

HSBC ETFs PLC

HSBC JAPAN SUSTAINABLE EQUITY UCITS ETF

Monatlicher bericht 31 August 2023 | HSJD SW | USD



Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des FTSE Japan ESG Low Carbon Select Index (der Index) so genau wie möglich nachzubilden. 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 SFDR.



Anlagestrategie

Der Index strebt eine Reduzierung der CO₂-Emissionen und des Engagements in fossile Brennstoffreserven und eine Verbesserung des ESG-Ratings des FTSE Russell Index an. Der Index strebt eine Reduzierung der CO₂-Emissionen und der Belastung durch fossile Brennstoffreserven sowie eine Verbesserung des ESG-Ratings des FTSE Russell Index im Vergleich zum Hauptindex an. Er schließt Aktien von Unternehmen aus, die in folgenden Bereichen tätig sind: Tabak, Förderung von Kraftwerkskohle, Stromerzeugung, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung und umstrittene Waffen. Der Index wendet zudem unter anderem die Ausschlusskriterien des United Nations Global Compact an. 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 darf unter außergewöhnlichen Marktbedingungen bis zu 35 % in Wertpapiere eines einzigen Emittenten investieren. Der Fonds kann bis zu 10 % in Fonds 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 Wert investierbarer Wertpapiere kann sich im Laufe der Zeit aufgrund einer Vielzahl von Faktoren ändern, insbesondere politische und wirtschaftliche Neuigkeiten, Regierungspolitik, demografische, kulturelle und bevölkerungsbezogene Veränderungen, Natur- oder von Menschen verursachte Katastrophen usw.
- 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“).

Fondsfakten

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

Anteilklasse and Tracking Error Details

Wesentliche Kennzahlen

NAV je Anteil	USD 15,01
Wertentwicklung 1 Monat	-1,94%
Tracking Error 3 Jahre	0,08%

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	4 Juni 2020
Anzahl der Anteile im Umlauf	12.789.048
Fondsvermögen	USD 230.289.211
Benchmark	100% FTSE Japan ESG Low Carbon Select Index
Nachbildungsmethode	Physisch
SIPP-berechtigt	Ja
Emittent	HSBC ETFs PLC
Ende des Geschäftsjahres	Dez.

Gebühren und Kosten

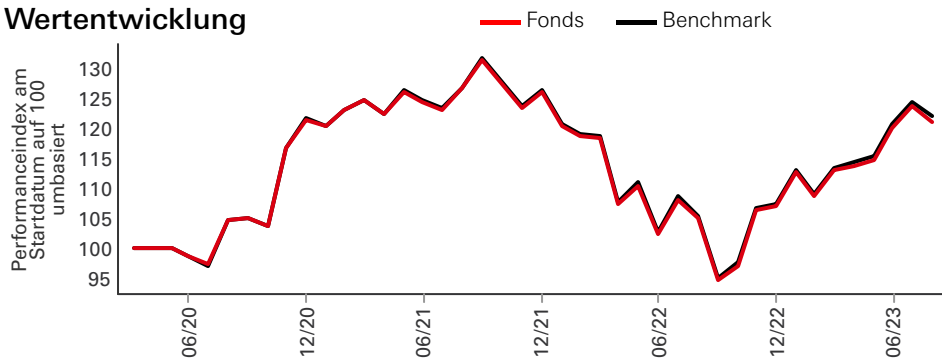
Laufende Kostenquote ¹	0,180%
-----------------------------------	---------------

Codes

ISIN	IE00BKY55S33
Valoren	55292089

¹Laufende Kostenquote, basiert auf Kosten über ein Jahr. Die Quote beinhaltet jährliche Verwaltungsgebühren und zugrunde liegende Transaktionskosten. Dieser Wert kann von Zeit zu Zeit variieren.

Wertentwicklung



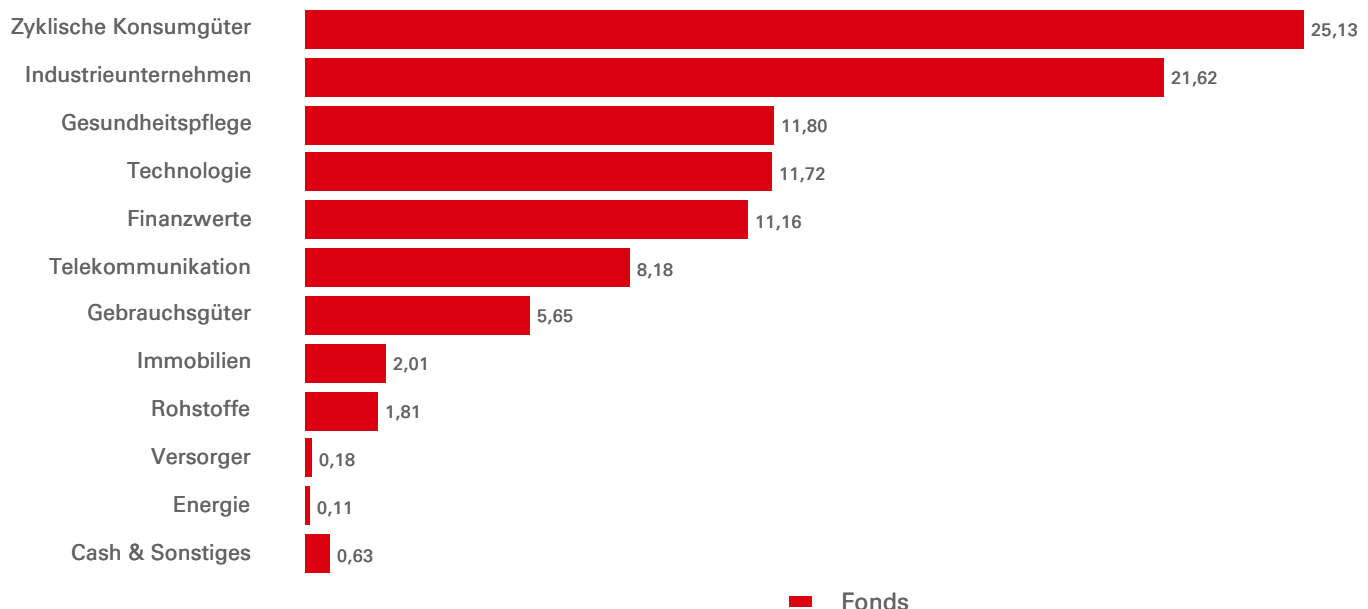
Wertentwicklung (%)	YTD	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre annualisiert	5 Jahre annualisiert	Seit Auflegung annualisiert
Fonds	13,35	-1,94	5,65	11,67	15,54	5,09	--	6,12
Benchmark	13,52	-1,93	5,72	11,81	15,79	5,30	--	6,32
Differenz	-0,17	-0,02	-0,06	-0,14	-0,25	-0,21	--	-0,20
Tracking Error	--	--	--	--	0,07	0,08	--	0,09

Rollierende Wertentwicklung (%)	31/08/22-31/08/23	31/08/21-31/08/22	31/08/20-31/08/21	31/08/19-31/08/20	31/08/18-31/08/19
Fonds	15,54	-17,14	21,24	--	--
Benchmark	15,79	-16,99	21,49	--	--

Klimabilanz	Fonds	Breiter Marktindex	FTSE ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Kohlenstoffintensität	43,30	89,17	Fonds	4,1	4,0	4,2	4,2
Die Kohlenstoffintensität misst die Menge der Kohlenstoffemissionen eines Unternehmens (Tonnen CO ² e/Mio. USD) Quelle: Trucost			Breiter Marktindex	3,6	3,4	3,6	3,8

Aktienmerkmale	Fonds	Benchmark	Benchmark
Anzahl der Positionen ohne Barmittel	329	330	Index-Name
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (USD Mio.)	66.567	66.536	100% FTSE Japan ESG Low Carbon Select Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis	12,64	12,64	Index-Währung
			USD
			Häufigkeit der Index-Neugewichtung
			Jährlich
			TR-Index Bloomberg-Ticker
			ELCJPNN
			TR-Index Reuters RIC
			.TFTELCJPNNU

Sektorallokation (%)



Die frühere Wertentwicklung lässt keine Vorhersagen für die künftige Wertentwicklung zu. Die Zahlen werden in der Basiswährung der Anteilklasse nach Abzug von Gebühren berechnet.

Breiter Marktindex: FTSE Japan

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 August 2023

Top 10 Positionen	Sektor	Gewichtung (%)
Toyota Motor Corp	Zyklische Konsumgüter	9,92
Sony Group Corp	Zyklische Konsumgüter	4,45
SoftBank Group Corp	Telekommunikation	3,96
ITOCHU Corp	Industrieunternehmen	3,44
KDDI Corp	Telekommunikation	3,43
Mitsubishi UFJ Financial Group	Finanzwerte	3,26
Daiichi Sankyo Co Ltd	Gesundheitspflege	3,15
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Gesundheitspflege	2,91
Astellas Pharma Inc	Gesundheitspflege	2,04
Sumitomo Mitsui Financial Grou	Finanzwerte	2,00

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	05 Jun 2020	USD	08:00 - 16:30	HSJD LN	HSJD.L	HSJUSDIV	HSJDUSDINAV =SOLA	
LONDON STOCK EXCHANGE	05 Jun 2020	GBP	08:00 - 16:30	HSJP LN	HSJP.L	HSJPGIBV	HSJPGIBPINAV =SOLA	
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	29 Jun 2020	EUR	09:00 - 17:30	HSJD FP	HSJP.PA	HSJEURIV	HSJDEURINAV =SOLA	
BORSA ITALIANA SPA	06 Jul 2020	EUR	09:00 - 17:35	HSJD IM	HSJD. MI	HSJEURIV	HSJDEURINAV =SOLA	
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	15 Jul 2020	EUR	09:00 - 17:30	XU8Z GY	XU8Z.DE	HSJEURIV	HSJDEURINAV =SOLA	
SIX SWISS EXCHANGE	02 Sep 2020	USD	09:00 - 17:30	HSJD SW	HSJD.S	HSJUSDIV	HSJDUSDINAV =SOLA	
BOLSA INSTITUCIONAL DE VALORES	22 Sep 2020	MXN	--	HSJDN MM	HSJD.BIV	--	--	

Emissionen aus Reserven (mn Tonnen/USDmn)	Fonds	Breiter Marktindex
Emissionen aus Reserven/Marktkapitalisierung	112,47416	188,71109

Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Breiter Marktindex	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
MITSUBISHI HC CAPITAL INC	1,04	MITSUBISHI HC CAPITAL INC	1,04
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1,22	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1,22
DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	1,61	SEVEN BANK LTD	1,48
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	1,81	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	1,61
JAPAN POST INSURANCE CO LTD	1,88	MERCARI INC	1,77
SHIZUOKA FINANCIAL GROUP INC	1,94	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	1,81
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	2,19	JAPAN POST INSURANCE CO LTD	1,88
ADVANCE RESIDENCE INVESTMENT	2,23	SHIZUOKA FINANCIAL GROUP INC	1,94
T&D HOLDINGS INC	2,30	HIKARI TSUSHIN INC	2,01
MONEY FORWARD INC	2,76	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	2,19

Top 10 Emittenten mit der höchsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Breiter Marktindex	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
TAIHEIYO CEMENT CORP	3.603,20	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT C	5.979,80
UBE CORP	2.129,29	TAIHEIYO CEMENT CORP	3.603,20
JFE HOLDINGS INC	1.776,89	UBE CORP	2.129,29
NIPPON STEEL CORP	1.268,12	JFE HOLDINGS INC	1.776,89
TOKAI CARBON CO LTD	1.068,07	YAMATO KOGYO CO LTD	1.699,14
JAPAN AIRLINES CO LTD	1.055,72	TOHOKU ELECTRIC POWER CO INC	1.443,74
TOSOH CORP	1.015,21	CHUGOKU ELECTRIC POWER CO	1.410,68
KAWASAKI KISEN KAISHA LTD	983,56	SHIKOKU ELECTRIC POWER CO	1.307,81
KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	980,36	NIPPON STEEL CORP	1.268,12
KOBE STEEL LTD	954,26	KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	1.107,81

Die CO₂-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offengelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offengelegt oder die Betriebsdaten sind unvollständig. Trucost* führt Analysen und Recherchen durch, um die vom Unternehmen gemeldeten Ergebnisse zu bewerten. Das proprietäre Trucost-Modell ermöglicht eine Schätzung der Gesamtemissionen, die sich auf mehr als nur gemeldete Finanzdaten stützt. Wenn Wertpapiere nicht durch Trucost abgedeckt sind, weist HSBC stellvertretend einen Wert auf Basis des durchschnittlichen Intensitätswerts vergleichbarer Unternehmen zu. *Trucost ist ein Geschäftsbereich von S&P Global, der Risiken im Zusammenhang mit dem Klimawandel, der Beschränkung der natürlichen Ressourcen und breiteren Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren bewertet.

Quelle: Trucost

Breiter Marktindex: FTSE Japan

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 August 2023

MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Fonds	7,8	6,6	5,6	5,8
Breiter Marktindex	7,1	6,2	5,4	5,6

ESG-Score der zehn größten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
TOYOTA MOTOR CORP	9.922%	4.3	4.7	4.0	4.0	23.5
SONY GROUP CORP	4.449%	4.3	4.3	4.0	4.5	14.1
ITOCHU CORP	3.439%	4.7	5.0	4.8	4.3	23.8
KDDI CORP	3.426%	4.1	3.5	4.5	4.3	34.5
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	3.257%	3.9	3.0	4.7	3.9	9.1
SOFTBANK CORP	3.178%	4.6	4.1	4.8	5.0	17.5
DAIICHI SANKYO CO LTD	3.154%	4.3	4.0	4.7	4.3	21.8
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	2.906%	4.3	4.0	4.5	4.4	18.9
ASTELLAS PHARMA INC	2.037%	3.6	3.6	3.2	4.0	15.1
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	1.998%	4.4	4.0	4.7	4.4	7.2

Breiter Marktindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
TOYOTA MOTOR CORP	5.076%	4.3	4.7	4.0	4.0	23.5
SONY GROUP CORP	2.531%	4.3	4.3	4.0	4.5	14.1
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	2.281%	3.9	3.0	4.7	3.9	9.1
KEYENCE CORP	1.992%	2.5	2.3	2.6	2.7	23.5
TOKYO ELECTRON LTD	1.620%	3.8	3.4	4.0	4.0	9.8
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	1.517%	3.7	3.8	3.5	3.7	414.3
HITACHI LTD	1.469%	3.8	4.0	3.5	4.0	43.8
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	1.437%	4.4	4.0	4.7	4.4	7.2
MITSUBISHI CORP	1.408%	4.2	3.9	4.6	3.9	77.1
DAIICHI SANKYO CO LTD	1.365%	4.3	4.0	4.7	4.3	21.8

Die CO2-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offengelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offengelegt oder die Betriebsdaten sind unvollständig. Trucost* führt Analysen und Recherchen durch, um die vom Unternehmen gemeldeten Ergebnisse zu bewerten. Das proprietäre Trucost-Modell ermöglicht eine Schätzung der Gesamtemissionen, die sich auf mehr als nur gemeldete Finanzdaten stützt. Wenn Wertpapiere nicht durch Trucost abgedeckt sind, weist HSBC stellvertretend einen Wert auf Basis des durchschnittlichen Intensitätswerts vergleichbarer Unternehmen zu. *Trucost ist ein Geschäftsbereich von S&P Global, der Risiken im Zusammenhang mit dem Klimawandel, der Beschränkung der natürlichen Ressourcen und breiteren Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren bewertet.

Quelle: Trucost

Breiter Marktindex: FTSE Japan

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 August 2023

ESG-Score der zehn kleinsten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
NIPPON BUILDING FUND INC	0.002%	3.1	2.9	3.4	3.0	185.7
NIPPON PROLOGIS REIT INC	0.003%	2.4	2.4	3.0	2.0	170.7
JMDC INC	0.003%	1.5	1.6	0.4	3.0	13.1
FRONTIER REAL ESTATE INVEST	0.003%	2.6	2.9	2.4	2.5	70.7
CYBERAGENT INC	0.004%	2.2	2.0	2.0	2.5	14.4
TREND MICRO INC	0.004%	2.4	2.0	3.0	2.3	9.7
H.U. GROUP HOLDINGS INC	0.004%	3.3	2.4	3.4	4.5	20.9
DAIWA HOUSE REIT INVESTMENT	0.004%	3.2	2.4	3.4	4.0	181.4
FUJITSU GENERAL LTD	0.004%	2.9	3.5	2.8	2.0	25.5
JAPAN STEEL WORKS LTD	0.005%	2.8	3.0	2.3	3.3	72.4

Breiter Marktindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
ORIENT CORP	0.011%	1.9	2.0	1.2	2.3	8.8
RENOVA INC	0.011%	1.1	0.4	0.6	2.5	325.6
TAKARA BIO INC	0.011%	1.9	1.2	2.3	2.5	24.3
TOEI ANIMATION CO LTD	0.011%	0.0	0.0	0.0	0.0	24.8
FUJI MEDIA HOLDINGS INC	0.011%	1.3	1.2	1.0	1.9	16.0
AMVIS HOLDINGS INC	0.011%	0.0	0.0	0.0	0.0	26.9
JCR PHARMACEUTICALS CO LTD	0.012%	2.0	1.0	2.0	3.0	31.2
BENEFIT ONE INC	0.013%	0.9	0.0	0.4	2.5	16.1
GUNGHO ONLINE ENTERTAINMENT	0.013%	0.6	0.0	0.0	2.0	8.0
ASKUL CORP	0.013%	3.0	2.8	2.3	4.0	7.7

Die CO2-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offengelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offengelegt oder die Betriebsdaten sind unvollständig. Trucost* führt Analysen und Recherchen durch, um die vom Unternehmen gemeldeten Ergebnisse zu bewerten. Das proprietäre Trucost-Modell ermöglicht eine Schätzung der Gesamtemissionen, die sich auf mehr als nur gemeldete Finanzdaten stützt. Wenn Wertpapiere nicht durch Trucost abgedeckt sind, weist HSBC stellvertretend einen Wert auf Basis des durchschnittlichen Intensitätswerts vergleichbarer Unternehmen zu. *Trucost ist ein Geschäftsbereich von S&P Global, der Risiken im Zusammenhang mit dem Klimawandel, der Beschränkung der natürlichen Ressourcen und breiteren Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren bewertet.

Quelle: Trucost

Breiter Marktindex: FTSE Japan

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 August 2023

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.

Index-Haftungsausschluss

FTSE International Limited („FTSE“) © FTSE 2023. „FTSE®“ ist eine Marke der Unternehmen der London Stock Exchange Group und wird von der FTSE International Limited in Lizenz verwendet. Alle Rechte an den FTSE-Indizes und / oder FTSE-Ratings stehen FTSE und/oder seinen Lizenzgebern zu. Weder FTSE noch seine Lizenzgeber übernehmen jegliche Haftung für etwaige Fehler oder Auslassungen in den FTSE-Indizes und/oder FTSE-Ratings oder den zugrunde liegenden Daten. Ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung durch FTSE dürfen keinerlei FTSE-Daten weitergegeben werden.

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.

Das vorliegende Marketingdokument wird von HSBC Asset Management produziert und vertrieben. Es dient dem Vertrieb des in ihm vorgestellten Investmentfonds und stellt kein Angebot, keine Anlageberatung oder -empfehlung und keine unabhängige Finanzanalyse dar. Es handelt sich um ein nicht-vertragliches Dokument, welches nicht zur weiteren Verteilung bestimmt ist. Es kann eine Anlageberatung durch Ihre Bank nicht ersetzen. Es darf weder ganz noch teilweise an Dritte weitergegeben oder ohne schriftliche Einwilligungserklärung verwendet werden. Frühere Wertentwicklungen, Simulationen oder Prognosen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Derivate können zu einer wesentlich höheren Schwankung des Anteilpreises führen als der unmittelbare Erwerb der Basiswerte.

Aufgrund seiner Zusammensetzung kann der Fonds eine erhöhte Volatilität aufweisen, d. h. die Anteilepreise können erheblichen Schwankungen unterworfen sein. Der Fonds investiert auch in Instrumente, die in anderen Währungen denominated sind. Hieraus folgt ein Wechselkursrisiko. Ist die Heimatwährung des Anlegers nicht USD, resultiert für ihn hieraus ein zusätzliches Wechselkursrisiko. 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 und der Redakteure und Gesprächspartner der HSBC Asset Management 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.


Anlageentscheide dürfen ausschliesslich auf der Grundlage des Verkaufsprospektes, der KIIDs, der (Halb-)Jahresberichte und Satzung erteilt werden. (Potentielle) Anleger werden gebeten, die generellen bzw. spezifischen Risikowarnungen in Verkaufsprospekt und KIID zu konsultieren.

Ausgabe- und Rücknahmespesen werden in den Performance-daten nicht mitberücksichtigt. Kopien der Satzung, des Prospekts, der Wesentlichen Informationen für den Anleger (KIIDs) sowie der Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos vom Vertreter in der Schweiz bezogen werden: HSBC Asset Management (Switzerland) AG, Gartenstrasse 26, Postfach, CH-8002 Zürich, Schweiz. Zahlstelle in der Schweiz: HSBC Private Bank (Suisse) S.A., Quai des Bergues 9-17, Postfach 2888, CH-1211 Genf 1.

Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 August 2023

Folgen Sie uns auf:

 HSBC Asset Management

Fondscenter



Glossar

