

Vorvertragliche 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.

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU)2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wird damit ein **Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_ %**

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wird damit ein **Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_ %**

Es **werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 20,00 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



### Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Bei der Nachbildung der Wertentwicklung des MSCI World Climate Paris Aligned Index (der „Index“) bewirbt der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- das Bestreben, die Exposition gegenüber den Risiken in Verbindung mit der Klimawende und physischen Klimarisiken zu verringern und Gelegenheiten zu nutzen, die sich aus dem Übergang zu einer CO2-ärmeren Wirtschaft ergeben, und sich gleichzeitig an den Anforderungen des Übereinkommens von Paris auszurichten;
- Integration der Empfehlungen der Task Force on Climate-related Financial Disclosures; und
- Übertreffen der Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark.

Der Fonds zielt darauf ab, diese Merkmale zu bewerben, indem er die Wertentwicklung des Index nachbildet, der Unternehmen auf der Grundlage von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien und Ausschlusskriterien des Globalen Pakts der Vereinten Nationen ausschließt und Unternehmen gewichtet, um die klimabezogenen Ziele zu erreichen, die im Abschnitt zu den verbindlichen Elementen in diesem Dokument dargelegt sind.

Der Index erfüllt die Voraussetzungen einer EU Paris-Aligned Benchmark gemäß Titel III, Kapitel 3a der Verordnung (EU) 2016/1011 und wurde als Referenzwert zum Erreichen der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bezeichnet.

**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 folgende Nachhaltigkeitsindikator wird verwendet, um die Erreichung der vom Teilfonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen, insbesondere:

- Kohlenstoffintensität des Fonds im Vergleich zum Hauptindex, wobei erwartet wird, dass die Kohlenstoffintensität des Fonds niedriger als jene des Hauptindex sein wird.

- **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 tragen zu einem oder mehreren der folgenden ökologischen und/oder sozialen Ziele bei:

- Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft;
- Unterstützung der Forschung und Finanzierung von Verbesserungen in den Bereichen Technologie, Ressourcen und Lieferketten in Bezug auf den Klimaschutz und/oder die Anpassung an den Klimawandel;
- Unterstützung der Verbesserung der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“); und
- Einführung höchster Standards bei Umwelt- und Sozialpraktiken – vom Ansatz beim Klimaschutz bis hin zur Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen.

Investitionen können als nachhaltig betrachtet werden, wenn sie im Einklang mit der Richtlinie für nachhaltiges Investieren des Anlageverwalters einen positiven Beitrag zu einem ökologischen oder sozialen Ziel leisten. Der Beitrag einer nachhaltigen Investition zu diesen Zielen wird bestimmt, indem eines oder mehrere der folgenden Kriterien erfüllt werden:

- Einstufung gemäß dem Regelwerk des Anlageverwalters für Netto-Null-Investitionen als „auf Netto-Null ausgerichtet“ oder besser;
- klassenbeste ökologische und/oder soziale Bewertungen im jeweiligen Anlageuniversum, wie vom Anlageverwalter festgelegt;
- Generierung nachhaltiger Erträge, die aus Aktivitäten stammen, welche nach Ansicht des Anlageverwalters die Verbesserung der UN-SDGs, der EU-Taxonomieziele oder anderer klimabezogener Aktivitäten unterstützen.

Weitere Informationen finden Sie im Dokument über die Methoden für verantwortungsbewusstes Investieren von HSBC. Dieses ist verfügbar unter [www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing](http://www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing). Wählen Sie hier Ihren Standort und dann „Richtlinien und Offenlegung“ aus.

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

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds werden nach dem Grundsatz der „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ („DNSH“) bewertet, um sicherzustellen, dass sie ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen. Dies umfasst die Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (principal adverse impacts, „PAIs“), wie nachstehend näher beschrieben.

Darüber hinaus erfüllen Unternehmen, die 50 % oder mehr ihres Umsatzes mit Erwachsenenunterhaltung, Glücksspiel und Alkohol erzielen, sowie Unternehmen, die von einem externen Research-Dienstleister als in schwerwiegende Kontroversen verwickelt eingestuft werden, den DNSH-Grundsatz nicht. Der DNSH-Grundsatz gilt nur für die Investitionen des Fonds, die als nachhaltig gelten.

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.

## Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die obligatorischen PAIs gemäß der Definition in Tabelle 1 von Anhang 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 werden verwendet, um zu beurteilen, ob die nachhaltigen Investitionen des Fonds ökologische oder soziale Ziele erheblich beeinträchtigen. Zur Unterstützung der DNSH-Bewertung hat der Anlageverwalter quantitative Kriterien für die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten 14 PAIs festgelegt.

<b>Obligatorische PAIs</b>		
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 1	THG-Emissionen
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 2	CO <sub>2</sub> -Fußabdruck
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 3	THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 4	Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
Treibhausgas(THG)-Emissionen	PAI 6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7	Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8	Emissionen in Wasser
Wasser	PAI 9	Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
Soziales und Beschäftigung	PAI 11	Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen
Soziales und Beschäftigung	PAI 12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
Soziales und Beschäftigung	PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

In Fällen, in denen Daten entweder nicht existieren oder nicht ausreichen, kann alternativ eine qualitative Überprüfung und/oder ein relevanter Stellvertreter verwendet werden. Wenn ein Unternehmen nachweislich eine erhebliche Beeinträchtigung verursacht oder dazu beiträgt, kann es weiterhin im Fonds gehalten werden, wird jedoch nicht auf den Anteil der „nachhaltigen Investitionen“ innerhalb des Fonds angerechnet.

Weitere Informationen zu den obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen sowie zu Datenquellen und Beschränkungen finden Sie im Leitfaden zu den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI) von HSBC. Dieses ist verfügbar unter [www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing](http://www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing). Wählen Sie hier Ihren Standort und dann „Richtlinien und Offenlegung“ aus.

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

Der Anlageverwalter kann eine Kombination aus Analysen Dritter und seiner eigenen ESG-Due-Diligence-Prüfung verwenden, um nachhaltige Investitionen auf Verwicklungen in mögliche Kontroversen zu überwachen, was potenzielle Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze einschließt. Im Rahmen dieser Überwachung erfolgt eine Beurteilung anhand internationaler Standards, einschließlich der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln und der Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

HSBC Asset Management gehörte darüber hinaus zu den Unterzeichnern der UN Principles for Responsible Investment.

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, der Index ist darauf ausgelegt, die Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark-Verordnung zu erfüllen und zu übertreffen. Das Universum der in Frage kommenden Wertpapiere wird aufgebaut, sobald der Abbau und die Erzeugung von Kraftwerkskohle und Gas anhand eines Höchstschwellenwerts herausgefiltert und umstrittene Waffen (PAI 14) entfernt wurden. Wertpapiere, die in Bezug auf Umweltprobleme sehr schwerwiegenden und schwerwiegenden Kontroversen ausgesetzt sind, werden ebenfalls entfernt (PAI 7, 8, 9). Eingebettet in den ESG-Kontroversen-Score ist eine Bewertung der Allgemeinen Erklärung der Menschenrechte der Vereinten Nationen, der ILO-Kernarbeitsnormen und des Globalen Pakts der Vereinten Nationen, in deren Rahmen Wertpapiere, die in sehr schwerwiegende Kontroversen verwickelt sind, ausgeschlossen werden (PAI 10). Das sich daraus ergebende zulässige Universum wird dann zur Erstellung des Index verwendet, wobei ein ausgefeilter Optimierungsansatz verwendet wird, der das Engagement in Kohlenstoffintensität (PAI 1, 2) reduziert, das Engagement in fossilen Brennstoffen (PAI 2, 4) reduziert und das Engagement in Wertpapieren mit glaubwürdigen Emissionsreduzierungszielen (PAI 1, 2, 3, 4, 5) erhöht. Die Optimierung betrifft auch die Übergewichtung von Unternehmen mit nachhaltigen/umweltfreundlichen Lösungen (PAI 7, 8, 9) und Unternehmen mit umweltfreundlichen Umsätzen.

Die Performance dieser PAIs wird im Jahresbericht und -Abschluss des Fonds erläutert.

- Nein



## Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Fonds wird passiv verwaltet und strebt die Nachbildung der Netto-Gesamterendite des Index an.

Der Index ist für Anleger gedacht, die ihre Exposition gegenüber den Risiken in Verbindung mit der Klimawende und physischen Klimarisiken verringern und Gelegenheiten nutzen möchten, die sich aus dem Übergang zu einer CO<sub>2</sub>-ärmeren Wirtschaft ergeben, und orientiert sich an den Anforderungen des Übereinkommens von Paris. Der Index integriert die Empfehlungen der Task Force on Climate-related Financial Disclosures und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark übertrifft. Durch die Nachbildung des Index befindet sich der Fonds auf einem klaren und messbaren Weg zum ökologischen Übergang, d. h. er will eine Selbstdekarbonisierungsrate von 10 % pro Jahr erreichen.

Der Index erreicht das Vorstehende auf folgende Weise:

1. Der Index schließt zunächst die Wertpapiere von Unternehmen aus, die (wie vom Indexanbieter in der Indexmethodik definiert) ein Engagement in einem der folgenden Merkmale aufweisen (für jedes Merkmal gelten vom Indexanbieter definierte und in der Indexmethodik dargelegte Schwellenwerte, die von Zeit zu Zeit geändert werden können).
2. An jedem Neugewichtungstag wird der Index unter Anwendung eines Optimierungsprozesses (wie in der Indexmethodik beschrieben) konstruiert, wie in den nachfolgenden verbindlichen Elementen beschrieben.

- **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:

Der schließt Wertpapiere von Unternehmen mit einem Engagement (wie vom Indexanbieter in der Indexmethodik definiert) in folgenden Bereichen aus:

- umstrittene Waffen;
- ESG-Kontroversen,
- Tabak,
- Umweltschäden,
- Abbau und Vertrieb von Kraftwerkskohle;
- Öl und Gas sowie
- Stromerzeugung.

Der Index integriert darüber hinaus die Empfehlungen der Task Force on Climate-related Financial Disclosures („TCFD“) und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark übertrifft.

An jedem Neugewichtungstag wird der Index unter Anwendung eines Optimierungsprozesses (wie in der Indexmethodik beschrieben) aufgebaut, um die folgenden Ziele zu erreichen:

- Übertreffen der technischen Mindestanforderungen des Entwurfs des delegierten Rechtsakts der EU;
- Übereinstimmung mit den Empfehlungen der TCFD;
- Übereinstimmung mit einem 1,5 °C-Klimaszenario unter Verwendung des MSCI Climate Value-at-Risk und einer „Selbstdekarbonisierungs“-Rate von 10 % p. a., wodurch ein klarer und messbarer Weg zum ökologischen Übergang eingeschlagen wird;
- Verringerung der Exposition des Index gegenüber physischen Risiken durch extreme Wetterereignisse um mindestens 50 %.

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

- Verschiebung der Indexgewichtung von „braun“ zu „grün“ unter Verwendung des MSCI Low Carbon Transition Score und durch Ausschluss von Kategorien von Unternehmen, die mit fossilen Brennstoffen in Verbindung stehen;
- Erhöhung der Gewichtung von Unternehmen, die an der Klimawende beteiligt sind, und Verringerung der Gewichtung von Unternehmen, die den Risiken des Klimawende ausgesetzt sind.
- Verringerung der Gewichtung von Unternehmen, die anhand der Scope-1-, Scope-2- und Scope-3-Emissionen als große CO<sub>2</sub>-Emittenten eingestuft werden.
- Erhöhung der Gewichtung von Unternehmen mit glaubwürdigen Zielen zur CO<sub>2</sub>-Verringerung mittels des Gewichtungsschemas.
- Erzielung eines moderaten Tracking Error im Vergleich zum Hauptindex und eines geringen Portfolioumschlags.

Weitere Informationen zur Indexmethodik sind auf der Website des Indexanbieters verfügbar, die im Abschnitt „Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?“ in diesem Dokument angegeben ist.

- **Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?**

Der Teilfonds verfügt über keinen verbindlichen Mindestsatz, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

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

Der Indexanbieter erfasst bewährte Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung durch sein Modell MSCI ESG Controversies, wobei beides in die Methodik des Index integriert ist. MSCI ESG Controversies deckt unter anderem die Themen „Arbeitsrechte und Lieferkette“ und „Unternehmensführung“ ab.

Weitere Informationen finden Sie auf der Website des Indexanbieters.

Zusätzlich zu den oben genannten Überlegungen bei der Indexkonstruktion trifft sich das Stewardship-Team von HSBC regelmäßig mit den Unternehmen, um unser Verständnis für deren Geschäft und Strategie zu verbessern, Unterstützung oder Bedenken des Anlageverwalters in Bezug auf die Maßnahmen des Managements zu signalisieren und bewährte Verfahren zu fördern. Nach Ansicht von HSBC stellt eine gute Unternehmensführung sicher, dass Unternehmen im Einklang mit den langfristigen Interessen ihrer Anleger verwaltet werden.

## **Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?**

Um seine Anlageziele zu erreichen, strebt der Fonds Anlagen in den Bestandteilen des Index an, die in der Regel den Verhältnissen entsprechen, in denen sie im Index enthalten sind. Daher werden voraussichtlich mindestens 80 % des Fondsvermögens entweder in Wertpapiere innerhalb des Index oder in Wertpapiere, die die ESG-Kriterien des Index erfüllen („#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“), investiert. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Vermögens in andere Anlagen investieren („#2 Andere“).

Bei jeder Indexneugewichtung wird das Portfolio des Fonds entsprechend dem Index neu gewichtet, so dass mindestens 80 % des Fondsvermögens den ESG-Kriterien des Index entsprechen (dies umfasst 20 % der Vermögenswerte des Fonds, die als „#1A nachhaltige Investitionen“ eingestuft werden).

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



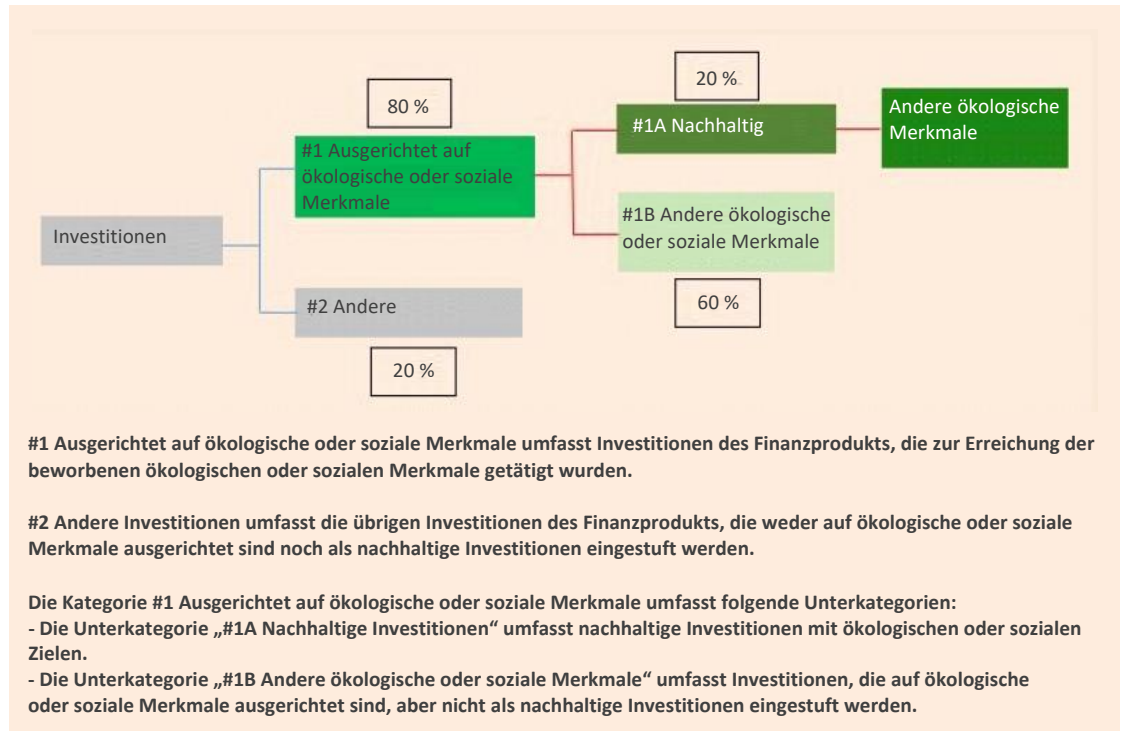
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

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.



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

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



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

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

- **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**<sup>1</sup>

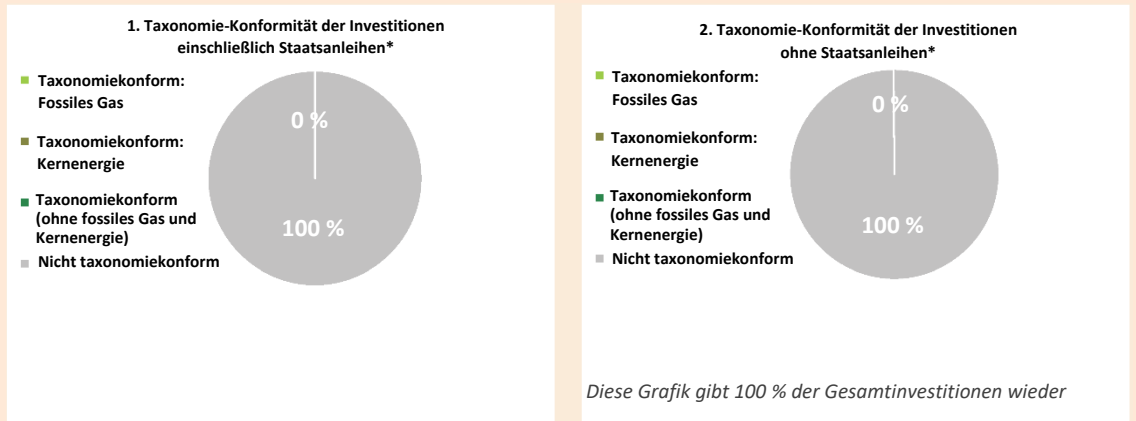
Ja  In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> 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 am linken 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.

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

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonmiekonformen Investitionen in grüner Farbe. 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 Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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

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

Der Fonds hat keinen Mindestanteil an Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.


 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

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

Der Fonds wird mindestens 20 % in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind.

 **Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu einem Mindestanteil an sozial nachhaltigen Investitionen.

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

Zahlungsmittel und andere Instrumente wie American Depositary Receipts, European Depositary Receipts und Global Depositary Receipts, zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen und/oder Finanzderivate können zu Zwecken der Liquidität, der Absicherung und eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden, und für diese ist kein ökologischer und/oder sozialer Mindestschutz vorgesehen.



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

Ja. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Wertentwicklung des MSCI World Climate Paris Aligned Index nachzubilden.

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

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

Der Index wird aus dem Hauptindex aufgebaut, wobei Wertpapiere von Unternehmen mit einem wert- und klimabasierten Engagement (wie vom Indexanbieter in der Indexmethodik definiert) in folgenden Bereichen ausgeschlossen werden:

Neben der Anwendung der Ausschlusskriterien integriert der Index darüber hinaus die Empfehlungen der Task Force on Climate-related Financial Disclosures („TCFD“) und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark übertrifft.

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

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

Um seine Anlageziele zu erreichen, strebt der Fonds Anlagen in den Bestandteilen des Index an, die in der Regel den Verhältnissen entsprechen, in denen sie im Index enthalten sind. Die Zusammensetzung des Index wird halbjährlich neu ausgerichtet und erfolgt gemäß den von MSCI Inc. festgelegten veröffentlichten Regeln zum Management des Index.

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

Der Index ist ein Aktienindex, der auf dem MSCI World Index basiert und Wertpapiere mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrieländern umfasst

Der Index wird aus dem Hauptindex aufgebaut, wobei Wertpapiere von Unternehmen mit einem Engagement (wie vom Indexanbieter in der Indexmethodik definiert) in folgenden Bereichen ausgeschlossen werden:

- umstrittene Waffen;
- ESG-Kontroversen,
- Tabak,
- Umweltschäden,
- Abbau und Vertrieb von Kraftwerkskohle;
- Öl und Gas sowie
- Stromerzeugung.

Der Index integriert darüber hinaus die Empfehlungen der Task Force on Climate-related Financial Disclosures („TCFD“) und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards der EU Paris-Aligned Benchmark übertrifft.

An jedem Neugewichtungstag wird der Index unter Anwendung eines Optimierungsprozesses (wie in der Indexmethodik beschrieben) aufgebaut, um die folgenden Ziele zu erreichen:

- Übertreffen der technischen Mindestanforderungen des Entwurfs des delegierten Rechtsakts der EU;
- Übereinstimmung mit den Empfehlungen der TCFD;
- Übereinstimmung mit einem 1,5 °C-Klimaszenario unter Verwendung des MSCI Climate Value-at-Risk und einer „Selbstdekarbonisierungs“-Rate von 10 % p. a., wodurch ein klarer und messbarer Weg zum ökologischen Übergang eingeschlagen wird;
- Verringerung der Exposition des Index gegenüber physischen Risiken durch extreme Wetterereignisse um mindestens 50 %.
- Verschiebung der Indexgewichtung von „braun“ zu „grün“ unter Verwendung des MSCI Low Carbon Transition Score und durch Ausschluss von Kategorien von Unternehmen, die mit fossilen Brennstoffen in Verbindung stehen;
- Erhöhung der Gewichtung von Unternehmen, die an der Klimawende beteiligt sind, und Verringerung der Gewichtung von Unternehmen, die den Risiken der Klimawende ausgesetzt sind;
- Verringerung der Gewichtung von Unternehmen, die anhand der Scope-1-, Scope-2- und Scope-3-Emissionen als große CO<sub>2</sub>-Emittenten eingestuft werden.
- Erhöhung der Gewichtung von Unternehmen mit glaubwürdigen Zielen zur CO<sub>2</sub>-Verringerung mittels des Gewichtungsschemas.
- Erzielung eines moderaten Tracking Error im Vergleich zum Hauptindex und eines geringen Portfolioumschlags.

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

<https://www.msci.com/index-methodology> (für Datenblätter, Indexmethodik und andere Informationen).

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



- **Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?**

Weitere produktspezifische Informationen zu diesem und allen anderen HSBC-Fonds finden Sie auf der Website. Gehen Sie zu [www.assetmanagement.hsbc.com](http://www.assetmanagement.hsbc.com) und wählen Sie Ihren Anlegertyp sowie Ihr Land/Ihren Standort aus. Bitte wählen Sie auf der Hauptnavigationssseite „Fonds“ aus, wo Sie mithilfe der Such- oder Filterfunktionen Ihren gewünschten Fonds finden.

Version: Final

Veröffentlichungsdatum: 22. Dezember 2025

Datum des Inkrafttretens: 22. Dezember 2025