

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 dieses Produkt einen Mindestanteil von 25 % 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 Performance des FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (der „Index“) bewirbt der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Reduzierung der Kohlenstoffemissionen und der Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen im Vergleich zum FTSE USA Index (der „Hauptindex“); und
- Eine Verbesserung des FTSE Russell ESG-Ratings im Vergleich zum Hauptindex.

Der Fonds zielt darauf ab, diese Eigenschaften zu bewerben, indem er die Leistung des Index nachbildet, der Unternehmen auf der Grundlage von Ausschlusskriterien für Nachhaltigkeit und Ausschlusskriterien des Global Compact der Vereinten Nationen ausschließt und Unternehmen gewichtet, um das Engagement gegenüber Unternehmen mit höheren Kohlenstoffemissionen und fossilen Brennstoffen zu verringern und das Engagement gegenüber Unternehmen mit günstigen ESG-Ratings zu verbessern.

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

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

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

Der Nachhaltigkeitsindikator ist das proprietäre ESG-Ratingsystem von HSBC Asset Management, das zur Messung der Erreichung der vom Index und damit vom Fonds geförderten ESG-Merkmale verwendet wird, wobei insbesondere Folgendes gemessen wird:

- ESG-Score im Vergleich zum Hauptindex; und
- Kohlenstoffemissionen und Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen im Vergleich zum Hauptindex (gemessen als Kohlenstoffintensität).

- **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 vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen orientieren sich an den ökologischen und/oder sozialen Merkmalen, die er gemäß diesem Anhang bewirbt.

Der Fonds bildet die Performance des Index nach, dessen Schwerpunkt auf einer Reduzierung der Kohlenstoffemissionen und der Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen sowie einer Verbesserung des FTSE Russell ESG-Ratings im Vergleich zum Hauptindex durch die Entfernung von Unternehmen auf der Grundlage von Ausschlusskriterien für Nachhaltigkeit liegt. Durch die Nachbildung der Performance des Index tragen die Anlagen des Fonds zu diesen nachhaltigen Zielen bei.

- **Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich schaden?**

Im Rahmen der Indexkonstruktion wird vom Indexanbieter keine Analyse im Hinblick auf den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ durchgeführt.

Der Index wird periodisch neu gewichtet; vor der Neugewichtung des Index werden die unten genannten Indikatoren in die Bewertung der Geschäftstätigkeit einbezogen.

Durch die Nachbildung der Performance des Index führen die Anlagen des Fonds nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung des nachhaltigen Ziels der ökologischen und/oder sozialen Investitionen.

Die Überwachung von Anlagebeschränkungen ist ein HSBC-Overlay-Prozess, der nach Investitionen sucht, die die Ziele nicht erheblich beeinträchtigen und zu einer Veräußerung durch den Anlageverwalter vor der Indexneubilanzierung führen könnten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Daten zu nachhaltigen Investitionen, die in die Indexmethodik eingegeben werden (z. B. ESG-Scores, Kohlenstoffdaten), erfassen implizit Metriken der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) und werden bei der Erstellung des Index verwendet. Infolgedessen wird der Index ein positiveres Engagement in PAI-Metriken gegenüber dem Hauptindex aufweisen.

Darüber hinaus ist die aktive Beteiligung durch Interaktion und globale Stimmrechtsvertretung eine wichtige Säule unseres Ansatzes für verantwortungsvolle Investitionen. Unsere Stewardship-Aktivität konzentriert sich auf den Schutz und die Verbesserung der Investitionen unserer Kunden bei uns. Wir tauschen uns mit Unternehmen zu einer Reihe von ESG-Fragen aus und haben bei den Interaktionen die folgenden klaren Ziele:

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.

- Verbesserung unseres Verständnisses der Geschäftstätigkeit und der Strategien von Unternehmen
- Überwachung der Unternehmensleistung
- Unterstützung signalisieren oder Bedenken in Bezug auf Unternehmensführung, Performance oder Richtung äußern
- Bewerben bewährter Verfahren

Die Themen der Interaktionen reichen von Fragen der guten Unternehmensführung wie dem Schutz der Rechte von Minderheitsaktionären, der Wahl von Verwaltungsratsmitgliedern und der Struktur des Verwaltungsrats bis hin zu Umweltfragen, einschließlich der Anpassung an den Klimawandel und der Abschwächung des Klimawandels sowie der Energiewende mit geringem Kohlenstoffausstoß, und zu sozialen Fragen wie dem Umgang mit Humankapital, Ungleichbehandlung und Datenschutz.

Wir haben ein spezielles Stewardship-Team mit Interaktions-Spezialisten. Die Interaktion ist auch ein integraler Bestandteil des grundlegenden Forschungsprozesses. Unsere Analysten und Portfoliomanager arbeiten im Rahmen des Investitionsprozesses mit Emittenten zusammen und befassen sich in ihren Analysen und Diskussionen mit relevanten ESG-Themen.

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 Index-Methodik umfasst die FTSE Russell ESG-Scores. Die ESG-Scores von FTSE Russell umfassen Bewertungen, ob Unternehmen globale Standards wie die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC“) oder die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen erfüllen. Dies ist Teil der Säule „Menschenrechte und Gemeinschaft“ in der sozialen Säule des FTSE Russell ESG-Ratingmodells. Weitere Informationen zu Kontroversen und Menschenrechten in FTSE-Russell-Indizes finden Sie auf der Website des Indexanbieters.

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

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

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



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

- Ja, Daten zu nachhaltigen Investitionen, die in die Indexmethodik eingehen (z. B. ESG-Scores, Kohlenstoffdaten), erfassen implizit obligatorische PAI-Metriken, die bei der Erstellung des Index verwendet werden. Infolgedessen wird der Index ein positiveres Engagement in den PAI-Metriken gegenüber dem Hauptindex aufweisen.

Darüber hinaus ist die aktive Beteiligung durch Interaktion und globale Stimmrechtsvertretung eine wichtige Säule unseres Ansatzes für verantwortungsvolle Investitionen. Unsere Stewardship-Aktivität konzentriert sich auf den Schutz und die Verbesserung der Investitionen unserer Kunden bei uns. Wir tauschen uns mit Unternehmen zu einer Reihe von ESG-Fragen aus und haben bei den Interaktionen klare Ziele:

- Verbesserung unseres Verständnisses der Geschäftstätigkeit und der Strategien von Unternehmen
- Überwachung der Unternehmensleistung
- Unterstützung signalisieren oder Bedenken in Bezug auf Unternehmensführung, Performance oder Richtung äußern
- Bewerben bewährter Verfahren

Die Themen der Interaktionen reichen von Fragen der guten Unternehmensführung wie dem Schutz der Rechte von Minderheitsaktionären, der Wahl von Verwaltungsratsmitgliedern und der Struktur des Verwaltungsrats bis hin zu Umweltfragen, einschließlich der Anpassung an den Klimawandel und der Abschwächung des Klimawandels sowie der Energiewende mit geringem Kohlenstoffausstoß, und zu sozialen Fragen wie dem Umgang mit Humankapital, Ungleichbehandlung und Datenschutz.

Wir haben ein spezielles Stewardship-Team mit Interaktions-Spezialisten. Die Interaktion ist auch ein integraler Bestandteil des grundlegenden Forschungsprozesses. Unsere Analysten und Portfoliomanager arbeiten im Rahmen des Investitionsprozesses mit Emittenten zusammen und befassen sich in ihren Analysen und Diskussionen mit relevanten ESG-Themen.

Wir sind in unserer Berichterstattung über unsere Interaktionen und unsere Abstimmungsaktivitäten vollkommen transparent und veröffentlichen unsere Abstimmungen vierteljährlich sowie jährliche zusammenfassende Informationen über unsere Interaktionsaktivitäten.

Wie die PAI-Indikatoren berücksichtigt wurden, wird im Jahresbericht und im Jahresabschluss des Fonds berücksichtigt.

Weitere Informationen sind auf Anfrage erhältlich.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Fonds wird passiv verwaltet und zielt darauf ab, die Nettogesamtrendite des Index nachzubilden.

Der Index strebt eine Reduzierung der Kohlenstoffemissionen und der Exposition gegenüber fossilen Brennstoffen sowie eine Verbesserung des FTSE Russell ESG-Ratings im Vergleich zum Hauptindex an.

Der Index erreicht dies auf folgende Weise:

1. Entfernung von Aktien auf der Grundlage von Ausschlusskriterien für die Nachhaltigkeit auf jährlicher Basis im September.
2. Anpassung der Gewichtung der verbleibenden Unternehmen innerhalb des Hauptindex nach den Kriterien Kohlenstoffemissionen, fossile Brennstoffreserven und FTSE Russell ESG-Ratings auf jährlicher Basis im September.
3. Entfernung von Unternehmen, die nicht konform mit einem oder mehreren UNGC-Grundsätzen sind, auf vierteljährlicher Basis.

- **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 Anlagestrategie sind:

1. Entfernung von Aktien auf der Grundlage von Ausschlusskriterien für die Nachhaltigkeit auf jährlicher Basis im September. Die folgenden Arten von Unternehmen werden jährlich aufgrund von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien aus dem Index gestrichen, wobei für einige Kriterien Schwellenwerte gelten können:

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

- a. Unternehmen, die als Anbieter von Kernwaffensystemen oder Komponenten/Dienstleistungen identifiziert wurden, die als speziell für verbotene und kontroverse Waffen (einschließlich Antipersonenminen, Blendlaserwaffen, Kernwaffen, Streuwaffen, biologische und chemische Waffen, abgereichertes Uran, nicht nachweisbare Splitter und weiße Phosphormunition) angesehen werden;
 - b. Unternehmen, die an der Herstellung von Tabakerzeugnissen beteiligt sind;
 - c. Unternehmen, die als Anbieter von speziell angefertigten Produkten und/oder Dienstleistungen oder von speziell angefertigten Komponenten für konventionelle militärische Waffen identifiziert wurden;
 - d. Unternehmen, die nachweislich an der Förderung von Kraftwerkskohle und der Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle beteiligt sind;
 - e. Unternehmen, die als mit der Stromerzeugung aus Kernenergie befasst identifiziert werden, und
 - f. Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der Grundsätze des UNGC (weithin akzeptierte Nachhaltigkeitsprinzipien in den Bereichen Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) verstoßen;
 - g. Unternehmen, die am Besitz oder Betrieb einer Glücksspieleinrichtung oder an der Herstellung von spezialisierten Produkten ausschließlich für Glücksspiele oder an der Bereitstellung von unterstützenden Produkten/Dienstleistungen für Glücksspiele beteiligt sind, und
 - h. Unternehmen, die als an der Produktion oder dem Betrieb von Unterhaltungseinrichtungen für Erwachsene oder am Vertrieb von Unterhaltungsmaterialien für Erwachsene beteiligt identifiziert werden;
2. Anpassung der Gewichtung der verbleibenden Unternehmen innerhalb des Hauptindex nach den Kriterien Kohlenstoffemissionen, fossile Brennstoffreserven und FTSE Russell ESG-Ratings auf jährlicher Basis im September. Der Index zielt auch darauf ab, die Divergenz der Branche gegenüber dem Hauptindex zu begrenzen, indem die maximalen Aktiengewichte von 10 % und die minimalen Aktiengewichte von 0,5 Basispunkten beibehalten werden; und
 3. Entfernung von Unternehmen, die nicht konform mit einem oder mehreren UNGC-Grundsätzen sind, auf vierteljährlicher Basis.

- **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 Anlagen zu reduzieren.

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

Die Index-Methodik umfasst die FTSE Russell ESG-Scores. Das ESG-Ratingmodell von FTSE Russell besteht unter anderem aus Säulen wie „Steuertransparenz“, „Unternehmensführung“ und „Arbeitsstandards“, die die Bewertung von Unternehmen, in die investiert wird, im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung ermöglichen.

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 verstärkte Due-Diligence-Prüfungen sowie Screenings bewertet, mit denen Emittenten identifiziert werden, die niedrige Unternehmensführungs-Scores aufweisen. Diese Emittenten werden dann einer weiteren Überprüfung, weiteren Maßnahmen und/oder weiteren Interaktionen unterzogen.

Gute Unternehmensführung ist seit langem Bestandteil HSBC-spezifischer Fundamentalanalysen von Unternehmen. Das Stewardship-Team von HSBC trifft sich regelmäßig mit den Unternehmen, um das Verständnis für ihr Geschäft und ihre Strategie zu verbessern, Unterstützung oder Bedenken des Anlageverwalters in Hinblick auf die

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

Maßnahmen des Managements zu signalisieren und bewährte Praktiken zu fördern. HSBC ist der Ansicht, dass eine gute Unternehmensführung sicherstellt, dass Unternehmen im Einklang mit den langfristigen Interessen ihrer Anleger verwaltet werden.

Weitere Informationen sind auf Anfrage erhältlich.



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

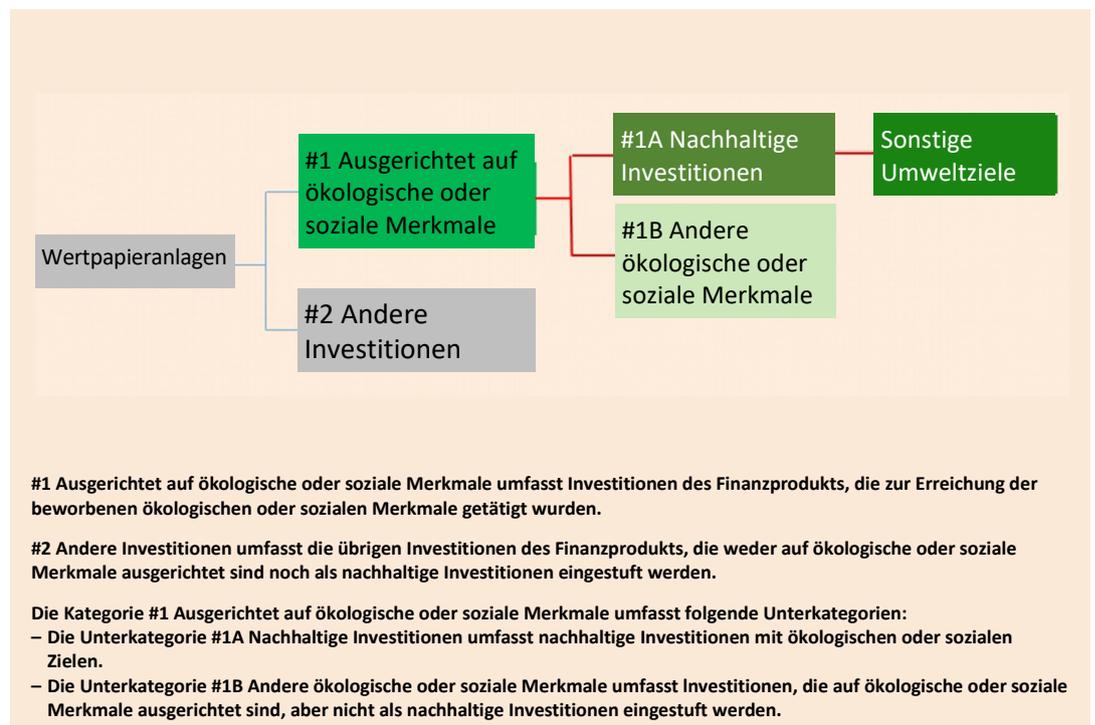
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **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 Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

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. Zahlungsmittel und andere Instrumente können für Liquidität, Hedging und ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden.

Der Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale und hat zwar kein nachhaltiges Investment zum Ziel, wird aber einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen haben.



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

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



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

Nicht zutreffend. Der Fonds beabsichtigt nicht, sich zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel zu verpflichten, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

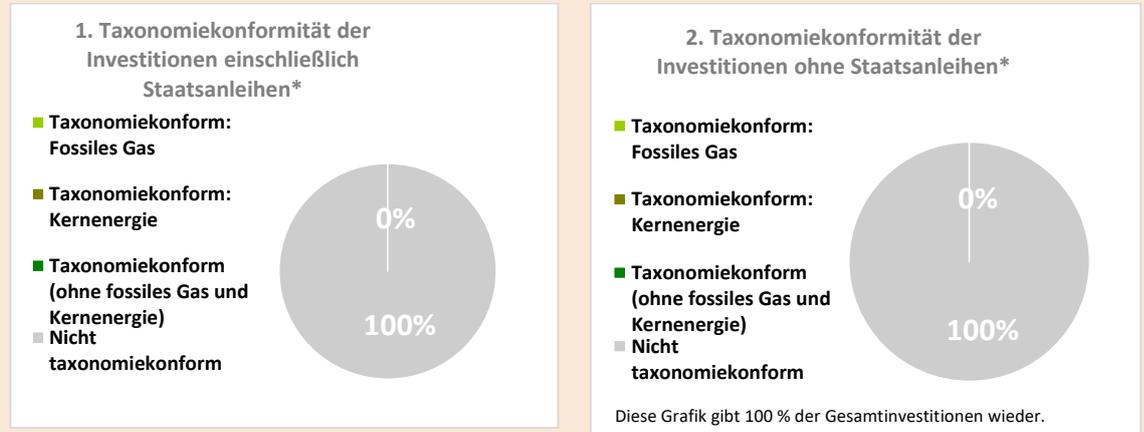
• Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?²

- Ja: In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

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

Ermöglichende Aktivitäten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Aktivitäten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen.**

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

Nicht zutreffend. Der Fonds verfügt über keinen spezifischen Mindestanteil an Übergangs- und Ermöglichungsaktivitäten.



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

Nicht zutreffend. Der Fonds beabsichtigt nicht, sich zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem ökologischen Ziel zu verpflichten, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend. 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, Eligible Collective Investment Schemes und/oder Finanzderivate können für Liquidität, Hedging und ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, für die es keine Mindestgarantien für Umwelt und/oder Soziales gibt.



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

Der Fonds zielt darauf ab, die Nettogesamtrendite des FTSE USA ESG Low Carbon Select Index (der „Index“) nachzubilden und gleichzeitig den Tracking Error zwischen der Performance des Fonds und des Index soweit wie möglich zu minimieren.

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?**

Der Indexanbieter wendet jährlich nachhaltige Ausschlusskriterien an und gewichtet Unternehmen, um das Engagement im Index gegenüber Unternehmen mit höheren Kohlenstoffemissionen und fossilen Brennstoffen zu verringern und das Engagement im Index zu verbessern, um die günstigen FTSE Russell ESG-Ratings im Vergleich zum Hauptindex zu erfüllen. Darüber hinaus werden die Ausschlusskriterien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) vierteljährlich (d. h. an jedem Ausgleichstag) auf den Index angewandt.

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

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 soweit wie möglich zu minimieren. 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.

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

Der Index ist ein Teilindex des FTSE USA Index und misst die Performance von Unternehmen in den USA, wie vom Indexanbieter definiert.

Wie vorstehend näher erläutert, wendet der Indexanbieter auf jährlicher Basis nachhaltige Ausschlusskriterien an und gewichtet Unternehmen, um das Engagement im Index gegenüber Unternehmen mit höheren Kohlenstoffemissionen und fossilen Brennstoffen zu verringern und das Engagement im Index zu verbessern, um die günstigen FTSE-Ratings von Russell ESG im Vergleich zu denen des Hauptindex zu erfüllen. Darüber hinaus werden die Ausschlusskriterien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) vierteljährlich (d. h. an jedem Ausgleichstag) auf den Index angewandt.

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

Die Indexmethodik kann von Zeit zu Zeit vom Indexanbieter geändert werden. Informationen zur Indexmethodik sind unter <https://www.ftserussell.com/> verfügbar.



Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

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