfalls berücksichtigt wurde das Engagement von Regierungen für die Verfügbarmachung und Verwaltung von Ressourcen im Zusammenhang mit den Bereichen demografische Entwicklung, Humankapital, Bildung, Gesundheitsversorgung, neue Technologien, staatliche Vorschriften und Richtlinien (einschließlich Klimawandel, Bekämpfung von Korruption und Bestechung, politische Veränderung, politische Stabilität und Staatsführung).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Northern Trust Co/London	9,0 %	USA	Bank
Barmittel	6,1 %	USA	Bank
Societe Generale SA	5,0 %	FRANKREICH	Bank
Erste Group Bank AG/Hong Kong	2,5 %	ÖSTERREICH	Bank
Bank of China Ltd/Paris	2,5 %	CHINA	Bank
Bank of China Ltd/Paris	2,5 %	CHINA	Bank
KBC Bank NV	2,5 %	BELGIEN	Bank
Barclays Bank PLC	2,5 %	VEREINIGTES KÖNIGREICH	Bank
Jyske Bank A/S	1,5 %	DÄNEMARK	Bank
Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London	1,5 %	CHINA	Bank
Societe Generale SA	1,3 %	FRANKREICH	Bank
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale	1,2 %	FRANKREICH	Behörde
Mizuho Bank Ltd/London	1,2 %	JAPAN	Bank
France Treasury Bill BTF	1,1 %	FRANKREICH	Staatsanleihen
The Toronto-Dominion Bank	1,0 %	KANADA	Bank

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im folgenden Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:

30. April 2024



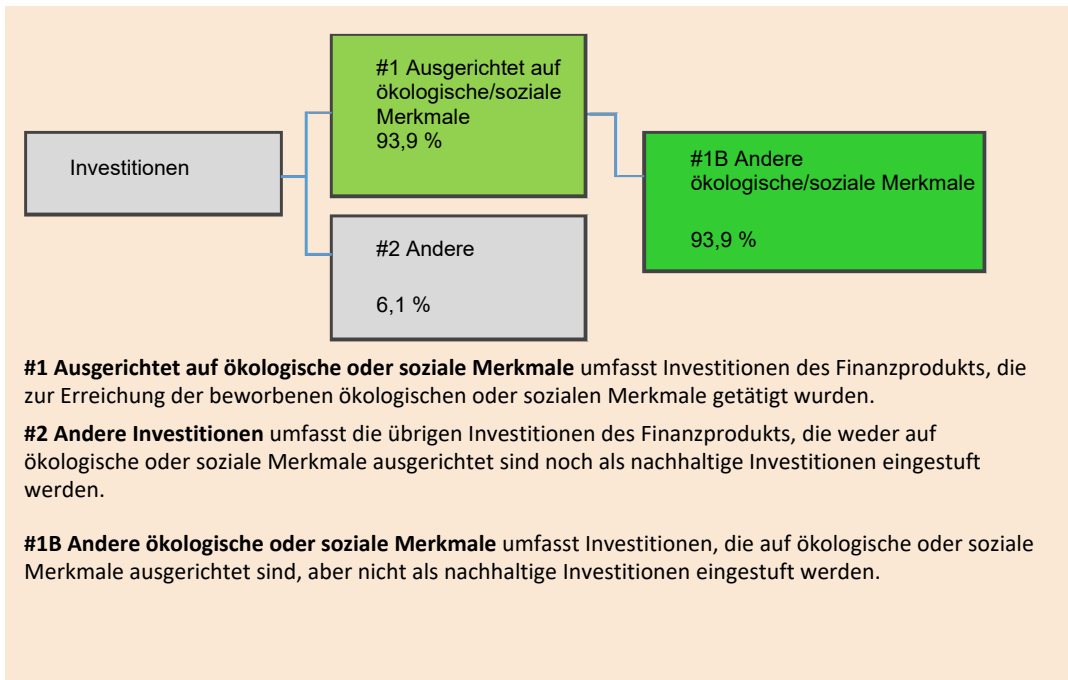
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Fonds hat sich nicht verpflichtet, mit nachhaltige Investitionen zu tätigen.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 51 % der Anlagen des Fonds bestanden aus kurzfristigen Wertpapieren, Instrumenten und Schuldverschreibungen, die zum Zeitpunkt des Erwerbs von hoher Qualität sind und gemäß der Geldmarktfondsverordnung für Anlagen in Frage kamen und die dazu verwendet wurden, die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale der

Anlagestrategie zu erfüllen (#1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale). (#2 Andere) umfasste Barmittel für Zwecke des Liquiditätsmanagements².



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

	% der Vermögenswerte
Behörde	3,5 %
Bank	86,4 %
Bank – Asset-Backed Commercial Paper	5,6 %
Unternehmen	2,7 %
Staatsanleihen	1,8 %
	100 %

² Die Daten in der Grafik, die diesem Abschnitt folgt, haben den Stand vom 30. April 2024, da der Fonds am 24. April 2024 gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung neu eingestuft wurde.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, 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.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend. Der Fonds bewarb zwar ökologische Merkmale, strebte aber keinen Mindestanteil nachhaltiger Investitionen an, die gemäß der Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten. Daher beträgt der Anteil ökologisch nachhaltiger Investitionen im Sinne der Taxonomieverordnung, die während des Bezugszeitraums nachgewiesen wurden, 0 % des Nettovermögens des Fonds.

☐ Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

☐

Ja:

☐

In fossiles Gas

☐

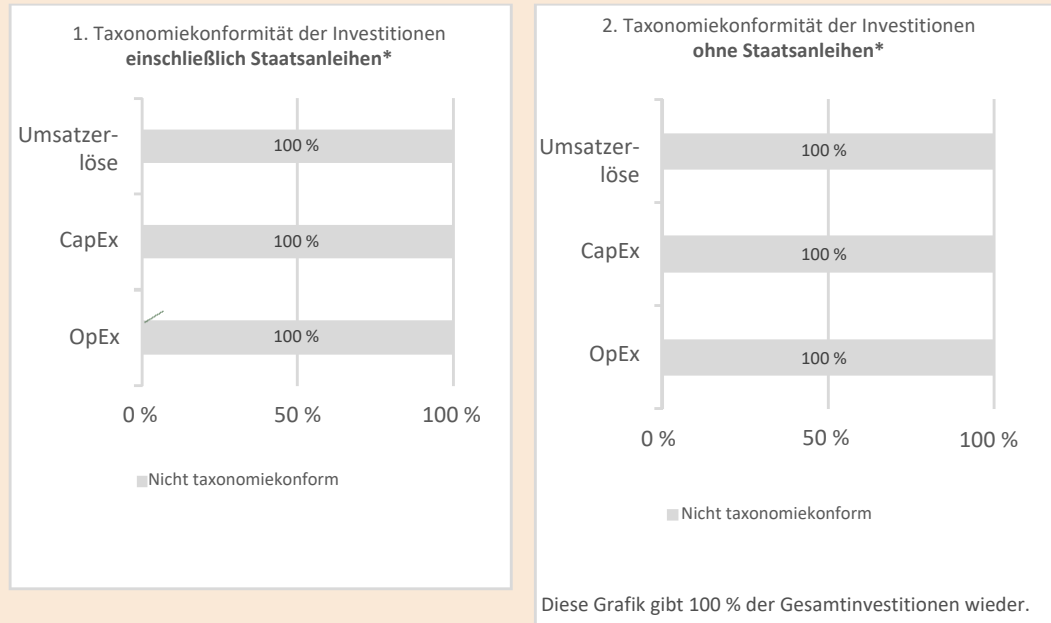
In Kernenergie

☒

Nein

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

Die nachstehenden Grafiken³ zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Nicht zutreffend, da der Fonds nicht in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten investierte.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da es sich um den ersten Berichtszeitraum des Fonds handelt, ist kein Vergleich erforderlich. Der Fonds hat sich jedoch nicht verpflichtet, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend. Der Fonds strebte keinen Mindestanteil nachhaltiger Investitionen an, die gemäß der Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltig gelten. Daher beträgt der Anteil ökologisch nachhaltiger Investitionen im Sinne der Taxonomieverordnung, die während des Bezugszeitraums nachgewiesen wurden, 0 % des Nettovermögens des Fonds.

³ Die Daten in diesen Grafiken haben den Stand vom 30. April 2024, da der Fonds am 24. April 2024 gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung neu eingestuft wurde.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

0 %. Der Fonds hat sich zwar nicht verpflichtet, einen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Investitionen zu halten, der Anlageverwalter hat bei der Bewertung eines Emittenten jedoch die sozialen Merkmale, die Menschen- und Arbeitnehmerrechte, das Verhalten der Unternehmensleitung und die soziale Verantwortung der Unternehmen berücksichtigt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst die Finanzinstrumente, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale des Fonds ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. In manchen Fällen ist dies auf die Nichtverfügbarkeit von Daten und Unternehmensmaßnahmen zurückzuführen. Diese Positionen unterlagen nach wie vor dem vollständigen Ausschluss-Screening von HSBC und wurden im Hinblick auf verantwortungsvolle Geschäftspraktiken im Einklang mit den Prinzipien des UNGC und der OECD geprüft.

Der Fonds hielt 6,1 % Barmittel/Barmitteläquivalente zum Zwecke des Liquiditätsmanagements und der Rücknahme und Zeichnung von Anteilen sowie derivative Finanzinstrumente zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements. Barmittel/Barmitteläquivalente und derivative Finanzinstrumente verfügen aufgrund der Art dieser Instrumente über keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, den Anlegern Kapitalsicherheit und tägliche Liquidität sowie eine Anlagerendite zu bieten, die mit den üblichen auf Euro lautenden Geldmarktzinsen vergleichbar ist.

Anhand von Daten verschiedener externer Anbieter ermittelte der Anlageverwalter einen ESG-Score für jeden Emittenten im investierbaren Universum des Fonds, der aus E-, S- und G-Scores bestand und auf der Grundlage eines proprietären Modells gewichtet wurde. Der Anlageverwalter baute dann ein Portfolio auf, das darauf abzielte, einen ESG-Score über dem durchschnittlichen mittleren ESG-Score des investierbaren Universums aufrechtzuerhalten, gemessen am MSCI IA-Score.

Der Fonds schloss auch Anlagen in Emittenten aus, die Geschäftsaktivitäten ausüben, die für bestimmte ökologische oder soziale Merkmale als schädlich erachtet wurden. Dies bedeutete, dass er nicht in Emittenten investierte, die an den oben genannten ausgeschlossenen Aktivitäten beteiligt waren.

HSBC führte Mitwirkungs- und Aktionärsmaßnahmen in Unternehmen durch, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds weiter zu erfüllen.



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

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Der Fonds war in Bezug auf den Referenzindex nicht beschränkt und war daher für die Zwecke der ESG-Merkmale des Fonds nicht relevant.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?***
Nicht zutreffend.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***
Nicht zutreffend.