

**HSBC ETFs PLC**

# HSBC MSCI USA CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF

Monatlicher Bericht 31 Mai 2022 | HPAU LN



## Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des MSCI USA Climate Paris Aligned 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.



## Anlagestrategie

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 Pariser Abkommens. Er integriert die Task Force für Empfehlungen zu klimabezogenen finanziellen Angaben und soll die Mindeststandards der EU-Benchmark in Bezug auf das Pariser Abkommen übertreffen. Der Fonds wird passiv verwaltet und ist bestrebt, im selben Verhältnis in die Aktien der Unternehmen zu investieren, wie diese im Index vertreten sind. Es können Umstände bestehen, in denen es für den Fonds nicht möglich ist, in alle Bestandteile des Index zu investieren. Wenn der Fonds nicht in der Lage ist, direkt in die Unternehmen zu investieren, die den Index bilden, kann er ein Engagement mittels anderer Anlagen wie Depotscheine, Fonds oder Derivate erzielen. Der Fonds kann bis zu 35 % unter außergewöhnlichen Marktbedingungen in Wertpapiere eines einzelnen Emittenten, bis zu 10 % in Total Return Swaps und Differenzkontrakte sowie bis zu 10 % in andere Fonds investieren. Eine vollständige Beschreibung der Anlageziele und der Nutzung 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“).

## Anteilkasse and Tracking Error Details

Wesentliche Kennzahlen	
NAV je Anteil	USD 28,49
Fondsfakten	
UCITS V-konform	Ja
Behandlung von Dividenden	Thesaurierend
Dividendenwährung	USD
Basiswährung der Anteilklasse	USD
Domizil	Irland
Auflegungsdatum	3 August 2021
Anzahl der Anteile im Umlauf	855.000
Fondsvermögen	USD 24.362.571
Benchmark	100% MSCI USA Climate Paris Aligned Index
Nachbildungsmethode	Physisch
SIPP-berechtigt	Ja
Emittent	HSBC ETFs PLC
Ende des Geschäftsjahres	Dez.
Gebühren und Kosten	
Laufende Kostenquote <sup>1</sup>	0,120%
Codes	
ISIN	IE00BP2C1S34
WKN	A3CRZY

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

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.

Dies ist eine Marketingkommunikation. Bitte lesen Sie den Prospekt und KIID, bevor Sie abschließende Anlageentscheidungen treffen. Die bisherige Wertentwicklung dieser Anteilklasse darf nicht abgebildet werden, da der erforderliche Mindestzeitraum von zwölf Monaten noch nicht vorhanden ist.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022

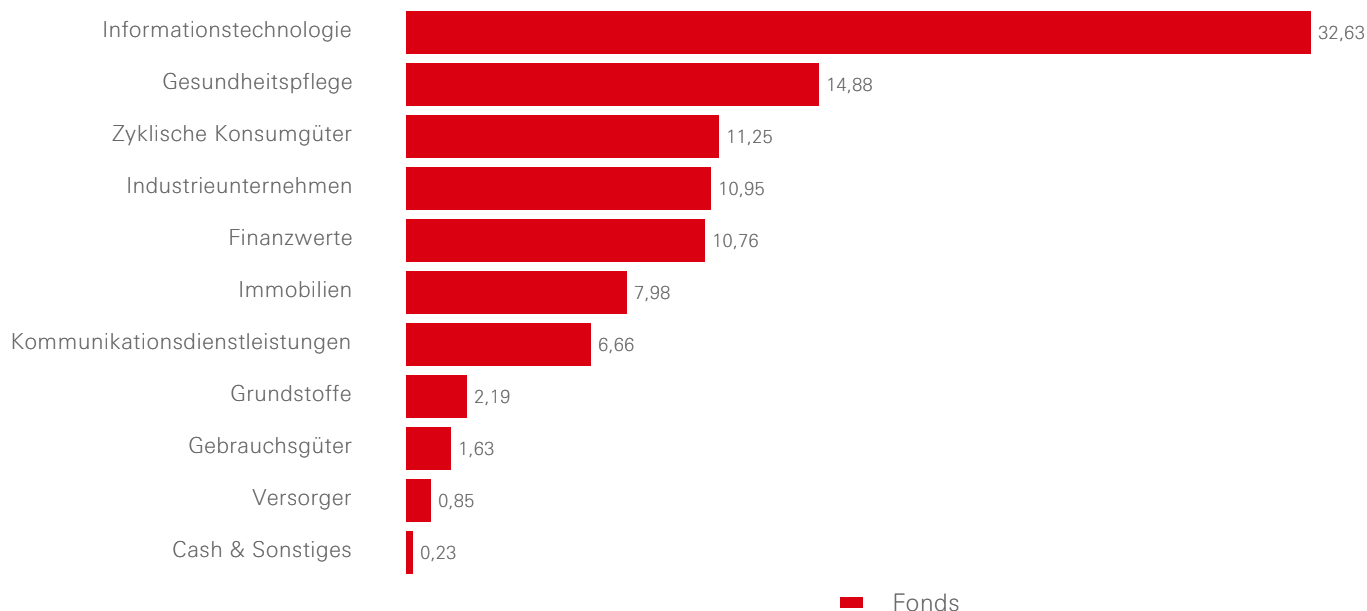
Wertentwicklung (%)	YTD	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre annualisiert	5 Jahre annualisiert	Seit Auflegung
Fonds	--	--	--	--	--	--	--	--
Benchmark	--	--	--	--	--	--	--	--
Nachbildungsunterschied	--	--	--	--	--	--	--	--

Rollierende Wertentwicklung (%)	31/05/21- 31/05/22	31/05/20- 31/05/21	31/05/19- 31/05/20	31/05/18- 31/05/19	31/05/17- 31/05/18
Fonds	--	--	--	--	--
Benchmark	--	--	--	--	--

Klimabilanz	Fonds	Benchmark	MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Kohlenstoffintensität	45,92	161,26	Fonds	6,5	6,8	5,1	5,0
Die Kohlenstoffintensität misst die Menge der Kohlenstoffemissionen eines Unternehmens (Tonnen CO <sub>2</sub> e/Mio. USD) Quelle: Trucost			Benchmark	6,3	6,7	5,1	4,9

Aktienmerkmale	Fonds	Benchmark	Benchmark
Anzahl der Positionen ohne Barmittel	296	311	Index-Name 100% MSCI USA Climate Paris Aligned Index
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (USD Mio.)	485.975	486.004	Index-Währung USD
Kurs-Gewinn-Verhältnis	21,35	21,34	Benchmark-Typ Gesamtrendite, netto
			TR-Index Bloomberg-Ticker MXUSCLPA
			TR-Index Reuters RIC .MIUS0CPA0NUS

#### 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.  
 Die bisherige Wertentwicklung dieser Anteilsklasse darf nicht abgebildet werden, da der erforderliche Mindestzeitraum von zwölf Monaten noch nicht vorhanden ist.  
 Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022

Top 10 Positionen	Sektor	Gewichtung (%)
Apple Inc	Informationstechnologie	7,61
Microsoft Corp	Informationstechnologie	6,17
Amazon,com Inc	Zyklische Konsumgüter	3,04
Tesla Inc	Zyklische Konsumgüter	2,70
Alphabet Inc	Kommunikationsdienstleistungen	2,46
Honeywell International Inc	Industrieunternehmen	2,25
NVIDIA Corp	Informationstechnologie	1,57
Cummins Inc	Industrieunternehmen	1,55
Meta Platforms Inc	Kommunikationsdienstleistungen	1,39
Digital Realty Trust Inc	Immobilien	1,38

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	04 Aug 2021	USD	08:00 - 16:30	HPAU LN	HPAU.L	HPAUUSIV	HPAUUSiv.P
BORSA ITALIANA SPA	11 Aug 2021	EUR	09:00 - 17:35	HPAU IM	HPAU.MI	HPAUEUIV	HPAUEUiv.P
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	10 Aug 2021	EUR	09:00 - 17:30	HPAU FP	HPAU.PA	HPAUEUIV	HPAUEUiv.P
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	10 Aug 2021	EUR	09:00 - 17:30	HPAU GY	HPAU.DE	HPAUEUIV	HPAUEUiv.P
SIX SWISS EXCHANGE	27 Aug 2021	USD	09:00 - 17:30	HPAU SW	HPAU.S	HPAUUSIV	HPAUUSiv.P

Emissionen aus Reserven (mn tonnes/ USDmn)	Fonds	Benchmark
Emissionen aus Reserven/ Marktkapitalisierung	0,00000	0,00049

### Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensi- tät(Tonnen CO <sup>2</sup> / Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoffintensi- tät(Tonnen CO <sup>2</sup> / Mio. USD Umsatz)
AFLAC INC	0,56	LINCOLN NATIONAL CORP	0,47
UNITEDHEALTH GROUP INC	0,68	AFLAC INC	0,56
ETSY INC	0,70	AMERISOURCEBERGEN CORP	0,58
ANTHEM INC	0,82	UNITEDHEALTH GROUP INC	0,68
HUMANA INC	0,94	ETSY INC	0,70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,14	CIGNA CORP	0,81
TRAVELERS COS INC/THE	1,20	ANTHEM INC	0,82
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,21	HUMANA INC	0,94
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,23	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,00
METLIFE INC	1,26	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,14

### Las diez empresas principales con mayor intensidad de carbono

Fonds	Kohlenstoffintensi- tät(Tonnen CO <sup>2</sup> / Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoffintensi- tät(Tonnen CO <sup>2</sup> / Mio. USD Umsatz)
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1.167,95	VISTRA CORP	8.269,14
DIGITAL REALTY TRUST INC	767,86	CLEVELAND-CLIFFS INC	6.052,39
EDISON INTERNATIONAL	588,05	EVERGY INC	4.875,18
AVANTOR INC	479,70	AMEREN CORPORATION	4.697,71
UNION PACIFIC CORP	475,13	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4.536,22
EQUINIX INC	391,62	AES CORP	4.473,66
ALBEMARLE CORP	298,97	ALLIANT ENERGY CORP	3.696,86
CORNING INC	227,85	SOUTHERN CO/THE	3.696,52
VULCAN MATERIALS CO	198,74	XCEL ENERGY INC	3.409,57
3M CO	163,17	PPL CORP	3.375,80

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

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022

## ESG-Score der zehn größten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
APPLE INC	7.606%	6.1	4.1	5.6	3.1	3.4
MICROSOFT CORP	6.167%	9.8	8.1	6.9	5.5	29.5
AMAZON.COM INC	3.039%	5.6	5.5	4.8	5.1	43.8
TESLA INC	2.695%	6.9	9.0	1.9	4.5	24.2
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2.250%	7.2	4.1	3.1	5.8	68.9
ALPHABET INC-CL C	1.601%	5.1	7.1	5.4	1.3	32.4
NVIDIA CORP	1.569%	9.1	5.4	7.0	5.6	7.1
CUMMINS INC	1.550%	7.7	6.3	7.2	5.0	35.3
META PLATFORMS INC-CLASS A	1.386%	2.2	10.0	2.5	2.7	32.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.376%	6.4	6.2	5.2	4.4	767.9

Benchmark	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
APPLE INC	6.591%	6.1	4.1	5.6	3.1	3.4
MICROSOFT CORP	5.254%	9.8	8.1	6.9	5.5	29.5
AMAZON.COM INC	2.988%	5.6	5.5	4.8	5.1	43.8
ALPHABET INC-CL A	1.857%	5.1	7.1	5.4	1.3	32.4
TESLA INC	1.808%	6.9	9.0	1.9	4.5	24.2
ALPHABET INC-CL C	1.758%	5.1	7.1	5.4	1.3	32.4
JOHNSON & JOHNSON	1.281%	5.1	6.3	5.4	2.9	12.2
UNITEDHEALTH GROUP INC	1.268%	5.6	10.0	5.0	4.6	0.7
NVIDIA CORP	1.267%	9.1	5.4	7.0	5.6	7.1
META PLATFORMS INC-CLASS A	1.213%	2.2	10.0	2.5	2.7	32.3

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

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022

## ESG-Score der zehn kleinsten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.009%	8.1	5.6	7.5	5.2	38.4
LYFT INC-A	0.009%	4.1	5.0	3.4	3.9	3.3
TRANSUNION	0.010%	5.6	9.0	5.4	6.4	13.7
HUBSPOT INC	0.011%	8.1	4.7	6.6	5.4	9.5
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.011%	3.2	4.4	2.3	6.0	43.6
BAXTER INTERNATIONAL INC	0.011%	6.6	10.0	5.7	5.3	61.8
WAYFAIR INC- CLASS A	0.011%	2.9	0.7	5.0	4.3	48.9
ZILLOW GROUP INC - C	0.012%	3.7	3.3	7.0	3.3	44.0
RINGCENTRAL INC-CLASS A	0.012%	7.1	5.9	6.7	4.8	9.5
EPAM SYSTEMS INC	0.013%	4.8	4.8	3.2	5.5	16.1

Benchmark	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
CHEWY INC - CLASS A	0.006%	2.7	0.7	3.6	3.8	48.9
CARVANA CO	0.008%	2.4	2.1	2.9	4.5	50.7
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	0.008%	1.7	6.7	5.8	0.9	7.7
UPSTART HOLDINGS INC	0.009%	2.7	6.7	2.7	5.5	8.4
LIBERTY GLOBAL PLC-A	0.010%	3.9	10.0	6.8	1.8	20.5
PELTON INTERACTIVE INC-A	0.011%	0.0	1.0	1.4	3.6	35.8
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	0.012%	3.9	1.9	4.3	4.7	2.4
WAYFAIR INC- CLASS A	0.012%	2.9	0.7	5.0	4.3	48.9
APPLOVIN CORP-CLASS A^	0.012%	0.0	0.0	0.0	0.0	9.5
CLARIVATE PLC	0.012%	4.6	8.3	4.4	5.7	2.7

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

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022

## 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 wesentlichen Anlegerinformationen und/oder im Prospekt bzw. Emissionsprospekt.

## 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)

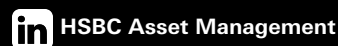
## Wichtige Informationen

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 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 Raiffeisen Bank International AG, Am Stadtpark 9, 1030 Wien sowie unter [www.assetmanagement.hsbc.at](http://www.assetmanagement.hsbc.at). Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

**Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Mai 2022**

Folgen Sie uns auf:



Telefon: +43 (0) 1 230 60 6090 E-Mail:  
[office.wien@hsbc.at](mailto:office.wien@hsbc.at)  
[www.assetmanagement.hsbc.com/at](http://www.assetmanagement.hsbc.com/at)  
Für weitere Informationen kontaktieren  
Sie uns bitte Webseite:  
[www.assetmanagement.hsbc.com/at](http://www.assetmanagement.hsbc.com/at)

### Glossar

