

HSBC ETFs PLC

HSBC MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF

Monatlicher Bericht 31 Oktober 2022 | HPAW GY



Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des MSCI World 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. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen von Artikel 9 der Offenlegungsverordnung.



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 CO₂-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“).

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 19,66
Wertentwicklung 1 Monat	6,49%

Fondsfakten

UCITS V-konform	Ja
Behandlung von Dividenden	Thesaurierend
Dividendenwährung	USD
Basiswährung der Anteilklasse	USD
Domizil	Irland
Auflegungsdatum	7 Juli 2021
Anzahl der Anteile im Umlauf	8.060.000
Fondsvermögen	USD 158.423.346
Benchmark	100% MSCI World Climate Paris Aligned Index
Nachbildungsmethode	Physisch
SIPP-berechtigt	Ja
Emittent	HSBC ETFs PLC
Ende des Geschäftsjahres	Dez.
Gebühren und Kosten	
Laufende Kostenquote ¹	0,180%

Codes

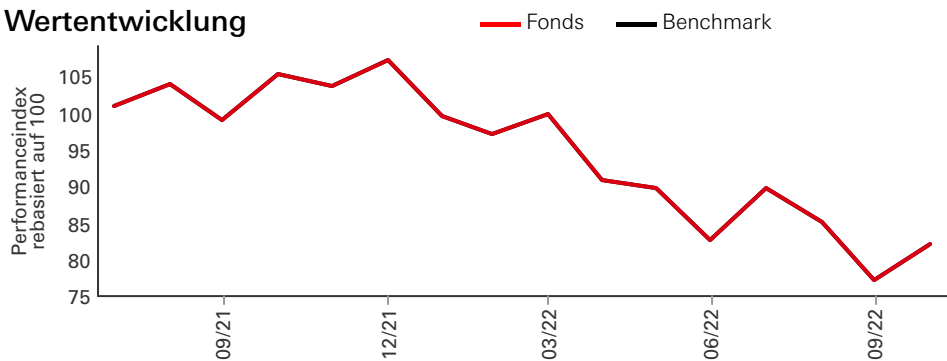
ISIN	IE00BP2C1V62
WKN	A3CRZX

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.

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. Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Oktober 2022

Wertentwicklung



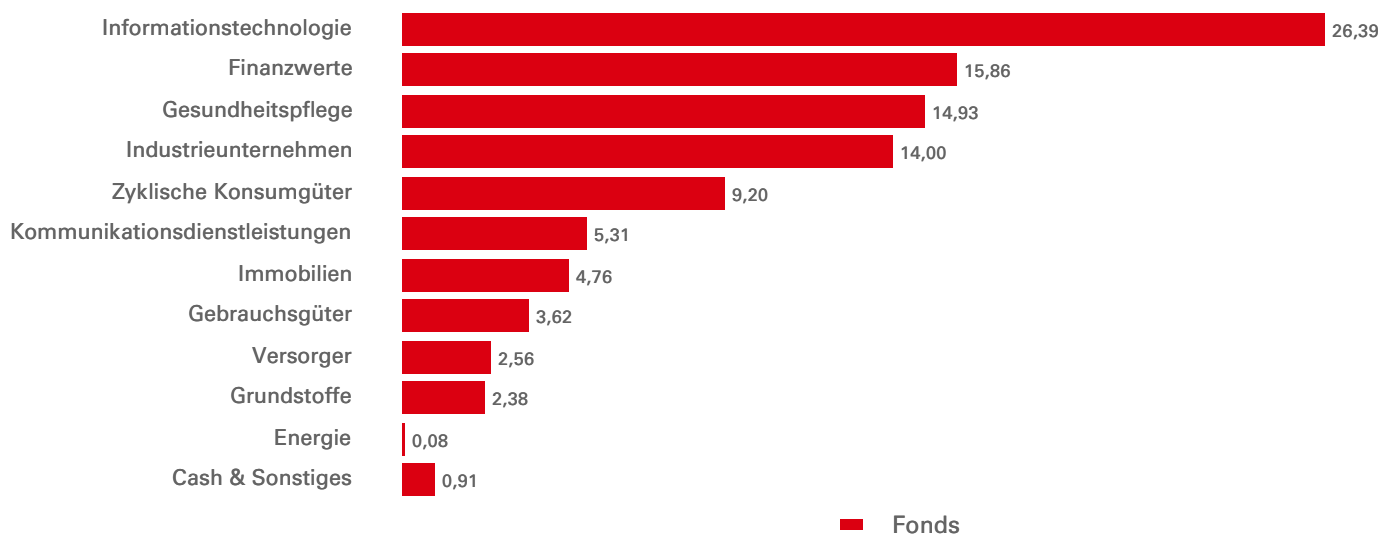
Wertentwicklung (%)	YTD	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre annualisiert	5 Jahre annualisiert	Seit Auflegung annualisiert
Fonds	-23,42	6,49	-8,54	-9,52	-22,02	--	--	-13,82
Benchmark	-23,39	6,51	-8,51	-9,51	-21,98	--	--	-13,80
Nachbildungs- unterschied	-0,03	-0,02	-0,03	-0,01	-0,03	--	--	-0,02

Rollierende Wertentwicklung (%)	31/10/21- 31/10/22	31/10/20- 31/10/21	31/10/19- 31/10/20	31/10/18- 31/10/19	31/10/17- 31/10/18
Fonds	-22,02	--	--	--	--
Benchmark	-21,98	--	--	--	--

Klimabilanz	Fonds	Benchmark	MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Kohlenstoff-intensität	38,47	162,77	Fonds	7,1	6,9	5,3	5,7
Die Kohlenstoffintensität misst die Menge der Kohlenstoffemissionen eines Unternehmens (Tonnen CO ₂ e/Mio. USD) Quelle: Trucost			Benchmark	6,9	6,7	5,2	5,7

Aktienmerkmale	Fonds	Benchmark	Benchmark
Anzahl der Positionen (ohne Kasse)	628	631	Index-Name
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (USD Mio.)	338.177	338.335	Index-Währung
Kurs-Gewinn-Verhältnis	17,13	17,13	Benchmark-Typ
			TR-Index Bloomberg-Ticker
			TR-Index Reuters RIC

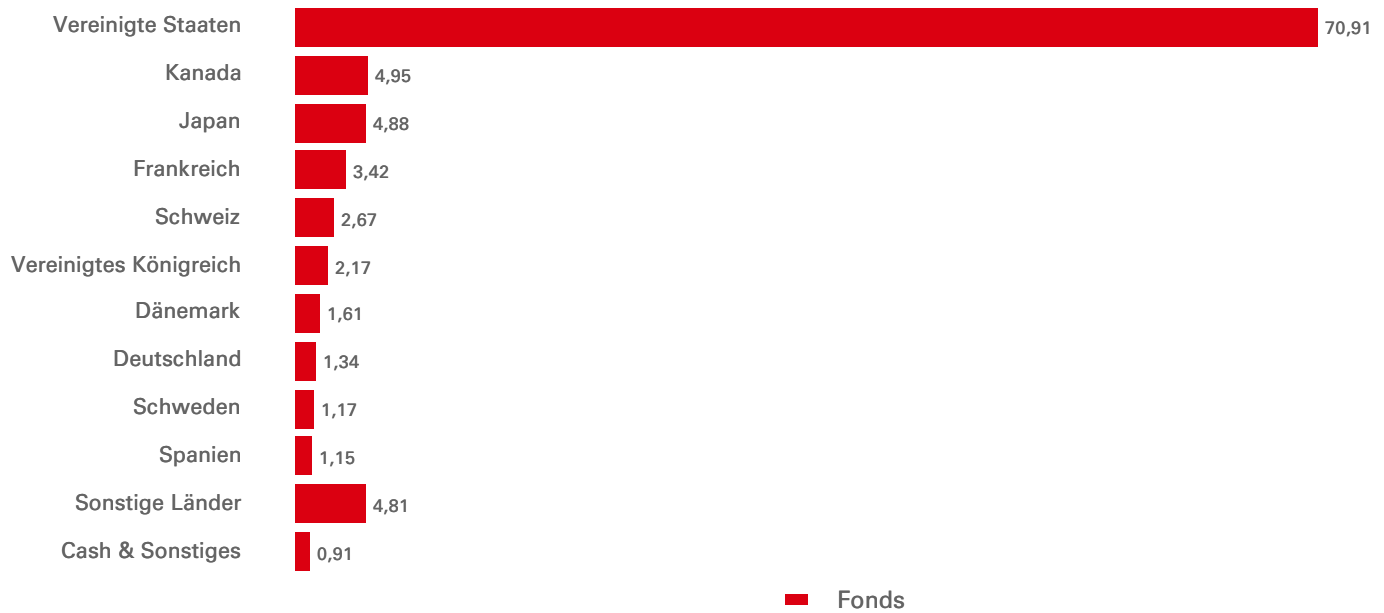
Sektorallokation (%)



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.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Oktober 2022

Geografische Allokation (%)



Top 10 Positionen	Sektor	Gewichtung (%)
Apple Inc	Informationstechnologie	5,82
Microsoft Corp	Informationstechnologie	3,73
Alphabet Inc	Kommunikationsdienstleistungen	2,34
Amazon.com Inc	Zyklische Konsumgüter	1,89
Tesla Inc	Zyklische Konsumgüter	1,47
UnitedHealth Group Inc	Gesundheitspflege	1,15
Schneider Electric SE	Industrieunternehmen	1,10
JPMorgan Chase & Co	Finanzwerte	1,04
Johnson & Johnson	Gesundheitspflege	1,01
Eli Lilly & Co	Gesundheitspflege	0,87

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 Jul 2021	USD	--	HPAW LN	HPAW.L	HPAWUSIV	HPAWUSiv.P
LONDON STOCK EXCHANGE	08 Jul 2021	GBP	--	HPAO LN	HPAO.L	HPAWGBIV	HPAWGBiv.P
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	10 Aug 2021	EUR	--	HPAW GY	HPAW.DE	HPAWEUIV	HPAWEUiv.P
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	10 Aug 2021	EUR	--	HPAW FP	HPAW.PA	HPAWEUIV	HPAWEUiv.P
BORSA ITALIANA SPA	11 Aug 2021	EUR	--	HPAW IM	HPAW.MI	HPAWEUIV	HPAWEUiv.P
SIX SWISS EXCHANGE	27 Aug 2021	USD	--	HPAW SW	HPAW.S	HPAWUSIV	HPAWUSiv.P

Emissionen aus Reserven (mn Tonnen/USDmn)	Fonds	Benchmark
Emissionen aus Reserven/ Marktkapitalisierung	0,00001	0,00148

Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	0,02	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	0,02
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	0,05	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	0,05
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0,29	ST JAMES'S PLACE PLC	0,21
SWISS RE AG	0,33	M&G PLC	0,25
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	0,33	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0,29
IGM FINANCIAL INC	0,34	SWISS RE AG	0,33
SAMPO OYJ-A SHS	0,45	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	0,33
LINCOLN NATIONAL CORP	0,47	IGM FINANCIAL INC	0,34
IA FINANCIAL CORP INC	0,49	SAMPO OYJ-A SHS	0,45
SHOPIFY INC - CLASS A	0,49	LINCOLN NATIONAL CORP	0,47

Top 10 Emittenten mit der höchsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoffintensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
NORTHLAND POWER INC	903,50	VISTRA CORP	8.269,14
DIGITAL REALTY TRUST INC	779,73	RWE AG	6.492,84
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	698,16	CLEVELAND-CLIFFS INC	6.052,39
ROCKWOOL A/S-B SHS	654,47	SOUTH32 LTD	4.914,45
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	591,15	EVERGY INC	4.875,18
AVANTOR INC	479,70	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4.722,82
UNION PACIFIC CORP	475,13	AMEREN CORPORATION	4.697,71
ANTOFAGASTA PLC	457,26	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4.536,22
ELIA GROUP SA/NV	412,78	AES CORP	4.473,66
IBERDROLA SA	394,24	CLP HOLDINGS LTD	4.419,45

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 Oktober 2022

ESG-Score der zehn größten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
APPLE INC	5.821%	6.1	4.1	5.6	3.6	3.4
MICROSOFT CORP	3.734%	9.8	8.3	6.8	5.5	29.5
AMAZON.COM INC	1.887%	5.6	5.5	4.8	5.3	34.4
ALPHABET INC-CL C	1.533%	4.9	7.5	4.8	2.1	32.8
TESLA INC	1.470%	6.9	9.0	2.1	4.2	10.9
UNITEDHEALTH GROUP INC	1.148%	8.3	10.0	6.9	5.2	0.7
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1.099%	10.0	8.5	5.3	6.6	18.4
JPMORGAN CHASE & CO	1.042%	7.1	9.4	4.7	4.5	7.2
JOHNSON & JOHNSON	1.008%	6.1	6.3	5.3	2.7	12.2
ELI LILLY & CO	0.874%	5.9	5.3	4.9	5.9	28.9

Benchmark	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
APPLE INC	5.069%	6.1	4.1	5.6	3.6	3.4
MICROSOFT CORP	3.369%	9.8	8.3	6.8	5.5	29.5
AMAZON.COM INC	1.916%	5.6	5.5	4.8	5.3	34.4
TESLA INC	1.228%	6.9	9.0	2.1	4.2	10.9
ALPHABET INC-CL A	1.161%	4.9	7.5	4.8	2.1	32.8
ALPHABET INC-CL C	1.091%	4.9	7.5	4.8	2.1	32.8
UNITEDHEALTH GROUP INC	1.064%	8.3	10.0	6.9	5.2	0.7
EXXON MOBIL CORP	0.953%	5.2	4.3	5.9	5.3	623.0
JOHNSON & JOHNSON	0.935%	6.1	6.3	5.3	2.7	12.2
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0.775%	3.8	5.8	2.5	3.2	262.9

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 Oktober 2022

ESG-Score der zehn kleinsten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	0.002%	5.1	8.0	4.0	5.1	41.1
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	0.005%	5.1	8.0	4.0	5.1	41.1
BAUSCH HEALTH COS INC	0.006%	5.4	4.0	4.9	6.2	36.9
BLOCK INC - CDI	0.006%	5.1	10.0	4.0	4.8	11.8
OCADO GROUP PLC	0.006%	6.9	2.2	5.0	7.2	36.2
DOCUSIGN INC	0.006%	7.3	4.8	5.9	5.7	9.7
TAYLOR WIMPEY PLC	0.007%	8.5	5.3	6.3	8.1	6.1
DOORDASH INC - A	0.007%	5.0	1.0	5.3	4.8	11.8
WAYFAIR INC- CLASS A	0.007%	4.3	0.7	4.9	4.7	50.7
IAC INC*^	0.008%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

Benchmark	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoff- intensität
UNIPER SE	0.001%	4.6	4.4	7.3	5.7	749.5
MISTAK 0 12/31/49 AMC	0.002%	5.1	8.0	4.0	5.1	41.1
SHARP CORP	0.003%	5.5	4.1	5.4	6.4	52.3
PROXIMUS	0.003%	5.6	10.0	5.4	4.6	15.6
KION GROUP AG	0.003%	7.9	5.6	5.7	5.8	20.0
SEB SA	0.003%	6.9	5.1	4.5	5.6	27.5
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS*^	0.003%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
BAUSCH HEALTH COS INC	0.004%	5.4	4.0	4.9	6.2	36.9
ROCKWOOL A/S-B SHS	0.004%	8.4	5.5	5.7	6.6	654.5
KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD	0.004%	3.7	7.0	2.9	5.3	12.6

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 Oktober 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 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 Trinkaus & Burkhardt GmbH, Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf sowie unter www.assetmanagement.hsbc.de.

Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Oktober 2022

Follow us on:

 **HSBC Asset Management**

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

