

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: Allianz Invest ESG Portfolio Blue

Unternehmenskennung (LEI-Code): 529900CDEGTMM6CYQY59

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_\_\_ %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_\_\_ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,94 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit dem eingesetzten Cleanvest advanced Modell der ESG Plus GmbH („ESG Plus“) werden die Zielfonds gemäß Ausschluss-, Negativ und Positivkriterien auf Einzeltitelebene gescreent. Dabei analysiert das Modell alle Einzeltitel jedes Zielfonds in Bezug auf Nachhaltigkeitsmerkmale und -kriterien und aggregiert diese. Das Cleanvest advanced Modell berücksichtigt für jeden einzelnen Fonds Ausschlusskriterien (inkl. max. zulässigen Verschmutzungsquoten) und kombiniert Negativ- sowie Positivkriterien zu einem Scoring. Ausschlusskriterien beziehen sich auf bestimmte Aspekte der aus dem ökologischen und/oder sozialen Bereich, die jedenfalls (ggf. unter Anwendung von Toleranzspielräumen) zum Ausschluss führen. Negativkriterien beziehen sich auf Aspekte, die unerwünscht sind, jedoch nicht automatisch zum Ausschluss führen. Positivkriterien beziehen sich auf Aspekte, die besonders erwünscht sind und in ihrem Ausmaß im Portfolio nicht begrenzt werden. Die Ergebnisse des Modells wurden in einem zweistufigen Verfahren ermittelt (zu näheren Angaben wird auf die Angaben im Prospekt, Anhang B, verwiesen).

Durch den Einsatz des Cleanvest advanced Modells konnten die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bei allen Investitionen in Zielfonds erfüllt werden. Nähere Angaben dazu finden Sie weiter unten.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die im Anhang zum Prospekt beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren bzw. -kriterien haben während des Berichtszeitraumes wie folgt abgeschnitten:

- Ausschlusskriterien: absolute Ausschlusskriterien, die zu einem Gesamtscore des Zielfonds unter 4,0 führten, wurden gar nicht ins Portfolio aufgenommen;
- Negativkriterien: bei Negativkriterien wurde der allfällige Verschmutzungsgrad (zB Umsatzanteil des jeweiligen Unternehmens) berücksichtigt. Trotz des jeweiligen Negativkriteriums darf das von ESG Plus ermittelte ESG-Score des Zielfonds von 4,0 nicht unterschreiten.

Grundsätzlich hat man sich während des Berichtszeitraumes bemüht, Zielfonds mit einem möglichst hohen ESG-Score zu erwerben.

Zum Stichtag lag der durchschnittliche von ESG Plus ermittelte ESG-Score der Zielfonds bei 5,86%.

Nachhaltigkeitsindikatoren	31.08.23
CO <sub>2</sub> -Fußabdruck des Portfolios an Aktien- und Unternehmensanleihen	1,10 Tsd Tonnen CO <sub>2</sub>
Durchschnittlicher ESG Score der Emittenten gemäß MSCI	5,89

### Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Für dieses Finanzprodukt wurden keine konkreten nachhaltigkeitsbezogenen Ziele iSd Artikels 2 Z 17 der Offenlegungs-VO definiert. Dennoch enthielt das Produkt 17,94% nachhaltige Investitionen:

Nachhaltige Investitionen	31.08.23
Staatsanleihen	3,22 Mio. Euro
Aktien und Unternehmensanleihen	3,25 Mio. Euro
<b>Nachhaltige Investitionen insgesamt in % des gesamten Fondsvermögens</b>	<b>17,94 %</b>

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Zusätzlich zu unserer ESG-Anlagestrategie für alle Anlagen haben wir strenge Auswahlkriterien für unsere nachhaltigen Anlagen angewandt, um sicherzustellen, dass unsere sozialen und ökologischen Ziele für diese nachhaltigen Anlagen nicht wesentlich beeinträchtigt werden. Diese Beschränkungen gelten für unsere nachhaltigen Anlagen:

- Unternehmen mit hohem ESG-Risiko (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) und schwacher Kontrolle dieser Risiken: Wir verwenden ein externes Bewertungsmodell, das die ESG-Risiken von Unternehmen erfasst. Die schlechtesten 10% der Emittenten dürfen nicht als nachhaltig eingestuft werden. Beispiele für ESG-Risikokriterien sind unter anderem: CO<sub>2</sub>-Emissionen, Wasserverbrauch (Umwelt), Gesundheits- und Sicherheitsmaßnahmen (Soziales), Mitarbeitervergütung und Steuerkonformität (Governance).
- Keine Finanzierung von Aktivitäten wie fossile Brennstoffe, Tabak, Alkohol, Glücksspiel und Erwachsenenunterhaltung (der Schwellenwert liegt bei 1 %; Unternehmen, die 1 % oder mehr ihrer Einnahmen aus ausgewählten negativen Aktivitäten erzielen, werden nicht als nachhaltig gekennzeichnet). Nur grüne Anleihen, die von Versorgungsunternehmen ausgegeben werden, sind ausgenommen, wenn diese Anleihen die Screening-Kriterien für "Do no significant harm" und "Good Governance" erfüllen.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Nicht anwendbar.

*Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte werden nicht explizit berücksichtigt, jedoch umfangreiche Ausschlusskriterien hinsichtlich Menschenrechte etc.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen des** Finanzprodukts entfiel:

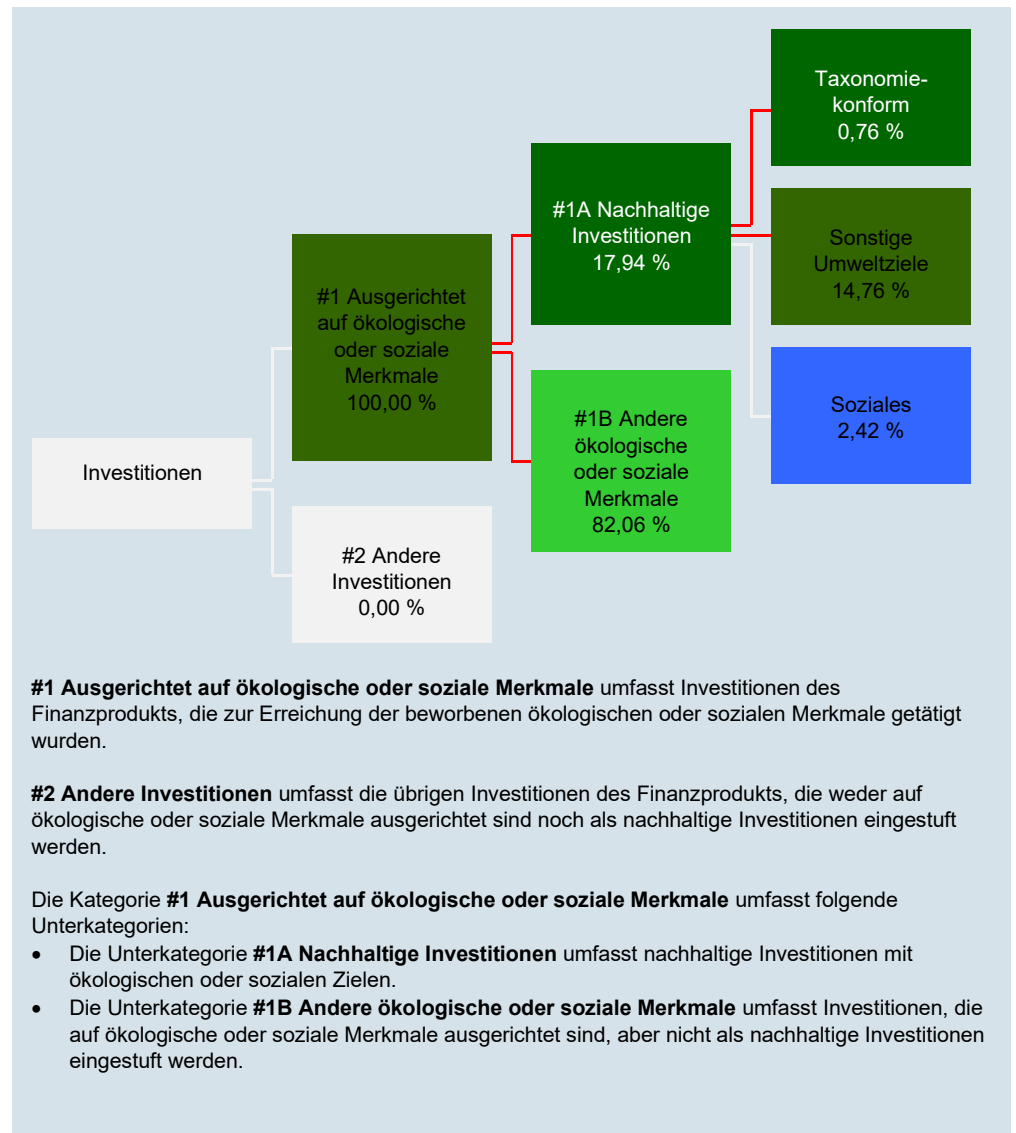
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Erste Group Bank AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	10,30	Österreich
BNP Paribas SA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,08	Frankreich
Allianz SE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,21	Deutschland
Italien	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	2,44	Italien
BlackRock Inc	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,64	Vereinigte Staaten von Amerika
Bundesrepublik Deutschland	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	1,61	Deutschland
Republik Österreich	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	1,45	Österreich
Microsoft Corp	Information und Kommunikation	1,15	Vereinigte Staaten von Amerika
Französische Republik	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	1,14	Frankreich
Litauen	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	0,97	Litauen
Rumänien	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	0,60	Rumänien
Tesla Inc	Verarbeitendes Gewerbe / Fertigungsindustrie	0,56	Vereinigte Staaten von Amerika
Königreich Spanien	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	0,56	Spanien
Sony Group Corp	Verarbeitendes Gewerbe / Fertigungsindustrie	0,56	Japan
Novo Nordisk Fonden	Verarbeitendes Gewerbe / Fertigungsindustrie	0,51	Dänemark



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die oben angegebenen Werte beziehen sich auf das Ende des Rechnungsjahres.

## In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	In % der Vermögenswerte
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	35,50
Verarbeitendes Gewerbe / Fertigungsindustrie	20,92
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Gesetzliche Sozialversicherung	16,22
Information und Kommunikation	10,34
Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,02
Energieversorgung	2,92
Grundstücks- und Wohnungswesen	2,42
Verkehr und Logistik	2,36
Erbringung von wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,00
Gesundheits- und Sozialwesen	0,99
Aktivitäten extraterritorialer Organisationen und Einrichtungen	0,99
Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,85
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,74
Baugewerbe/Bau	0,60
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,46
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,41
Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,22
Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	0,02
Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	0,01

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglicht darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel sind gemäß der EU-Taxonomieverordnung eine Unterkategorie der nachhaltigen Investitionen. Bislang wird nur ein kleiner Teil unseres Anlageuniversums von der EU-Definition ökologisch nachhaltiger Aktivitäten abgedeckt, und die Unternehmen werden erst 2023 damit beginnen, über taxonomiekonforme Aktivitäten zu berichten. Ein Grund für den geringen Anteil ist der derzeitige Mangel an tatsächlichen Daten. Bitte beachten Sie jedoch, dass wir uns bei der Datenerhebung nach besten Kräften bemühen. Solange noch keine vollständigen Daten über die an der Taxonomie ausgerichteten Aktivitäten der Unternehmen vorliegen, verwenden wir Daten von Drittanbietern. Sobald die tatsächlich gemeldeten Daten aus der öffentlichen Berichterstattung verfügbar sind, werden wir die tatsächlich gemeldeten Daten verwenden, um den tatsächlichen Anteil ökologisch nachhaltiger Investitionen im periodischen Bericht darzustellen.

## Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

- Ja:
- in fossiles Gas  in Kernenergie
- Nein

### Disclaimer:

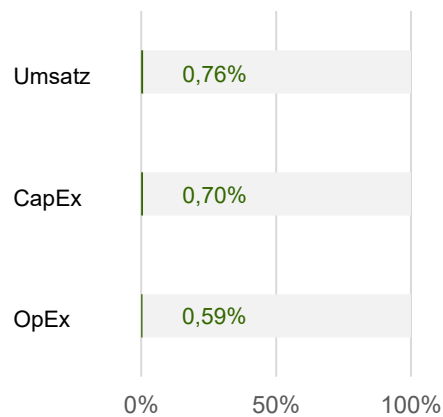
Ob das Finanzprodukt in Wirtschaftsaktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert ist, welche die Kriterien der EU-Taxonomie VO erfüllen, können wir derzeit noch nicht angeben. Entsprechende Daten für die dem Finanzprodukt zugrundeliegenden Investitionen werden voraussichtlich erst Ende 2023 zur Verfügung stehen, da nichtfinanzielle Unternehmen erstmalig im Jahr 2023 die relevanten Daten für ihre eigenen Wirtschaftsaktivitäten veröffentlichen werden. Sobald uns die Informationen hierzu vorliegen, werden wir Ihnen diese in Ihrem nächsten jährlichen Bericht zur Verfügung stellen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

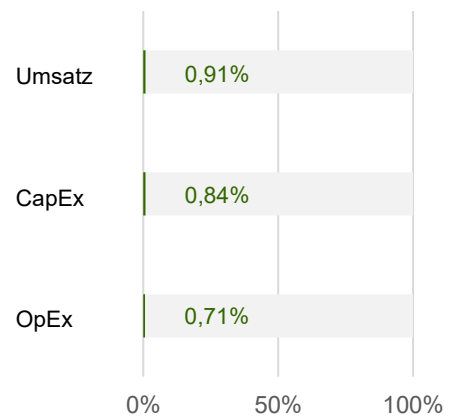
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

### 1. Taxonomie-Konformität der Investitionen **einschließlich Staatsanleihen\***



### 2. Taxonomie-Konformität der Investitionen **ohne Staatsanleihen\***



■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)  
■ Andere Investitionen

\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Aufgrund der begrenzten Datenverfügbarkeit ist es uns derzeit nicht möglich, den Anteil der ökologisch nachhaltigen Investitionen weiter in Übergangs- und Ermöglichungsaktivitäten aufzuschlüsseln.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Anteil, der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel beträgt 14,76 %. Bislang wird nur ein kleiner Teil unseres Anlageuniversums von der EU-Definition ökologisch nachhaltiger Aktivitäten abgedeckt, und die Unternehmen werden erst 2023 damit beginnen, über taxonomiekonforme Aktivitäten zu berichten.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investition beträgt 2,42%.



● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Nicht anwendbar. Unsere Strategie gilt für das gesamte Portfolio. Daher erfüllen 100% unserer Investitionen die ökologischen bzw. sozialen Merkmale dieses Produktes. Zusätzlich gelten unsere Ausschlüsse im ökologischen und sozialen Bereich, wie kontroverse Waffen, für das gesamte Portfolio.



● **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Im Hinblick auf die Erfüllung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfolgte eine laufende Prüfung gegen definierte Grenzen im Rahmen des internen Limitsystems. Die Umsetzung der Anlagestrategie umfasste verbindliche Negativkriterien, eine umfassende nachhaltigkeitsbezogene Analyse und die Konstruktion der Portfolios unter Berücksichtigung der ESG Bewertung des jeweiligen Emittenten.