

HSBC ETFs PLC

HSBC EMERGING MARKET SUSTAINABLE EQUITY UCITS ETF

Monatlicher Bericht 31 Januar 2022 | H4Z1 GY


Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des FTSE Emerging 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.


Anlagestrategie

Der Index strebt eine Reduzierung der Kohlenstoffemissionen und des Engagements in fossile Brennstoffreserven und eine Verbesserung des ESG-Ratings des FTSE Russell Index an. Der Index erreicht dies, indem er Unternehmen auf der Grundlage von nachhaltigkeitsbezogenen Ausschlusskriterien streicht. Der Index wendet zudem 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. Es kann jedoch Situationen geben, in denen es dem Fonds nicht möglich ist, in alle Bestandteile des Index zu investieren. Der Fonds kann auch ein Engagement mittels anderer Anlagen wie Hinterlegungsscheinen, Derivaten oder Fonds aufbauen. 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 dem Einsatz 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.
- Der Fonds kann in Schwellenmärkten investieren. Diese Märkte sind weniger etabliert und oft volatiler als entwickelte Märkte und bergen daher höhere Risiken, insbesondere Markt-, Liquiditäts- und Währungsrisiken.

Fonds fakten

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 15,44
Wertentwicklung 1 Monat	-0,15%

Fonds fakten

UCITS V-konform	Ja
Behandlung von Dividenden	Thesaurierend
Dividendenwährung	USD
Basiswährung der Anteilklasse	USD
Domizil	Irland
Auflegungsdatum	27 August 2020
Anzahl der Anteile im Umlauf	11.250.000
Fondsvermögen	USD 173.698.844
Benchmark	100% FTSE Emerging ESG Low Carbon Select Index

Nachbildungsmethode	Physisch
SIPP-berechtigt	Ja

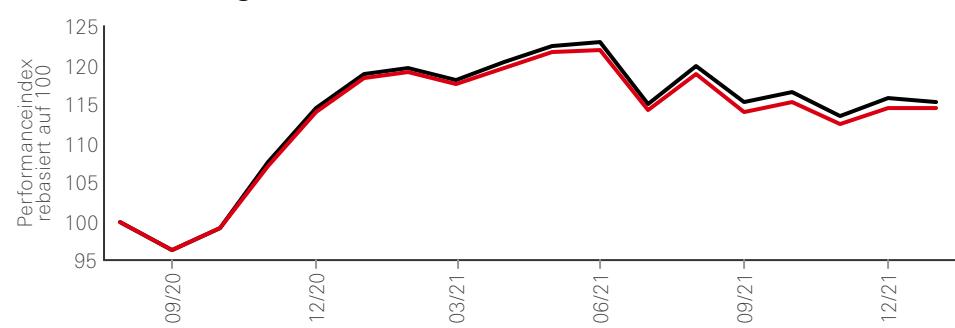
Emittent	HSBC ETFs PLC
Ende des Geschäftsjahres	Dez.

Gebühren und Kosten

Laufende Kostenquote ¹	0,180%
Codes	

ISIN	IE00BKY59G90
WKN	A2PXVK

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	-0,15	-0,15	-0,78	0,10	-3,21	--	--	9,98
Benchmark	-0,30	-0,30	-0,95	0,16	-2,90	--	--	10,58
Nachbildungs-unterschied	0,15	0,15	0,17	-0,06	-0,32	--	--	-0,60
Tracking error	--	--	--	--	0,77	--	--	0,71

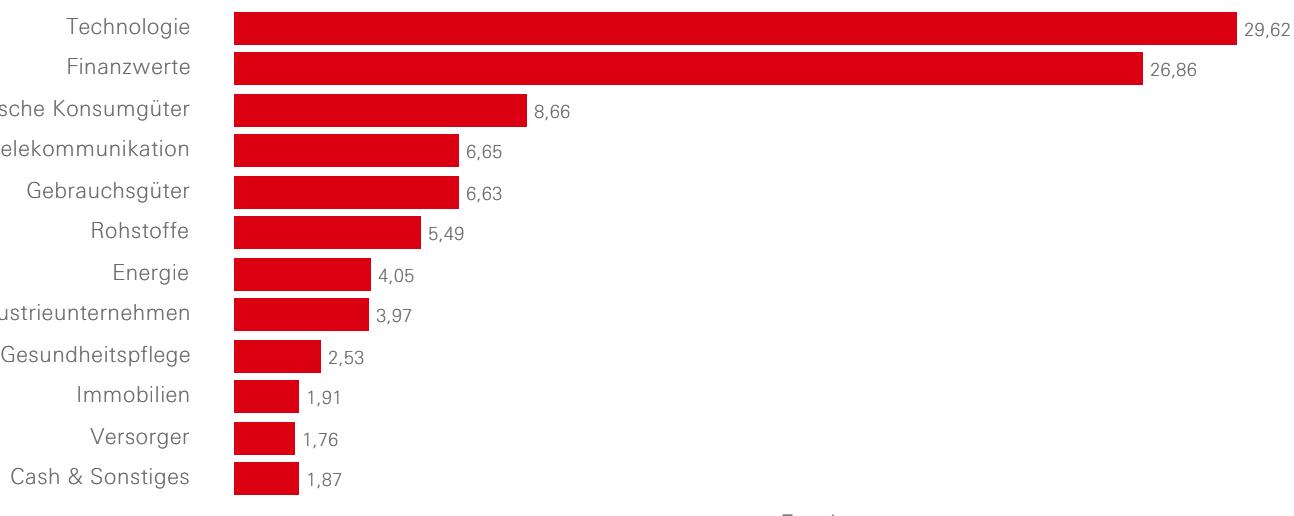
Rollierende Wertentwicklung (%)	31/01/2021-31/01/2022	31/01/2020-31/01/2021	31/01/2019-31/01/2020	31/01/2018-31/01/2019	31/01/2017-31/01/2018
Fonds	-3,21	--	--	--	--
Benchmark	-2,90	--	--	--	--

Klimabilanz	Fonds	Parent-Referenzindex	FTSE ESG Score	ESG-Score	E	S	G
			Fonds	3,2	2,3	3,2	4,0
Kohlenstoffintensität	208,89	438,06	Parent-Referenzindex	2,8	2,0	2,7	3,7

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

Quelle: Trucost

Aktienmerkmale	Fonds	Benchmark	Benchmark
Anzahl der Positionen (ohne Kasse)	1.044	1.055	Index-Name
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (USD Mio.)	133.639	132.827	100% FTSE Emerging ESG Low Carbon Select Index
Kurs-Gewinn-Verhältnis	16,69	16,76	Index-Währung
			USD
			Benchmark-Typ
			Gesamtrendite, netto
			Häufigkeit der Index-Neugewichtung
			Jährlich
			TR-Index Bloomberg-Ticker
			ELCAWEN
			TR-Index Reuters RIC
			.TFTELCAWENU

Sektorallokation (%)

■ Fonds

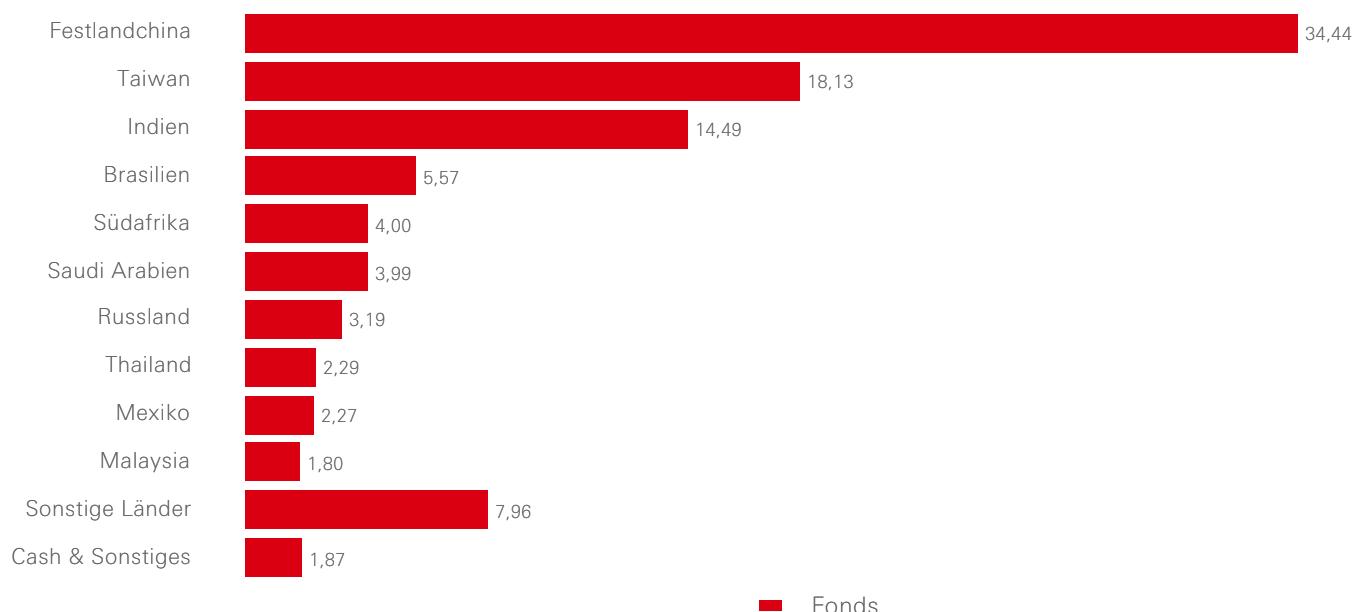
Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Die dargestellte Wertentwicklung basiert auf Netto-Inventarwerten. Ein Ausgabeaufschlag und Ihr Depotpreis (soweit diese anfallen) sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und wirken sich 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.

Bei der Überprüfung der früheren Wertentwicklung dieses Fonds müssen Sie auch das 10-Jahres-Wertentwicklungsdiagramm einsehen, das in den wesentlichen Anlegerinformationen für diesen Fonds auf unserer Website zu finden ist.

Parent-Referenzindex: FTSE Emerging

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Januar 2022

Geografische Allokation (%)



Top 10 Positionen

	Geografische Region	Sektor	Gewichtung (%)
Taiwan Semiconductor Co Ltd	Taiwan	Technologie	10,77
Tencent Holdings Ltd	Festlandchina	Technologie	5,86
Infosys Ltd	Indien	Technologie	3,11
Ping An Insurance Group Co-H	Festlandchina	Finanzwerte	2,67
Itau Unibanco Holding SA	Brasilien	Finanzwerte	2,17
SUNNY OPTICAL	Festlandchina	Technologie	2,02
Meituan-Class B	Festlandchina	Technologie	1,43
Housing Development Finance Co	Indien	Finanzwerte	1,30
First Abu Dhabi Bank PJSC	Vereinigte Arabische Emirate	Finanzwerte	0,98
Li Ning Co Ltd	Festlandchina	Zyklische Konsumgüter	0,95

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	28 Aug 2020	USD	08:00 - 16:30	HSEM LN	HSEM.L	HSEMUSIV	HSEMUSIV.P
LONDON STOCK EXCHANGE	28 Aug 2020	GBP	08:00 - 16:30	HSEF LN	HSEF.L	HSEMGBIV	HSEMGBIV.P
SIX SWISS EXCHANGE	09 Sep 2020	USD	09:00 - 17:30	HSEM SW	HSEM.S	HSEMUSIV	HSEMUSIV.P
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	22 Sep 2020	EUR	09:00 - 17:30	HSEM FP	HSEM.PA	HSEMEUIV	HSEMEUiv.P
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	22 Sep 2020	EUR	09:00 - 17:30	H4Z1 GY	H4Z1.DE	HSEMEUIV	HSEMEUiv.P
BORSA ITALIANA SPA	09 Okt 2020	EUR	09:00 - 17:35	HSEM IM	HSEM.MI	HSEMEUIV	HSEMEUiv.P
BOLSA INSTITUCIONAL DE VALORES	30 Nov 2020	MXN	08.25 - 15:00	HSEMN MM	HSEM.BIV	--	--

Emissionen aus Reserven (mn tonnes/ USDmn)	Parent- Fonds	Referenzindex
Emissionen aus Reserven/ Marktkapitalisierung	0,00620	0,01089

Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoffintensi -tät(Tonnen CO ² / Mio. USD Umsatz)	Parent-Referenzindex	Kohlenstoffintensi -tät(Tonnen CO ² / Mio. USD Umsatz)
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	0,10	People's Insurance Company (Group) of China (H)	0,10
BANCO INTER SA-PR	0,63	Odontoprev S/A Ord	0,42
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	0,98	Banco Inter	0,63
PORTO SEGURO SA	0,99	China MeiDong Auto Holdings (P Chip)	0,98
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,08	Porto Seguro	0,99
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,25	China Taiping Insurance Holdings (Red Chip)	1,08
CHINA LITERATURE LTD	1,28	B3 SA	1,25
CHINA EVERBRIGHT LTD	1,61	China Literature (P Chip)	1,28
BANK OF NANJING CO LTD -A	1,73	China Everbright (RED CHIP)	1,61
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	1,76	TIANFENG SECURITIES (A) (SC SH)	1,64

Las diez empresas principales con mayor intensidad de carbono

Fonds	Kohlenstoffintensi -tät(Tonnen CO ² / Mio. USD Umsatz)	Parent-Referenzindex	Kohlenstoffintensi -tät(Tonnen CO ² / Mio. USD Umsatz)
CHINA RESOURCES CEMENT	11.813,17	Unipro	19.858,07
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	11.042,54	Jointo Energy Investment Hebei (A) (SC SZ)	19.151,20
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	10.756,09	Shanxi Zhangze Electric Power (A) (SC SZ)	18.714,85
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10.193,12	GD Power Development (A) (SC SH)	18.220,16
SAUDI ELECTRICITY CO	9.936,55	Jiangsu Guoxin (A) (SC SZ)	17.608,65
DALMIA BHARAT LTD	8.664,44	Datang International Power Generation (A) (SC SH)	17.015,73
SHREE CEMENT LTD	8.432,68	NTPC	16.616,60
ULTRATECH CEMENT LTD	8.350,12	China Resources Power Holdings (RED CHIP)	16.048,59
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	8.053,28	Adani Power	15.796,85
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7.943,80	Guangdong Electric Power Development (A) (SC SZ)	15.739,90

Die CO2-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offen gelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offen gelegt 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

Parent-Referenzindex: FTSE Emerging

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Januar 2022

MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Fonds	5,9	5,7	5,4	4,1
Parent-Referenzindex	5,3	5,4	5,1	3,9

ESG-Score der zehn größten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	10.769%	4.4	3.8	4.5	5.0	226.5
TENCENT HOLDINGS LTD	5.860%	2.3	1.0	2.4	3.5	13.3
INFOSYS LTD	3.115%	3.9	3.0	3.7	5.0	22.5
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2.666%	3.3	3.0	3.7	3.3	2.7
SUNNY OPTICAL TECH	2.022%	3.7	3.1	3.3	5.0	59.8
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	2.009%	3.9	3.0	4.4	4.3	3.2
MEITUAN-CLASS B	1.426%	2.2	1.0	2.0	3.5	40.6
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1.302%	3.4	2.0	2.6	4.6	6.6
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	0.983%	3.0	1.0	3.7	4.1	6.6
LI NING CO LTD	0.952%	2.8	2.4	2.8	3.5	4.5

Parent-Referenzindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
Taiwan Semiconductor Manufacturing	7.823%	4.4	3.8	4.5	5.0	226.5
Tencent Holdings (P Chip)	5.166%	2.3	1.0	2.4	3.5	13.3
Alibaba Group Holding (P Chip)	2.963%	1.4	0.6	0.8	3.0	43.6
Meituan Dianping (P Chip)	1.560%	2.2	1.0	2.0	3.5	40.6
Reliance Industries	1.493%	2.9	2.1	2.4	4.3	367.0
Infosys	1.177%	3.9	3.0	3.7	5.0	22.5
China Construction Bank (H)	1.017%	1.8	1.0	1.2	2.6	4.3
Vale SA	0.892%	2.6	1.6	3.3	2.9	266.2
Housing Development Finance	0.840%	3.4	2.0	2.6	4.6	6.6
MediaTek	0.815%	3.3	3.0	3.0	4.0	19.4

Die CO2-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offen gelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offen gelegt 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

Parent-Referenzindex: FTSE Emerging

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Januar 2022

ESG-Score der zehn kleinsten Positionen nach Gewichtung

Fonds	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW22*^	0.000%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
BRITIN 5.5 06/03/24 N3	0.000%	2.2	1.0	2.4	3.3	31.9
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW24*^	0.000%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
KWG LIVING GROUP HOLDINGS LT	0.000%	1.7	1.2	1.2	2.9	90.3
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW26*^	0.000%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ONECONNECT FINANCIAL TECHNO*^	0.001%	1.3	0.0	1.3	2.5	9.5
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	0.001%	2.0	1.8	1.4	3.0	32.1
CITIC SECURITIES CO LTD-RTS*^	0.001%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
CHINA AOYUAN GROUP LTD	0.001%	2.0	1.2	1.6	3.3	2.8
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	0.001%	2.5	1.6	1.7	4.7	106.7

Parent-Referenzindex	Gewichtung	ESG-Score	E	S	G	Kohlenstoffintensität
Bengang Steel Plates (A) (SC SZ)*^	0.000%	1.0	1.0	0.3	1.9	2,598.9
Xinhua Winshare Publishing and Media (A) (SC SH)*^	0.001%	1.7	0.7	1.3	3.5	14.5
Jiangsu Zhangjiagang Rural Commercial Bank (A) (SC SZ)*^	0.001%	1.1	1.0	1.3	0.9	1.7
Deppon Logistics (A) (SC SH)*^	0.001%	1.3	1.0	0.3	3.0	124.4
Sichuan Languang Development (A) (SC SH)*^	0.001%	1.1	0.9	0.9	1.6	67.5
Contec Medical Systems (A) (SC SZ)*^	0.001%	0.7	0.0	0.4	2.0	35.6
Jointo Energy Investment Hebei (A) (SC SZ)	0.001%	1.0	0.7	0.7	1.9	19,151.2
Tibet Cheezheng Tibetan Medicine (A) (SC SZ)*^	0.001%	2.2	2.0	2.2	2.5	43.1
Three Squirrels (A) (SC SZ)*^	0.001%	0.7	0.3	0.6	1.4	72.2
Getnet Units*^	0.001%	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

Die CO2-Daten von Unternehmen können oft „teilweise offen gelegt“ werden, d. h., die geografische Abdeckung ist teilweise offen gelegt 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

Parent-Referenzindex: FTSE Emerging

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Januar 2022

Angaben zu Risiken

- 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 denjenigen des Zielindex entsprechen wird („Tracking Error“).
- 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 des Fonds finden Sie in den wesentlichen Anlegerinformationen und im Prospekt.

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

Fondscenter



Glossar



Index-Haftungsausschluss

FTSE International Limited („FTSE“) © FTSE 2021. „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

Dieses Marketingdokument dient dem Vertrieb des in ihm vorgestellten Investmentfonds und stellt kein Angebot, keine Anlageberatung oder -empfehlung und keine unabhängige Finanzanalyse dar. Es kann eine Anlageberatung durch Ihre Bank nicht ersetzen. Die gesetzlichen Anforderungen zur Unvoreingenommenheit von Finanzanalysen sind nicht eingehalten. Ein Verbot des Handels der besprochenen Finanzprodukte vor der Veröffentlichung dieses Dokuments besteht nicht. Das Dokument ist nicht für US-Bürger bestimmt. Frühere Wertentwicklungen, Simulationen oder Prognosen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Aufgrund seiner Zusammensetzung kann der Fonds eine erhöhte Volatilität aufweisen, d. h. die Anteilpreise können erheblichen Schwankungen unterworfen sein.

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 AG, Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf sowie unter www.assetmanagement.hsbc.de.

Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Januar 2022

Nachhaltig investiert

