

HSBC ETFs PLC

HSBC BLOOMBERG GLOBAL SUSTAINABLE AGGREGATE 1-3 YEAR BOND UCITS ETF

Ficha mensual 31 de marzo de 2024 | HAGS LN | USD



Objetivo de inversión

El Fondo tiene como objetivo reproducir, en la mayor medida posible, la rentabilidad del Bloomberg MSCI Global Aggregate 1-3 SRI Carbon ESG-Weighted Index (el «Índice»). El Fondo invertirá u obtendrá exposición a bonos emitidos por entidades soberanas que componen el Índice. El Fondo se enmarca en la clasificación del artículo 8 del SFDR.



Estrategia de inversión

El Índice es un subconjunto del índice Bloomberg Barclays Global Aggregate 1-3 Year (el «Índice matriz») y está formado por bonos de renta fija con grado de inversión con un vencimiento de entre 1 y 3 años, tanto de emisores de mercados desarrollados como emergentes, según establece el proveedor del Índice. El Índice tiene como objetivo lograr una reducción de las emisiones de carbono y una mejora de la calificación ambiental, social y de gobernanza (ESG) del MSCI frente a la del Índice matriz. El Fondo se gestiona de forma pasiva y utiliza una técnica de inversión denominada «optimización». El objetivo de esta técnica es minimizar la diferencia de rentabilidad entre el Fondo y el Índice, tomando en cuenta el error de seguimiento y los costes de negociación a la hora de construir una cartera. Puede haber circunstancias en las que el Fondo no pueda invertir en todos los componentes del Índice. El Fondo podrá invertir hasta el 30 % en swaps de rentabilidad total, hasta el 30 % en valores negociados en el CIBM y hasta el 10 % en otros fondos, incluidos los fondos de HSBC. Consulte el Folleto para obtener una descripción detallada de los objetivos de inversión y del uso de derivados.



Riesgos principales

- El valor por participación del Fondo puede aumentar o disminuir, por lo que cualquier capital invertido en el Fondo podrá correr riesgos.
- El Fondo invierte en bonos que generalmente se desvalorizan cuando suben los tipos de interés. Por lo general, cuanto más largo es el plazo de vencimiento, mayor es el riesgo de la inversión en un bono y mejor es la calidad crediticia. Los emisores de ciertos bonos podrían negarse o no ser capaces de pagar sus bonos e incurrir en impago. Los bonos que estén en situación de impago pueden ser difíciles de vender o podrían llegar a no tener ningún valor.
- En la medida en que el Fondo pretenda replicar la rentabilidad de un índice gracias a mantener títulos individuales, no hay garantía de que su composición o rentabilidad se corresponda exactamente con el índice objetivo en ningún momento (“error de seguimiento”).

Detalles de la clase de acción

Datos importantes

Valor liquidativo por acción	USD 10,21
Rentabilidad 1 mes	0,10%
Rendimiento a vencimiento	3,77%

Información sobre el fondo

UCITS	Sí
Tratamiento de dividendos	Acumulación
Frecuencia de negociación	Diaria
Divisa base del fondo	USD
Currency Hedged	Not Hedged
Hora de valoración	23:00 Irlanda
Divisa base de la clase de acciones	USD
Domicilio	Irlanda
Fecha de lanzamiento	13 de enero de 2022
Tamaño del Fondo	USD 90.861.470
Índice de referencia	100% Bloomberg MSCI Global Aggregate 1-3 SRI Carbon ESG-Weighted Index
Gestor	Sebastien Faucher Amnita Sanyal Richard Jenkins

Comisiones y gastos

Inversión inicial mínima	USD 1
Porcentaje total de gastos ¹	0,180%

Códigos

ISIN	IE000XGNMWE1
Código Bloomberg	HAGG LN

¹La cifra de gastos corrientes se basa en los gastos a lo largo de un año. La cifra incluye el cargo de gestión anual, pero no los costes de transacción. Estas cifras pueden variar periódicamente.

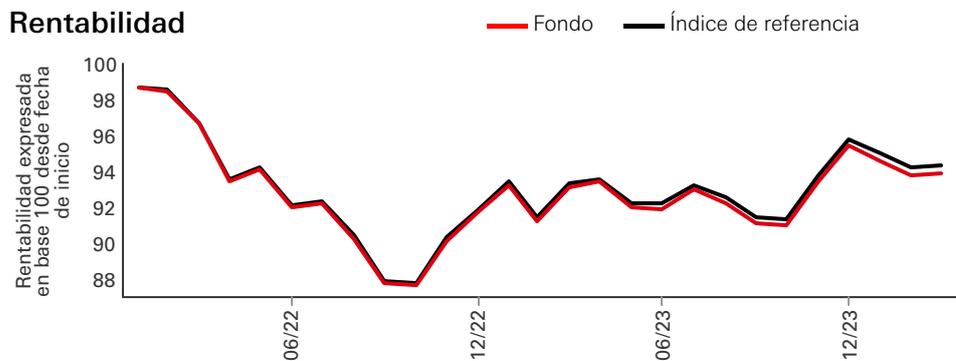
La rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad futura. Los rendimientos futuros dependerán, entre otros factores, de la evolución del mercado, la capacidad del gestor del fondo, el riesgo a nivel del fondo, los costes de gestión y, si procede, los costes de suscripción y reembolso. La rentabilidad, el valor del capital invertido en el fondo, puede ser negativa como resultado de las pérdidas de precios y las fluctuaciones de las divisas. No existe garantía alguna de que todo el capital invertido pueda reembolsarse. A menos que se indique lo contrario, la inflación no se tiene en cuenta.

La presente es una comunicación de promoción comercial. Consulte el folleto del y el KID antes de tomar cualquier decisión de inversión definitiva.

Escanee el código QR del glosario o consulte el Folleto para conocer la definición de los términos.

Fuente: HSBC Asset Management, datos a 31 de marzo de 2024

Rentabilidad



Rentabilidad (%)	Año corriente	1 mes	3 meses	6 meses	1 año	Anualizado a 3 años	Anualizado a 5 años	Anualizado desde su creación
Fondo	-1,57	0,10	-1,57	3,03	0,84	--	--	-2,78
Índice de referencia	-1,48	0,13	-1,48	3,17	1,12	--	--	-2,56

Rentabilidad (%)	31/03/23-31/03/24	31/03/22-31/03/23	31/03/21-31/03/22	31/03/20-31/03/21	31/03/19-31/03/20
Fondo	0,84	-3,63	--	--	--
Índice de referencia	1,12	-3,47	--	--	--

Huella de carbono	Fondo	Índice general de mercado	Calificación ESG de MSCI	Puntuación en criterios ESG	A	S	G
Intensidad de emisiones de carbono	4,14	26,19	Fondo	6,6	6,4	6,7	6,6
La intensidad de carbono mide la cantidad de emisiones de carbono de una empresa (expresada en toneladas de CO ₂ e/millones de USD)			Índice general de mercado	6,0	6,0	6,6	6,3
Fuente del análisis: Trucost							

3 años Medidas de riesgo	Fondo	Índice de referencia	5 años Medidas de riesgo	Fondo	Índice de referencia
Volatilidad	--	--	Volatilidad	--	--
Ratio de Sharpe	--	--	Ratio de Sharpe	--	--
Error de seguimiento	--	--	Error de seguimiento	--	--
Ratio de información	--	--	Ratio de información	--	--

Características de renta fija	Fondo	Índice de referencia	Relativo
N.º de posiciones	346	6.330	--
Average coupon rate	2,42	2,22	0,20
Rendimiento a lo peor	3,73%	3,77%	-0,04%
Duración ajustada por opciones	1,87	1,88	-0,01
Duración modificada a lo peor	1,88	1,88	0,00
Duración de diferenciales ajustada por opciones	1,89	1,90	-0,02
Vencimiento medio	1,97	1,97	0,00
Calificación media	AA/AA-	AA/AA-	--

Calificación crediticia (%)	Fondo	Índice de referencia	Relativo	Desglose de Vencimiento ajustada por opciones (Duración)	Fondo	Índice de referencia	Relativo
AAA	19,68	17,34	2,34	0 - 6months	0,00	0,00	0,00
AA	42,53	45,27	-2,73	6 meses - 1 año	0,01	0,00	0,01
A	28,28	26,82	1,46	1 a 1.5 años	0,23	0,32	-0,09
BBB	8,78	10,57	-1,79	1.5 a 2 años	0,54	0,47	0,07
Liquidez	0,73	--	0,73	2 a 2.5 años	0,52	0,49	0,03
				2.5 a 4 años	0,56	0,58	-0,02
				Total general	1,87	1,88	-0,01

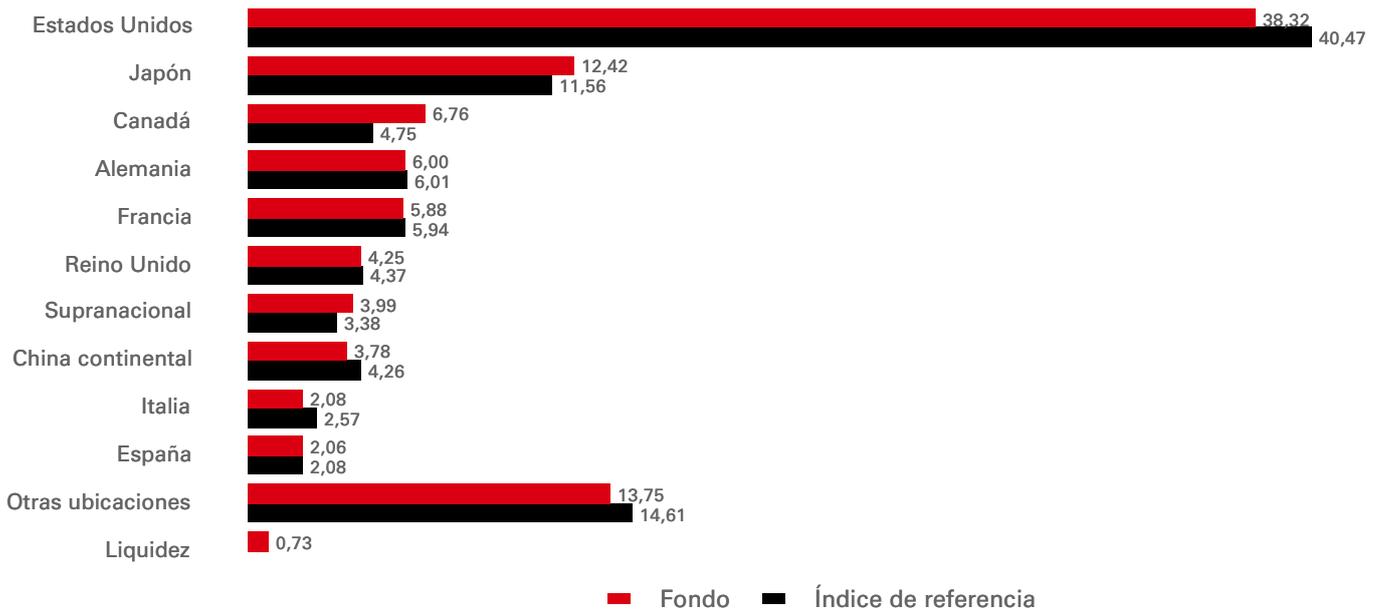
La rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad futura. Los rendimientos futuros dependerán, entre otros factores, de la evolución del mercado, la capacidad del gestor del fondo, el riesgo a nivel del fondo, los costes de gestión y, si procede, los costes de suscripción y reembolso. La rentabilidad, el valor del capital invertido en el fondo, puede ser negativa como resultado de las pérdidas de precios y las fluctuaciones de las divisas. No existe garantía alguna de que todo el capital invertido pueda reembolsarse. A menos que se indique lo contrario, la inflación no se tiene en cuenta.

Índice general de mercado: Bloomberg Global Agg 1-3 Year Total Return Index

Fuente: HSBC Asset Management, datos a 31 de marzo de 2024

Exposición por divisa (%)	Fondo	Índice de referencia	Relativo
USD	47,83	47,73	0,10
EUR	22,91	22,96	-0,05
JPY	10,74	10,85	-0,11
GBP	4,14	4,15	-0,01
CNY	3,88	3,77	0,11
CAD	3,20	3,20	0,00
KRW	1,74	1,72	0,02
AUD	1,51	1,51	0,00
SEK	0,90	0,90	0,00
CHF	0,48	0,47	0,01
Otras divisas	2,67	2,74	-0,07

Desglose geográfico (%)



Desglose sectorial (%)

	Fondo	Índice de referencia	Relativo
Valores del tesoro	63,83	63,94	-0,11
Instituciones Financieras	11,01	11,18	-0,17
Cubierto	5,06	3,89	1,18
Agencias	4,92	5,46	-0,54
Supranacional	3,99	3,36	0,63
AUTORIDAD LOCAL	2,61	2,50	0,11
Consumo cíclico	2,08	1,41	0,67
Consumo no cíclico	1,64	1,80	-0,16
Tecnología	1,24	1,11	0,13
Comunicaciones	0,78	1,00	-0,22
Otros sectores	2,11	4,35	-2,24
Liquidez	0,73	--	0,73

10 principales posiciones	Ponderación (%)
JAPAN GOVT 5-YR 0,005 20/12/26	1,37
JAPAN GOVT 10-YR 0,100 20/03/27	1,27
US TREASURY N/B 0,250 31/07/25	1,04
JAPAN GOVT 5-YR 0,005 20/06/26	0,96
US TREASURY N/B 4,000 15/12/25	0,93
US TREASURY N/B 4,500 15/11/25	0,89
US TREASURY N/B 3,000 30/09/25	0,87
JAPAN GOVT 5-YR 0,005 20/09/26	0,87
US TREASURY N/B 2,500 31/03/27	0,84
JAPAN GOVT 5-YR 0,100 20/09/25	0,84

Entre las 10 principales participaciones no se incluyen participaciones en efectivo y equivalentes de efectivo ni fondos del mercado monetario.

Nombre de la bolsa	Fecha de cotización	Divisa de cotización	Horario de negociación (hora local)	Código Bloomberg	RIC de Reuters	iNAV de Bloomberg	iNAV de Reuters
LONDON STOCK EXCHANGE	14 ene. 2022	USD	08:00 - 16:30	HAGG LN	HAGG.L	HAGUSDIV	HAGGUSDINA V=SOLA
LONDON STOCK EXCHANGE	14 ene. 2022	GBP	08:00 - 16:30	HAGS LN	HAGS.L	HAGGBPIV	HAGSGBPINA =SOLA
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	14 ene. 2022	EUR	09:00 - 17:30	HAGG FP	HAGG.PA	HAGEURIV	HAGGEURINA =SOLA
BORSA ITALIANA SPA	18 ene. 2022	EUR	09:00 - 17:35	HAGG IM	HAGG.MI	HAGEURIV	HAGGEURINA =SOLA
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	18 ene. 2022	EUR	09:00 - 17:30	HGGA GY	HGGA.DE	HAGEURIV	HAGGEURINA =SOLA
SIX SWISS EXCHANGE		USD	--	HAGG SW	HAGG.S	HAGUSDIV	HAGGUSDINA V=SOLA

Las diez empresas principales con menor intensidad de emisiones de carbono

Fondo	Intensidad de emisiones de carbono (toneladas de CO ² /millón de USD)	Índice general de mercado	Intensidad de emisiones de carbono (toneladas de CO ² /millón de USD)
AAPL 4.421 05/08/26	0,10	ATHORA V2,25 07/15/31	0,10
RENTEN 0.875 03/30/26	0,10	KNABNL 0,01 11/16/25 EMTN	0,10
CABKSM V1.625 04/13/26 GMTN	0,30	SCOR V3 06/08/46	0,10
NYKRE 2 01/01/26 13H	0,30	CNPFP V4,25 06/05/45	0,10
NDAFH V4.375 09/06/26 EMTN	0,50	HANRUE V3,375 PERP	0,10
DANBNK 2.125 09/16/25	0,50	JUSTLN V7 04/15/31	0,10
DANBNK V4.625 04/13/27 EMTN	0,50	SBAB 0,125 08/27/26 EMTN	0,10
INGAU 4.837 03/22/27 MTn	0,50	SBAB 0,5 06/11/25 146	0,10
INTNED 3 02/15/26	0,50	SRBANK 0,01 10/08/26 EMTN	0,10
NDAFH 1 04/01/25 CC2	0,50	SRBANK 0,25 11/09/26 EMTN	0,10

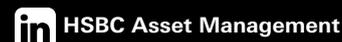
Las diez empresas principales con mayor intensidad de emisiones de carbono

Fondo	Intensidad de emisiones de carbono (toneladas de CO ² /millón de USD)	Índice general de mercado	Intensidad de emisiones de carbono (toneladas de CO ² /millón de USD)
UNP 4.75 02/21/26 .	382,10	NTPCIN 2,75 02/01/27 EMTN	15.696,60
FE 5.15 03/30/26 144A	336,40	HUADIA V3,375 PERP	11.157,90
NGGLN 2.179 06/30/26 emtn	270,60	ZJENGI 1,737 07/20/26 EMTN	9.459,30
ANNGR 1.375 01/28/26 EMTN	159,30	HXCEME 2,25 11/19/25 emtn	8.290,10
EJRAIL 2.614 09/08/25 EMTN	154,40	KOMIPW 1,25 08/09/26	7.470,90
BNFP 0 12/01/25 EMTN	54,00	PPL 3,3 10/01/25 25	7.024,80
T 3.55 11/18/25	48,70	KOSOPW 0,75 01/27/26 REGS	6.780,90
SBUX 4.85 02/08/27	42,40	CPXCN 4,986 01/23/26 MTN	6.719,10
NESNVX 0 12/03/25	39,20	AEP 3,4 06/01/25	6.307,30
NESNVX 1.625 11/07/25	39,20	AEP 1,65 03/15/26 N	6.233,10

Divulgación de riesgos

- El apalancamiento de la inversión ocurre cuando la exposición económica es mayor que la cantidad invertida, como cuando se emplean derivados. Un Fondo que emplea apalancamiento podrá experimentar mayores ganancias y/o pérdidas, debido al efecto amplificador de una fluctuación en el precio de la fuente de referencia.
- Al mantener inversiones en el exterior, el tipo de cambio también puede provocar la fluctuación del valor de dichas inversiones.
- Consulte el Documento de Datos Fundamentales (KID), el Folleto o el Memorándum de Oferta para obtener más información sobre los posibles riesgos relativos a la inversión.

Síguenos en:



Glosario



Aviso legal del índice

BLOOMBERG® es una marca comercial y marca de servicio de Bloomberg Finance L.P. y sus filiales (en adelante, conjuntamente, "Bloomberg"). BARCLAYS® es una marca comercial y marca de servicio de Barclays Bank Plc (en adelante, conjuntamente con sus filiales, "Barclays"), utilizada bajo licencia. Los licenciatarios de Bloomberg o Bloomberg, que incluyen a Barclays, poseen todos los derechos de propiedad en relación con los Índices de Bloomberg Barclays. Ni Bloomberg ni Barclays aprueban o respaldan el material, o garantizan la precisión o integridad de ninguna información contenida en el presente, o realizan ninguna garantía, expresa o implícita, en relación con los resultados que deben obtenerse de estos y, en la máxima medida permitida por ley, no serán responsables de ninguna responsabilidad por lesiones o daños y perjuicios que surjan en relación con estos.

Fuente: MSCI. La información de MSCI solo podrá ser usada para uso interno, no podrá ser reproducida ni difundida de nuevo de ninguna manera y no podrá ser usada como base para un componente de cualquier instrumento financiero, producto o índice. Ninguno de los datos de MSCI pretende constituir consejos de inversión o recomendaciones para hacer (o abstenerse de hacer) cualquier decisión de inversión y no deberán ser considerados como tal. Los datos históricos y análisis no deberían tomarse como indicativo o garantía de ningún análisis de rendimiento futuro, previsión o predicción. Los datos de MSCI se facilitan tal como son y el usuario de estos datos asume todo el riesgo por cualquier uso que se haga de los mismos. MSCI, cada uno de sus afiliados y cada una de las personas involucradas o relacionadas con la compilación, informatización o creación de datos de MSCI (conjuntamente, las "partes MSCI") expresamente declinan toda garantía (incluida, sin limitación, cualquier garantía de originalidad, precisión, integridad, actualidad, de no incumplimiento, comerciabilidad e idoneidad para un propósito particular) en relación con esta información. Sin que esto limite nada de lo antedicho, las partes MSCI no tendrán en ningún caso responsabilidad alguna por cualquier daño y perjuicio directo, indirecto, especial, punitivo o resultante (incluido, entre otros, el lucro cesante) ni por ningún otro daño. (www.msci.com)

Fuente: HSBC Asset Management, datos a 31 de marzo de 2024

Información importante

Los contenidos del presente documento se facilitan con fines comerciales y meramente informativos. El presente documento no constituye un contrato vinculante ni estamos obligados a proporcionárselo con tal fin en virtud de ninguna disposición legislativa. De igual forma, no constituye ningún tipo de asesoramiento jurídico, fiscal ni de inversión, ni tampoco una recomendación para ningún lector en lo que respecta a operaciones de compra o venta de productos de inversión. Por tanto, no debe basarse en los contenidos del presente documento a la hora de tomar decisiones de inversión.

La información contenida en este documento tiene únicamente carácter informativo y no constituye asesoramiento de inversión ni ninguna recomendación para que el lector de esta información efectúe operaciones de compra o venta de productos de inversión. Si bien se ha procurado garantizar la precisión de este documento, HSBC Asset Management no asume responsabilidad alguna por posibles errores u omisiones en él. La información aportada en este documento está sujeta a cambios sin previo aviso. Toda reproducción y cualquier uso no autorizados de estos comentarios y análisis serán responsabilidad del usuario, y de llevarse a cabo dichas acciones, los responsables pueden verse sometidos a procesos judiciales. Este documento no tiene valor contractual y de ningún modo constituye ni una invitación ni una recomendación para comprar o vender instrumentos financieros cualesquiera, en aquellas jurisdicciones en las que dicha oferta no sea legal. Los comentarios y análisis presentados en este documento reflejan la opinión que HSBC Asset Management tiene de los mercados, según la información disponible hasta la fecha. No implican ningún tipo de compromiso por parte de HSBC Asset Management. Por lo tanto, HSBC Asset Management no asumirá responsabilidad alguna derivada de decisiones de inversión o desinversión motivadas por los comentarios o análisis de este documento. Todos los datos facilitados pertenecen a HSBC Asset Management a menos que se especifique lo contrario. Toda la información perteneciente a terceros se ha obtenido de fuentes que consideramos fiables, pero que no hemos verificado de forma independiente. Cualquier información que se muestre sobre rentabilidades se refiere al pasado, y no debe ser tomada como una indicación de rentabilidades futuras. Las inversiones pueden no ser adecuadas para todas las necesidades y si usted tiene dudas sobre las mismas, debe buscar el asesoramiento de un asesor de inversiones.

HSBC Asset Management es el nombre comercial de la sociedad de gestión de activos de HSBC.

HSBC Global Asset Management (France), Sucursal en España es una Sucursal de HSBC Global Asset Management (France) - 421 345 489 RCS Nanterre. Sociedad de Gestión de Activos regulada por la Autorité des marchés financiers (AMF) con número GP99026, Dirección Postal: 38 avenue Kléber 75116 PARIS, Domicilio Social: Immeuble Coeur Défense 110, esplanade du Général de Gaulle - La Défense 4 - France.

Este ETF de HSBC es un subfondo de HSBC ETFs plc, una sociedad de inversión de capital variable con separación de pasivos entre subfondos constituida en Irlanda como public limited company (sociedad anónima), autorizada por el Banco Central de Irlanda, y registrada en España en la Comisión Nacional del Mercado de Valores con el nº 866 en el registro de Instituciones de Inversión Colectiva Extranjeras. Por lo general, las acciones compradas en el mercado secundario no pueden volverse a vender directamente a la Sociedad. Los inversores han de comprar y vender acciones en el mercado secundario con la ayuda de un intermediario (p. ej., un agente de bolsa) y, por ello, podrán incurrir en comisiones. Además, es posible que los inversores tengan que pagar un precio más elevado que el del Valor liquidativo actual por acción cuando compren acciones, y podrán recibir una cantidad inferior al Valor liquidativo actual por acción cuando las vendan. Los ETF de HSBC están gestionados por HSBC Global Asset Management (UK) Limited, 8 Canada Square, Canary Wharf, Londres, E14 5HQ, Reino Unido, una sociedad de gestión autorizada y regulada por el organismo regulador de este país, The Financial Conduct Authority (FCA). La venta de acciones de HSBC ETFs plc no se ha ofertado ni se ofertará en los Estados Unidos de América, sus territorios, posesiones o zonas sometidas a su jurisdicción. Dicha venta tampoco se ofertará a Personas estadounidenses. Tenga en cuenta que los fondos incluidos en este material pueden estar sujetos a leyes externas al Espacio Económico Europeo (EEE). La legislación local puede variar, y dichas alternaciones podrían afectar a los derechos que tiene con respecto a los fondos. Todas las solicitudes se realizan basándose en el Folleto y en el Documento de datos fundamentales para el inversor (KIID) de HSBC ETFs plc que estén vigentes en ese momento, así como en los informes anuales y semestrales más recientes, que pueden consultarse en nuestro sitio web www.assetmanagement.hsbc.es/es o solicitarse de forma gratuita a HSBC Global Asset Management (France), Sucursal en España con domicilio en la Plaza de Pablo Ruiz Picasso, número 1, Torre Picasso planta 32, Madrid 28020, regulado por la CNMV, o a través de cualquier sub-distribuidor autorizado por la CNMV.

"Puede obtener más información sobre la Sociedad y consultar el Folleto, los informes anual y semestral más recientes de la Sociedad y los últimos precios de las acciones o participaciones de forma gratuita, en inglés, a través del Administrador, mediante el correo electrónico ifsinvestorqueries@hsbc.com o visitando www.etf.hsbc.com. Los detalles de las inversiones subyacentes del fondo están disponibles en www.etf.hsbc.com. Podrá consultar el valor liquidativo intradiario del fondo al menos en una de las principales terminales de los proveedores de datos de mercado, como Bloomberg, así como en todo un abanico de sitios web que publican datos del mercado bursátil, como www.reuters.com. El Folleto más reciente se encuentra disponible en inglés, alemán y francés. Los documentos de datos fundamentales de PRIIP (DDF de PRIIP) están disponibles en el idioma local de la jurisdicción de registro.

Copyright © 2024. HSBC Global Asset Management (France). Reservados todos los derechos.

Para obtener información adicional, consulte el Folleto y el Documento de datos fundamentales para el inversor.

Plazo: La sociedad gestora no puede disolver el Fondo unilateralmente. Asimismo, el Consejo de Administración podrá decidir liquidar el Fondo en determinadas circunstancias que se detallan en el folleto y los estatutos del Fondo. Consulte el folleto para obtener información adicional y exhaustiva, lo que incluye los derechos de los inversores, los costes y los gastos, entre otros.

Se puede obtener información detallada de los productos de inversión sostenible enmarcados en los artículos 8 y 9 del Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR, por sus siglas en inglés), así como una descripción de sus características medioambientales o sociales, o de su objetivo de inversión sostenible; y también puede consultar las metodologías utilizadas para evaluar, medir y supervisar las características medioambientales o sociales y el impacto de las inversiones sostenibles seleccionadas, así como información sobre los objetivos de inversión o el índice de referencia. Para ello, visite: <https://www.assetmanagement.hsbc.co.uk/en/intermediary/investment-expertise/sustainable-investments/sustainable-investment-product-offering>