

HSBC ETFs PLC

HSBC MSCI Emerging Markets Value ESG UCITs ETF

Monatlicher Bericht 30 Juni 2024 | H41E GY | USD (Acc)



Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des MSCI Emerging Markets Value SRI ESG Target Select Index (der Index) so genau wie möglich nachzubilden. Dies bietet Anlegern die Möglichkeit, ein spezifisches Engagement in Unternehmen mit niedrigeren Marktbewertungen im Vergleich zu ihrem fundamentalen Wert zu erzielen, wobei gleichzeitig ESG-Kennzahlen (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) integriert werden. Der Fonds investiert in Aktien von im Index enthaltenen Unternehmen oder baut ein Engagement in diesen auf. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung.



Anlagestrategie

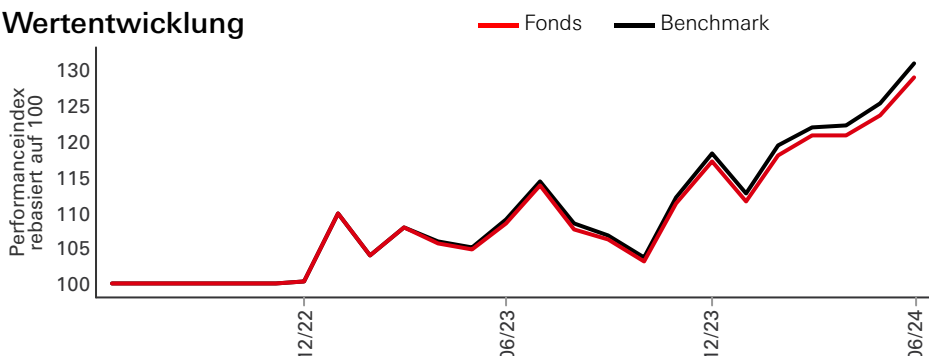
Der Index ist ein Teilindex des MSCI Emerging Markets Index (der Hauptindex) und setzt sich aus Aktien von Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus Schwellenmärkten in aller Welt gemäß der Definition des Indexanbieters zusammen. Der Index wird zusammengestellt, indem Unternehmen ausgeschlossen werden, die in folgenden Bereichen engagiert sind: umstrittene und nukleare Waffen, Unterhaltung für Erwachsene, Alkohol, Glücksspiel, Atomkraft, kohlebasierte Energiegewinnung, fossile Brennstoffe und Tabak. Der Fonds wird passiv verwaltet und ist bestrebt, im Allgemeinen im selben Verhältnis in die Aktien der Unternehmen zu investieren, wie diese im Index vertreten sind. Der Fonds kann bis zu 10 % seiner Vermögenswerte in andere Fonds, unter außergewöhnlichen Marktbedingungen bis zu 35 % seiner Vermögenswerte in Wertpapiere eines einzelnen Emittenten und bis zu 10 % in Total Return Swaps und Differenzkontrakte investieren. Eine vollständige Beschreibung der Anlageziele und des Einsatzes von Derivaten finden Sie im Prospekt.



Hauptrisiken

- Der Wert der Fondsanteile kann sowohl steigen als auch fallen und das in den Fonds investierte Kapital kann stets gefährdet sein.
- Der Fonds kann in Schwellenmärkten investieren. Diese Märkte sind weniger etabliert und oft volatil als entwickelte Märkte und bergen daher höhere Risiken, insbesondere Markt-, Liquiditäts- und Währungsrisiken.
- Wenn der Fonds anstrebt, die Indexperformance durch das Halten einzelner Wertpapiere nachzubilden, gibt es keine Garantie, dass seine Zusammensetzung oder Performance zu jeder Zeit genau derjenigen des Zielindex entsprechen wird („Tracking Error“).

Wertentwicklung



Die frühere Wertentwicklung lässt keine Vorhersagen für die künftige Wertentwicklung zu. Die dargestellte Wertentwicklung basiert auf Netto-Inventarwerten. Ein Ausgabeaufschlag und Ihr Depotpreis (soweit diese anfallen) sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und wirken sich negativ auf die Wertentwicklung der Anlage aus. Bei einer Anlagensumme von EUR 1.000 ist für die Anschaffung ein Ausgabeaufschlag in der Höhe von z.B. 5% zu berücksichtigen. Die dargestellte Wertentwicklung verringert sich in diesem Beispiel um EUR 50. Zusätzlich fällt ein jährliches Entgelt für die Verwahrung und Verwaltung an. Die tatsächlichen Entgelte ergeben sich aus dem Preis- und Leistungsverzeichnis Ihrer Bank.

Dies ist eine Marketingkommunikation. Bitte lesen Sie den Prospekt und KID, bevor Sie abschließende Anlageentscheidungen treffen. Die Definition der Begriffe finden Sie über den Glossar-QR-Code sowie im Prospekt.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 30 Juni 2024

Anteilklasse and Tracking Error Details

Wesentliche Kennzahlen	
NAV je Anteil	USD 13,97
Wertentwicklung 1 Monat	4,32%
Fondsfakten	
UCITs V-konform	Ja
Behandlung von Dividenden	Thesaurierend
Dividendenwährung	USD
Basiswährung des Fonds	USD
Currency Hedged	Not Hedged
Basiswährung der Anteilklasse	USD
Domizil	Irland
Auflegungsdatum	7 Dezember 2022
Anzahl der Anteile im Umlauf	5.000.000
Fondsvermögen	USD 69.827.975
Benchmark	100% MSCI Emerging Markets Value SRI ESG Target Select Index
Nachbildungsmethode	Physisch
SIPP-berechtigt	Ja
Emittent	HSBC ETFs PLC
Ende des Geschäftsjahres	Dez.
Gebühren und Kosten	
Laufende Kostenquote ¹	0,350%
Codes	
ISIN	IE000NVVIF88
WKN	A3DUNT

¹Die laufenden Kosten basieren auf Kosten über ein Jahr. Die Zahl umfasst die jährliche Verwaltungsgebühr, jedoch nicht die Transaktionskosten. Diese Werte können von Zeit zu Zeit variieren.

Wertentwicklung (%)	YTD	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre annualisiert	5 Jahre annualisiert	Seit Auflegung annualisiert
Fonds	10,18	4,32	6,93	10,18	18,84	--	--	17,70
Benchmark	10,69	4,44	7,26	10,69	20,09	--	--	18,78
Nachbildungs- unterschied	-0,51	-0,12	-0,33	-0,51	-1,26	--	--	-1,08
Tracking error	--	--	--	--	0,36	--	--	0,31

Rollierende Wertentwicklung (%)	30/06/23- 30/06/24	30/06/22- 30/06/23	30/06/21- 30/06/22	30/06/20- 30/06/21	30/06/19- 30/06/20
Fonds	18,84	--	--	--	--
Benchmark	20,09	--	--	--	--

Klimabilanz	Fonds	Breiter Marktindex	MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Kohlenstoff-intensität	223,02	421,43	Fonds	6,9	6,3	5,6	5,1
			Breiter Marktindex	5,8	5,8	5,2	4,7

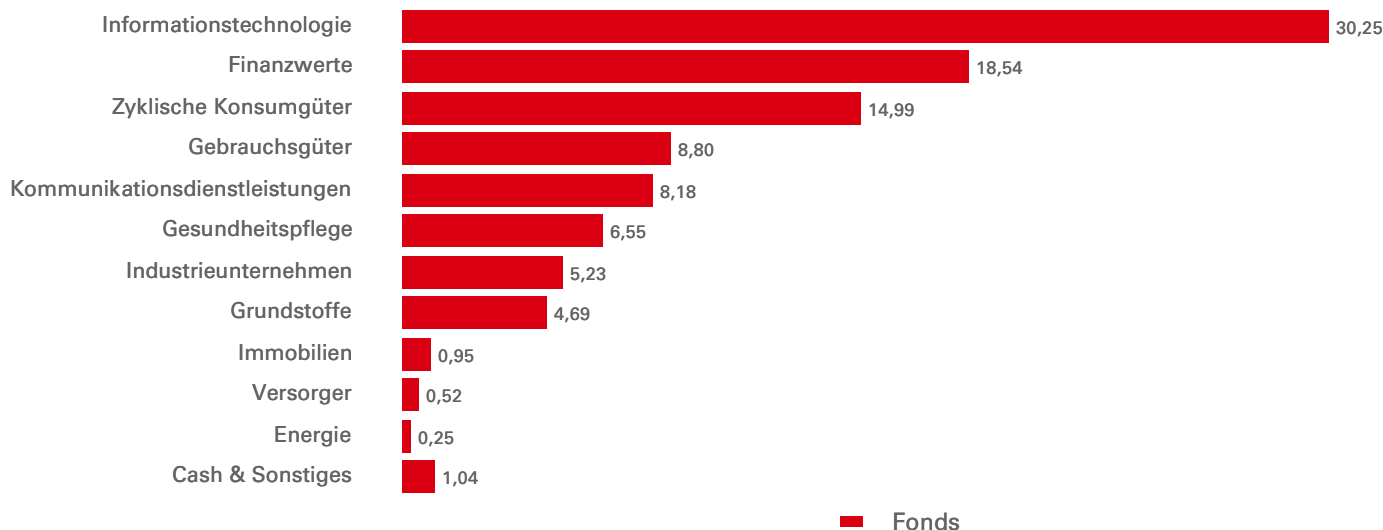
Die Kohlenstoffintensität misst die Menge der Kohlenstoffemissionen eines Unternehmens (Tonnen CO₂e/Mio. USD)
 Quelle: Trucost

Aktienmerkmale	Fonds	Benchmark	Benchmark
Anzahl der Positionen (ohne Kasse)	198	--	Index-Name 100% MSCI Emerging Markets Value SRI ESG Target Select Index
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (USD Mio.)	148.294	148.243	Index-Währung USD
Kurs-Gewinn-Verhältnis	9,98	9,98	TR-Index Bloomberg-Ticker NU749043
			TR-Index Reuters RIC .dMIEF0002CNUS

Fondsfakten

Fondsmanager	HSBC Global Asset Management (UK) Limited
Verwahrstelle	HSBC Continental Europe
Fondsverwalter	HSBC Securities Services (Ireland) DAC

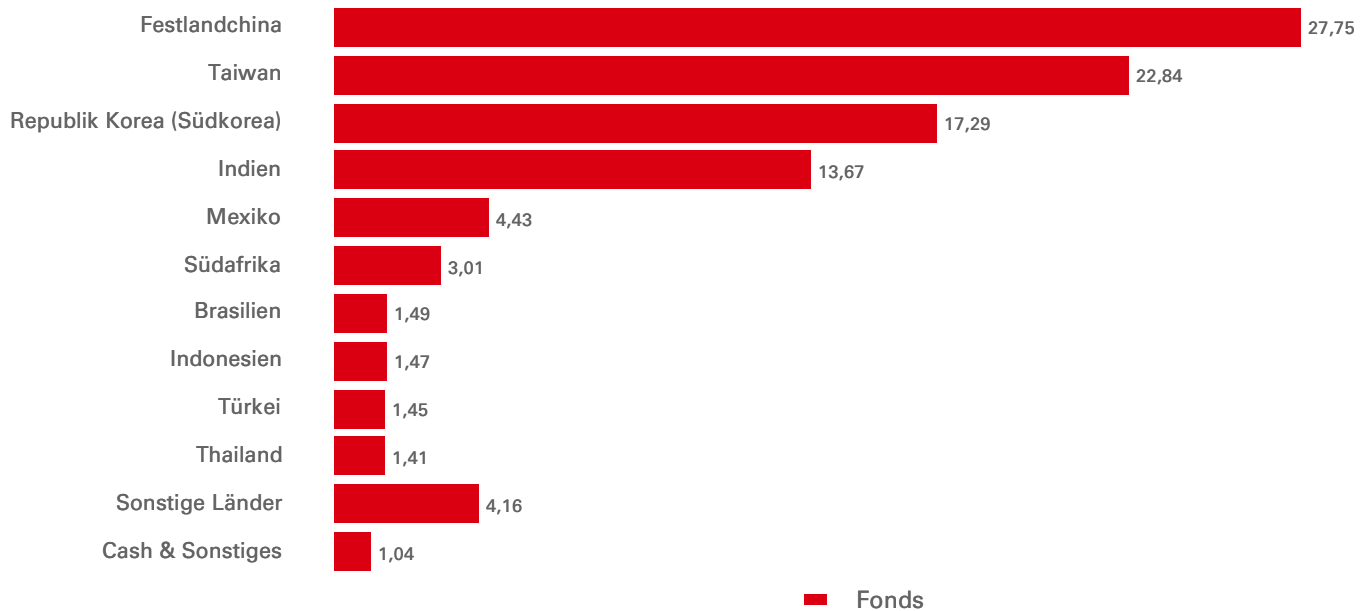
Sektorallokation (%)



Die frühere Wertentwicklung lässt keine Vorhersagen für die künftige Wertentwicklung zu. Die dargestellte Wertentwicklung basiert auf Netto-Inventarwerten. Ein Ausgabeaufschlag und Ihr Depotpreis (soweit diese anfallen) sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und wirken sich negativ auf die Wertentwicklung der Anlage aus. Bei einer Anlagesumme von EUR 1.000 ist für die Anschaffung ein Ausgabeaufschlag in der Höhe von z.B. 5% zu berücksichtigen. Die dargestellte Wertentwicklung verringert sich in diesem Beispiel um EUR 50. Zusätzlich fällt ein jährliches Entgelt für die Verwahrung und Verwaltung an. Die tatsächlichen Entgelte ergeben sich aus dem Preis- und Leistungsverzeichnis Ihrer Bank.

Breiter Marktindex: MSCI EM Enhanced Value
 Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 30 Juni 2024

Geografische Allokation (%)



Top 10 Positionen	Sektor	Gewichtung (%)
Taiwan Semiconductor Co Ltd	Informationstechnologie	12,87
Samsung Electronics Co Ltd	Informationstechnologie	3,94
China Construction Bank Corp	Finanzwerte	2,98
Tencent Holdings Ltd	Kommunikationsdienstleistungen	2,68
ICBC	Finanzwerte	2,50
United Microelectronics Corp	Informationstechnologie	2,32
ASE Technology Holding Co Ltd	Informationstechnologie	1,98
Hyundai Motor Co	Zyklische Konsumgüter	1,90
Fomento Economico Mexicano SAB	Gebrauchsgüter	1,76
Hindustan Unilever Ltd	Gebrauchsgüter	1,72

Bei den zehn größten Positionen sind Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sowie Geldmarktfonds nicht berücksichtigt.

Name der Börse	Notierungstag	Handels- währung	Handels-zeiten	Bloomberg- Ticker	Reuters RIC	iNAV Bloomberg	iNAV Reuters
LONDON STOCK EXCHANGE	08 Dez 2022	USD	08:00 - 16:30	HEMV LN	HEMV.L	HEMVUXIV	HEMVUSDINA V=SOLA
LONDON STOCK EXCHANGE	08 Dez 2022	GBP	08:00 - 16:30	HEVS LN	HEVS.L	HEVSGXIV	HEVSGBPINAV =SOLA
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	09 Dez 2022	EUR	09:00 - 17:30	HEVS FP	HEVS.PA	H41EEXIV	H41EEURINAV =SOLA
BORSA ITALIANA SPA	09 Dez 2022	EUR	09:00 - 17:35	HEMV IM	HEMV.MI	H41EEXIV	H41EEURINAV =SOLA
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	09 Dez 2022	EUR	09:00 - 17:30	H41E GY	H41E.DE	H41EEXIV	H41EEURINAV =SOLA

Emissionen aus Reserven (mn Tonnen/USDmn)	Fonds	Breiter Marktindex
Emissionen aus Reserven/ Marktkapitalisierung	0,00000	8.286,52710

Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Breiter Marktindex	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	0,56	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	0,14
VIBRA ENERGIA SA	1,65	GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	0,39
ASUSTEK COMPUTER INC	1,82	QIFU TECHNOLOGY INC	0,52
ACER INC	1,84	37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	0,56
DB INSURANCE CO LTD	1,97	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	0,85
BANCO DO BRASIL S.A.	2,72	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	0,95
LENOVO GROUP LTD	2,76	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	0,96
UNION BANK OF INDIA	2,84	ABB INDIA LTD	1,03
CANARA BANK	2,88	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	1,06
SINOPHARM GROUP CO-H	3,17	BANCO BRADESCO S,A,	1,11

Top 10 Emittenten mit der höchsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Breiter Marktindex	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	10.384,13	ACWA POWER CO	53.342,22
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	6.764,07	NTPC LTD	17.616,33
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	4.017,37	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	14.350,49
CEMEX SAB-CPO	2.541,21	JSW ENERGY LTD	13.792,42
LG CORP	2.434,48	ADANI POWER LTD	12.873,20
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	2.432,87	ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	12.645,03
MEIHUA HOLDINGS GROUP CO -A	2.343,44	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	11.853,81
SD GUTHRIE BHD	2.130,73	DATANG INTL POWER GEN CO-A	11.242,76
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	2.031,51	HUADIAN POWER INTL CORP-A	10.920,18
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	1.851,17	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	10.384,13

ESG-Score der zehn größten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	12.874%	10.0	6.7	7.9	7.1	169.7
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2.981%	8.6	6.9	6.9	6.0	17.0
TENCENT HOLDINGS LTD	2.683%	4.2	9.8	3.8	3.7	36.6
IND & COMM BK OF CHINA-H	2.496%	7.4	5.9	5.9	5.1	18.5
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2.318%	7.8	6.4	6.2	5.9	314.9
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2.188%	8.3	6.4	5.6	3.9	84.8
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1.984%	6.9	5.9	6.3	5.3	100.4
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1.758%	7.0	9.2	5.0	4.5	51.8
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1.748%	8.3	6.4	5.6	3.9	84.8
HINDUSTAN UNILEVER LTD	1.719%	7.4	4.2	6.3	5.7	33.2

Breiter Marktindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	9.719%	10.0	6.7	7.9	7.1	169.7
TENCENT HOLDINGS LTD	4.178%	4.2	9.8	3.8	3.7	36.6
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.746%	8.3	6.4	5.6	3.9	84.8
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1.863%	5.1	5.9	4.5	3.0	40.4
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1.514%	6.8	6.2	5.6	5.9	480.6
SK HYNIX INC	1.243%	6.9	4.3	7.3	5.8	207.2
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1.090%	3.2	4.6	2.3	5.9	29.1
PDD HOLDINGS INC	1.053%	1.7	6.7	3.3	3.9	36.9
ICICI BANK LTD	0.990%	6.8	5.9	5.5	4.3	10.7
MEITUAN-CLASS B	0.956%	5.0	10.0	4.7	4.1	29.6

ESG-Score der zehn kleinsten Positionen nach Gewichtung

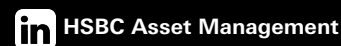
Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
TURKIYE IS BANKASI-C	0.000%	3.4	6.3	4.1	2.1	9.8
HORIZON CONSTRUCTION DEVELOP*^	0.003%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	0.007%	8.1	9.2	6.7	5.5	16.0
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	0.008%	7.4	9.5	5.4	7.1	28.1
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	0.009%	4.1	3.4	3.0	5.6	118.5
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	0.010%	0.0	2.9	5.4	2.9	56.5
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	0.011%	6.1	4.2	6.3	3.9	35.4
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	0.012%	3.1	8.0	7.9	2.0	28.0
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	0.012%	10.0	6.8	6.4	6.1	301.0
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	0.012%	7.7	5.6	4.4	6.7	406.7

Breiter Marktindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	0.001%	8.1	9.2	6.7	5.5	16.0
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	0.002%	0.7	2.5	1.7	3.0	118.4
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	0.002%	6.9	5.0	6.8	4.1	65.8
JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO -A	0.002%	0.0	2.9	5.4	2.9	56.5
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	0.002%	2.7	3.9	4.6	3.1	29.3
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	0.002%	1.4	5.4	1.9	3.2	91.4
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	0.002%	1.9	6.5	4.6	3.8	41.0
SHANGHAI MOONS' ELECTRIC C-A	0.002%	1.5	5.7	4.0	3.6	41.0
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	0.002%	1.8	4.1	3.7	2.6	188.2
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	0.002%	0.0	5.0	2.9	3.2	193.7

Angaben zu Risiken

- Der Fonds kann Derivate verwenden, deren Verhalten unvorhersehbar sein kann. Die Preisbildung und Volatilität vieler Derivate kann von der strengen Nachbildung der Preisbildung oder Volatilität ihrer zugrunde liegenden Referenzwerte, Instrumente oder Vermögenswerte abweichen.
- Eine Anlagehebelung tritt auf, wenn das wirtschaftliche Engagement größer als der investierte Betrag ist, z. B. bei der Verwendung von Derivaten. Ein Fonds, der eine Hebelung einsetzt, kann aufgrund des Verstärkungseffekts bei einer Preisänderung der Referenzquelle höhere Gewinne und/oder Verluste erfahren.
- Weitere Informationen zu den potenziellen Risiken finden Sie in den Basisinformationsblatt und/oder im Prospekt bzw. Emissionsprospekt.

Follow us on:



Telefon: +49 (0) 211 910 4784 E-Mail:

fonds@hsbc.de Website:

www.etf.hsbc.com

Für weitere Informationen kontaktieren

Sie uns bitte Tel: +49 (0)211 910 4784.

Webseite:

www.assetmanagement.hsbc.de/de

Glossar



Index-Haftungsausschluss

Quelle: MSCI. Die MSCI-Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet werden, dürfen in keiner Weise vervielfältigt oder weiterverbreitet und nicht als Grundlage für oder als Komponente von Finanzinstrumenten, -produkten oder -indizes herangezogen werden. Keine der MSCI-Informationen ist dazu bestimmt, als Anlageberatung oder Empfehlung für (oder gegen) jegliche Art von Anlageentscheidung zu dienen und kann daher nicht als solche herangezogen werden. Historische Daten und Analysen sollten nicht als Maßstab oder Garantie für zukünftige Performance-Analysen, -Prognosen oder -Vorhersagen angesehen werden. Die MSCI-Informationen werden ohne Haftung und Gewähr zur Verfügung gestellt, wer diese Informationen nutzt, trägt das gesamte Risiko der Nutzung dieser Informationen. MSCI, jedes seiner verbundenen Unternehmen und jede weitere an der Erfassung, Berechnung oder Erstellung von MSCI-Informationen beteiligte oder damit befasste Person (zusammen die „MSCI-Parteien“) lehnt ausdrücklich alle Zusicherungen (einschließlich, ohne einschränkende Wirkung, jede Garantie der Ursprünglichkeit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, der Wahrung von Eigentumsrechten, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck) hinsichtlich dieser Informationen ab. Ohne dass das Vorgenannte dadurch eingeschränkt wird, haften die MSCI-Parteien keinesfalls in irgendeiner Weise für unmittelbare, mittelbare, konkrete, Folgeschäden oder irgendwelche sonstigen Schäden oder für Schadensersatzleistungen mit Strafcharakter (einschließlich entgangener Gewinne). (www.msci.com)

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 30 Juni 2024

Wichtige Informationen

Das hierin enthaltene Material dient nur zu Marketingzwecken und zu Ihrer Information. Dieses Dokument ist weder vertraglich bindend noch sind wir verpflichtet, es Ihnen durch eine gesetzliche Bestimmung zur Verfügung zu stellen. Es stellt weder eine Rechts-, Steuer- oder Anlageberatung noch eine Empfehlung an die Leser dieses Materials zum Kauf oder Verkauf von Anlagen dar. Sie dürfen sich daher bei Anlageentscheidungen nicht auf den Inhalt dieses Dokuments stützen.

Die Informationen in diesem Dokument beruhen auf externen Quellen, die wir für zuverlässig halten, aber keiner neutralen Prüfung unterzogen haben. Wir übernehmen weder Gewähr noch Haftung für die Richtigkeit und Vollständigkeit der Informationen. Die in diesem Dokument vertretenen Meinungen stellen ausschließlich die Auffassungen des Autors/der Autoren dar und können sich jederzeit ändern; solche Meinungsänderungen müssen nicht publiziert werden. Der Fonds ist nicht für jeden Anleger geeignet. Es ist möglich, dass der Anleger bei Investment in diesen Fonds einen Verlust, auch bis zur Höhe seines gesamten Investments, erleidet. Die Informationen ersetzen nicht den allein maßgeblichen Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen und aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte. Diese erhalten Sie kostenlos bei der HSBC Continental Europe S.A, Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf sowie unter www.assetmanagement.hsbc.de.

Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

Weitere Informationen über die Gesellschaft, einschließlich des Prospekts, der letzten Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft und der aktuellen Anteilspreise, können bei der Verwaltungsstelle per E-Mail an ifsinvestorqueries@hsbc.com oder unter www.etf.hsbc.com kostenlos in englischer Sprache angefordert werden. Einzelheiten zu den zugrunde liegenden Anlagen des Fonds sind unter www.etf.hsbc.com verfügbar. Der indikative Intraday-Nettoinventarwert des Fonds wird auf mindestens einem Terminal der großen Marktdatenanbieter, z. B. Bloomberg, angezeigt sowie auf zahlreichen Websites, die Aktienmarktdaten enthalten, darunter www.reuters.com.

Der aktuelle Prospekt ist auf Englisch, Deutsch und Französisch verfügbar. Die Basisinformationsblätter (PRIIPs KID) sind in der Landessprache verfügbar, in der sie registriert sind.

Laufzeit: Die Verwaltungsgesellschaft kann den Fonds nicht einseitig kündigen. Der Verwaltungsrat kann darüber hinaus unter bestimmten im Prospekt und in der Satzung des Fonds festgelegten Umständen die Liquidation des Fonds beschließen. Weitere zusätzliche und vollständige Informationen insbesondere zu Anlegerrechten, Kosten und Gebühren finden Sie im Prospekt.

Ausführliche Informationen zu den nachhaltigen Anlageprodukten nach Artikel 8 und 9, wie gemäß den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) eingestuft, einschließlich der Beschreibung der ökologischen oder sozialen Merkmale oder des nachhaltigen Anlageziels; der verwendeten Methoden zur Bewertung, Messung und Überwachung der ökologischen oder sozialen Merkmale und der Auswirkungen der ausgewählten nachhaltigen Anlagen sowie Ziele und Referenzwert-Informationen finden Sie unter: <https://www.assetmanagement.hsbc.co.uk/en/intermediary/investment-expertise/sustainable-investments/sustainable-investment-product-offering>