

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegung gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) 2019/2088

Investmentvermögen HSBC MSCI Europe Select SRI Index

Anlagestrategie und Beschreibung der ökologischen oder sozialen Merkmale:

Die Auswahl, der für den Fonds vorgesehenen Vermögensgegenstände ist darauf gerichtet, unter Wahrung einer angemessenen Risikomischung den MSCI Europe Select SRI Index (EUR) (Wertpapierindex) so genau wie möglich nachzubilden. Dieser Index zielt darauf ab, die Wertentwicklungsmerkmale von Aktienwerten im MSCI Europe Index (der "Mutterindex") nachzubilden, die von Unternehmen ausgegeben wurden, die im Vergleich mit anderen Unternehmen im Mutterindex über ein höheres ESG-Rating (Environmental, Social and Governance / Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfügen. Die Zusammenstellung des MSCI Europe Select SRI Index (EUR) erfolgt auf Basis des vielfältigen ESG-Ansatzes der MSCI SRI Index Methodologie, unter Berücksichtigung Rating-basierter Kriterien und einer Reihe von Ausschlusskriterien.

Methoden, die angewandt werden, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu bewerten und zu messen

Zusätzlich zur Anwendung der MSCI SRI Methodologie werden zur Erstellung des Referenzindex in einem ersten Schritt Unternehmen ausgeschlossen, die vom Indexanbieter MSCI als Hersteller, Produzenten, Lieferanten, Betreiber, Unterstützer in den Geschäftsfeldern Waffen (zivil und militärisch), Atomkraft, Alkohol, Tabak, Genmanipulation von Pflanzen (es sei denn zu reinen Forschungs- und Entwicklungszwecken), Glückspiel und nicht jugendfreier Unterhaltung identifiziert werden und wenn deren Umsätze aus diesen Geschäftsfeldern festgelegte Grenzwerte für das geschäftliche Engagement gemäß der MSCI SRI Index Methodologie überschreiten.

In einem zweiten Schritt bringt der Referenzindex zusätzliche ESG-Ausschlusskriterien für die noch verbleibenden Unternehmen im Mutterindex zur Anwendung. Vollständig ausgeschlossen werden Unternehmen, die Waffen (zivile und militärische) produzieren oder vertreiben und alkoholhaltige Getränke herstellen. Des Weiteren werden Unternehmen ausgeschlossen, die den Kriterien des Indexanbieters im Hinblick auf die Einhaltung humaner Arbeitsbedingungen nicht entsprechen (MSCI ESG Ratings Labour Rights Controversy Score). Zusätzlich werden Unternehmen ausgeschlossen, die Kohle- oder fossile Brennstoffreserven halten.

Die verbleibenden Aktientitel werden anschließend gemäß der Streubesitz-Marktkapitalisierung und der MSCI ESG Focus Index Methodologie so gewichtet, dass der ESG Score des Referenzindex maximiert und der Tracking Error zum Mutterindex nach Anwendung der MSCI SRI Index Methodologie minimiert wird.

Überwachung der ökologischen und sozialen Merkmale

Die Erfüllung der ökologischen und sozialen Merkmale erfolgt durch die Nachbildung des Referenzindex. Der Referenzindex wird im Anlagegrenzprüfungssystem hinterlegt.

Der Referenzindex wird vierteljährlich neu gewichtet und zusammengesetzt, um Änderungen am Mutterindex, den Ausschluss von Wertpapieren gemäß den wertbasierten Ausschlüssen und die Optimierung gemäß der MSCI ESG Focus Methodologie zu berücksichtigen. Außerdem wird der Referenzindex jährlich neu gewichtet gemäß der MSCI Global Socially Responsible Indexes Methodology.



Weitere Einzelheiten zum Referenzindex (einschließlich seiner Bestandteile) und den zur Anwendung kommenden ESG-Prüfkriterien sind auf der Website des Indexanbieters unter <https://www.msci.com/constituents> bzw. <https://www.msci.com/esg-indexes> (in englischer Sprache) zu finden.