March 2023

HMT Wertsicherung 94 ESG

ESG-Rating des Fonds

	Portfolio-ESG-Score	Positive Trends	Negative Trends	Laggards	Adjustment Factor	MSCI ESG Quality Score	MSCI ESG Fonds Rating
HMT Wertsicherung 94 ESG	**7.84**	5.58%	0.00%	0.00%	*1.06*	**8.27**	**AA**
Nachhaltigkeits-Benchmark	**6.77**	10.71%	3.04%	1.86%	*1.06*	**7.16**	**AA**

Benchmark: 25% EuroStoxx 50, 25% iBoxx Euro Corporates Non-Financials, 50% iBoxx Euro Sovereigns

Die Rating-Agentur MSCI ESG Research bewertet die Nachhaltigkeit von Wertpapier-Emittenten entlang einer Vielzahl von Indikatoren aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Governance und aggregiert diese Bewertungen in einen ESG-Score und ein ESG-Rating für den jeweiligen Emittenten. Der ESG-Score liegt auf einer Skala von 0 bis 10, wobei 0 den schlechtesten Wert und 10 den besten Wert darstellt. Das ESG-Rating wird aus dem ESG-Score abgeleitet und liegt auf einer Skala von CCC bis AAA, wobei CCC das schlechteste Rating und AAA das beste Rating darstellt. Emittenten mit ESG-Ratings von CCC und B werden als ESG-Laggards bezeichnet und Emittenten mit ESG-Ratings von AA und AAA als ESG-Leaders.
Der Portfolio-ESG-Score ist der gewichtete Durchschnitt der ESG-Scores der Emittenten gemäß der Portfoliobestände. Der MSCI ESG-Quality-Score (Skala 0 bis 10) adjustiert den Portfolio-ESG-Score in Bezug auf Emittenten mit positiver bzw. negativer ESG-Dynamik und der ESG-Laggards im Portfolio. Das MSCI ESG-Fondsrating (Skala CCC bis AAA) wird direkt aus dem MSCI ESG-Quality-Score berechnet.

Weitere Informationen zu den MSCI ESG Ratings: www.msci.com/our-solutions/esg-investing/esg-ratings.

ESG-Informationen zu Einzeltiteln im Fonds

Top ESG Scores

Asset	% NAV	Score
CIE GENERALE DES ESTABLI	3.7%	10 (AAA)
CRH PLC	0.4%	10 (AAA)
SCHNEIDER ELECTRIC SE	0.6%	10 (AAA)
VONOVIA SE	0.4%	10 (AAA)
ASSICURAZIONI GENERALI	0.7%	10 (AAA)

Flop ESG Scores

Asset	% NAV	Score
EUROPEAN UNION	7.7%	6.5 (A)
REPUBLIC OF AUSTRIA	21.4%	7.2 (AA)
LAND HESSEN	6.8%	7.3 (AA)
TOTALENERGIES SE	0.7%	7.1 (A)
SANOFI	0.6%	7 (A)

CO2-Fußabdruck des Fonds

	CO2-Intensität
HMT Wertsicherung 94 ESG	**73.25**
Nachhaltigkeits-Benchmark	**143.78**

Top Carbon Emissions

Asset	% NAV	CO2
MUENCHENER RUECK...	0.8%	1.2
AXA SA	0.5%	0.4
BERLIN HYP AG	2.9%	2.4
ASSICURAZIONI GE...	0.7%	0.6
EUROPEAN INVESTM...	3.8%	0.1

Flop Carbon Emissions

Asset	% NAV	CO2
TOTALENERGIES SE	0.7%	196.7
CRH PLC	0.4%	1,162.0
TERNA-RETE ELETT...	0.3%	599.3
IBERDROLA SA	0.6%	344.3
ENEL SPA	0.5%	584.3

Der CO2-Fußabdruck (CO2-Intensität) eines Unternehmens misst die Tonnen CO2-Emissionen (Scope 1 + Scope 2) je 1 Mio. USD-Umsatz des Unternehmens. Der CO2-Fußabdruck des Fonds ist der gewichtete Durchschnitt der CO2-Intensitäten der Unternehmen gemäß der Fondsbestände.

Ausschlusskriterien des Fonds*

FNG-Siegel

- Waffen und Rüstung
- Kernkraft incl. Uranbergbau
- Kohle (Bergbau und bedeutsame Verstromung), Fracking und Ölsand
- Verstöße gegen Menschenrechte und Demokratie
- Nichteinhaltung UN-Biodiversitäts-Konvention
- Korruption
- Verstoß gegen Atomwaffensperrvertrag
- Tabak
- Beitritt und Ratifizierung der Abkommen von Paris und Kyoto

Weitergehende Ausschlüsse durch HMT

- Unternehmen: Tierversuche, Tierpelze, Gentechnik, Pestizide, Pornografie und Gewaltdarstellung, Glücksspiel, Global Compact-Fail, Bestechung und Betrug, Waffen, Kernenergie, Palmöl, Landverbrauch, Biodiversitätsdefizite, Wasserverschwendung
- Staaten: Global Peace Index-Fail, Freedom House-Fail, Todesstrafe nicht verboten, Geldwäsche, Entwaldung

* mit jeweils geringen Umsatztoleranzen

Nachhaltigkeitszertifizierungen des Fonds

FNG-Siegel (1 Stern)

Investmentfonds mit FNG-Siegel entsprechen dem vom Fachverband Forum Nachhaltige Geldanlagen (FNG) entwickelten Qualitätsstandard für Nachhaltige Geldanlagen im deutschsprachigen Raum. Weitere Informationen zum FNG-Siegel: www.fng-siegel.org

Eurosif Transparenzlogo

Das Europäische Transparenzlogo für Nachhaltigkeitsfonds kennzeichnet, dass die HanseMerkur Trust sich verpflichtet, korrekt, angemessen und rechtzeitig Informationen zur Verfügung zu stellen, um Interessierten, insbesondere Kunden, die Möglichkeit zu geben, die Ansätze und Methoden der nachhaltigen Geldanlage des jeweiligen Fonds nachzuvollziehen. Weitere Informationen zum Eurosif Transparenzlogo: www.eurosif.org

Disclaimer
Although, HanseMerkur Trust AG, information providers, including without limitation, MSCI ESG Research LLC and its affiliates (the "ESG Parties"), obtain information (the "Information") from sources they consider reliable, none of the ESG Parties warrants or guarantees the originality, accuracy and/or completeness, of any data herein and expressly disclaim all express or implied warranties, includingthose of merchantability and fitness for a particular purpose. The Information may only be used for your internal use, may not be reproduced or redisseminatedin any form and may not be used as a basis for, or a component of, any financial instruments or products or indices. Further, none of the Information can in and of itself be used to determine which securities to buy or sell or when to buy or sell them. None of the ESG Parties shall have any liability for any errors or omissions in connection with any data herein, or any liability for any direct, indirect, special, punitive, consequential or any other damages (including lost profits) even if notified of the possibility of such damages.

Signatory of:
PRI Principles for Responsible Investment | UN environment programme finance initiative
UN-convened Net-Zero Asset Owner Alliance

HanseMerkur Trust AG
Neue Rabenstraße 3
D-20354 Hamburg

Fon: (040) 49 29 39 – 0
Fax: (040) 49 29 39 – 199
www.HMT-AG.de

Vorstand: Raik Mildner (Vors.), Dr. Carsten Lang, Lars Möller
Aufsichtsratsvorsitzender: Eberhard Sautter
Sitz Hamburg HRB 104797, USt-IdNr.: DE815096795