

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

### Il comparto promuoverà le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

Nel replicare la performance dell'Indice MSCI Global Aggregate 1-3 SRI Carbon ESG-Weighted (l'"Indice"), il Fondo promuove le seguenti caratteristiche ambientali e/o sociali:

- riduzione dell'esposizione alle emissioni di carbonio rispetto all'Indice Bloomberg Global Aggregate 1-3 Year (l'"Indice originario");
- miglioramento del rating ESG MSCI rispetto a quello dell'Indice originario.

Il Fondo mira a conseguire la promozione di queste caratteristiche replicando la performance dell'Indice, che elimina le società in base a criteri di esclusione per sostenibilità e ai criteri di esclusione del Global Compact delle Nazioni Unite e che pondera le società al fine di ridurre l'esposizione a società con emissioni di carbonio e riserve di carburante fossile più elevate e per migliorare l'esposizione a società con rating ESG favorevoli.

L'Indice è stato designato come parametro di riferimento al fine di rispettare le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Fondo.

L'Indice consegue tale risultato nei seguenti modi:

1. Escludendo i titoli di società con esposizione (come definito dal fornitore dell'Indice nella metodologia dell'Indice) a una delle seguenti caratteristiche (ciascuna caratteristica applicherà delle soglie, come definite dal fornitore dell'Indice e indicate nella metodologia dell'Indice e che potranno essere di volta in volta modificate).
2. La ponderazione di ciascun emittente componente viene rettificata mediante un moltiplicatore fisso, come stabilito nella metodologia dell'Indice, che è determinato dal suo Rating ESG MSCI.

Nell'ambito della costruzione dell'Indice, il fornitore dell'Indice non completa alcuna analisi dei danni significativi.

### Strategia d'investimento e proporzione di investimenti:

Il Fondo è gestito passivamente e mira a replicare il rendimento totale netto dell'Indice. Il Fondo utilizza tecniche di ottimizzazione che tengono conto del tracking error e dei costi di negoziazione nella costruzione di un portafoglio.

Nel tentativo di conseguire la propria politica d'investimento, il Fondo utilizza tecniche di ottimizzazione che tengono conto del tracking error e dei costi di negoziazione nella costruzione di un portafoglio. Di conseguenza, il Fondo potrebbe non detenere tutti gli elementi costitutivi l'Indice sottostante né investire proporzionalmente alla ponderazione di ciascun elemento all'interno dell'Indice. Il Fondo può altresì detenere titoli estranei all'Indice, ma che, stando alle previsioni, dovrebbero fornire rendimenti e caratteristiche di rischio analoghi a quelli di taluni componenti dell'Indice. Disponibilità liquide e mezzi equivalenti possono essere utilizzati a fini di liquidità, di copertura e di gestione efficiente del portafoglio.

Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e/o sociali e, sebbene non abbia come obiettivo l'investimento sostenibile, avrà una quota minima di investimenti sostenibili pari al 0%.

#### Metodologie:

Il team dedicato ai dati ESG di HSBC Asset Management si avvale di dati proprietari per la redazione di relazioni ESG interne al fine di garantire il rispetto degli obiettivi di sostenibilità, nonché degli indicatori utilizzati per misurarli, incorporati nella metodologia del prodotto. Utilizzando questi dati, HSBC Asset Management effettua regolari revisioni con il partner dell'indice pertinente per garantire l'esattezza dei dati forniti.

La buona governance societaria è stata da tempo incorporata nella ricerca proprietaria di HSBC Asset Management sui fondamentali delle società. Il team di stewardship di HSBC Asset Management si riunisce regolarmente con le società per migliorare la nostra comprensione delle loro attività e strategia, indicare il supporto o i problemi che abbiamo con azioni di gestione e promuovere le Best practice. HSBC Asset Management ritiene che una buona governance societaria assicuri che le società siano gestite in linea con gli interessi a lungo termine dei loro investitori.

Per la nostra politica di stewardship completa, visitare il sito [www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing/policies](http://www.assetmanagement.hsbc.com/about-us/responsible-investing/policies).

Ulteriori informazioni sono disponibili su richiesta.