

Niniejsza strategia stanowi informację opublikowaną w związku z artykułem 10 ust. 1 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2088 z dnia 27 listopada 2019 r. w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych („Rozporządzenie”). Dotyczy subfunduszy:

- Allianz SFIO subfundusz Allianz Defensywna Multistrategia,
- Allianz SFIO subfundusz Allianz Dynamiczna Multistrategia,
- Allianz SFIO subfundusz Allianz Zbalansowana Multistrategia.

Wymienione subfundusze lokują przynajmniej 60% wartości aktywów netto w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych przedstawionych w statucie funduszu Allianz SFIO. Fundusze zagraniczne, w które lokują wymienione subfundusze, realizują, zgodnie z ich prospektem, przytoczoną poniżej strategię.

Wymienione subfundusze są produktami inwestycyjnymi, o których jest mowa w art. 8 Rozporządzenia. Produktami inwestycyjnymi, o których jest mowa w art. 8 Rozporządzenia, są także te produkty z wieloma wariantami inwestycyjnymi, w których wśród dostępnych wariantów inwestycyjnych jest przynajmniej jeden z wymienionych subfunduszy.

Strategia Zrównoważonego i Odpowiedzialnego Inwestowania - Strategia SRI

Subfundusz zarządzany zgodnie ze Strategią Zrównoważonego i Odpowiedzialnego Inwestowania („Strategia SRI”) bierze pod uwagę Czynniki Zrównoważonego Rozwoju i jest zgodny z zasadami „zrównoważonych i odpowiedzialnych inwestycji”. Część dotycząca odpowiedzialnych inwestycji obejmuje zaangażowanie i głosowanie przez pełnomocnika. Aspekt dotyczący zrównoważonych inwestycji obejmuje następujące aspekty:

(i) Cechy środowiskowe służą do oceny papierów wartościowych na podstawie wypełnienia aspektów środowiskowych przez emitenta.

(ii) Cechy społeczne służą do oceny papierów wartościowych na podstawie społecznej odpowiedzialności emitenta.

(iii) Charakterystyka praw człowieka ocenia papiery wartościowe na podstawie poszanowania przez emitenta praw człowieka w prowadzonej przez niego działalności gospodarczej.

(iv) Cechy nadzoru służą do oceny papierów wartościowych na podstawie systemu reguł, praktyk i procesów emitenta, za pomocą których ten emitent jest kierowany i kontrolowany.

(v) Zachowanie biznesowe ocenia papiery wartościowe na podstawie relacji handlowych emitenta i bezpieczeństwa ich produktów (ta domena nie ma zastosowania do papierów wartościowych wyemitowanych przez państwa).

Wyżej wymienione dziedziny: Środowisko, Społeczeństwo, Prawa Człowieka, Nadzór i Zachowania biznesowe są analizowane przez podmiot zarządzający subfunduszem w celu oceny, w jaki sposób zrównoważony rozwój i kwestie długoterminowe zostały uwzględnione w strategii emitenta.

Ponadto, wyżej wymienione domeny (w tym wszelkie podkategorie) są ustalane przez podmiot zarządzający subfunduszem w określonych relacjach między sobą i definiują obszar inwestycyjny subfunduszu, który może być wykorzystywany w ramach wdrażania Strategii SRI. Strategia SRI opiera się również na ratingach SRI w celu zastosowania wykluczenia emitentów lub doboru emitentów w obszarze inwestycyjnym subfunduszu.

Subfundusz zarządzany zgodnie ze Strategią SRI inwestuje w akcje i/lub dłużne papiery wartościowe zgodnie z opisem w celu inwestycyjnym odpowiedniego subfunduszu. Większość aktywów subfunduszu podlega ratingom SRI. Oczekuje się, że odsetek aktywów, które nie mają ratingu SRI, będzie niski. Przykładami instrumentów, które nie osiągają ratingu SRI, są środki pieniężne i depozyty, niektóre Fundusze Docelowe oraz inwestycje z czasowo rozbieżnymi lub brakującymi kwalifikacjami środowiskowymi, społecznymi lub dotyczącymi dobrego nadzoru. Konkretny limity, które są rozważane przez podmiot zarządzający subfunduszem w kontekście stosowania strategii SRI, można znaleźć w indywidualnych ograniczeniach inwestycyjnych subfunduszu, które są opisane w innych częściach prospektu subfunduszu.

Dodatkowo, Strategia SRI wyklucza inwestowanie w papiery wartościowe podmiotów, które:

- poważnie łamią United Nations Global Compact (niewiążący pakt ONZ zachęcający przedsiębiorstwa do przyjęcia polityk zrównoważonej i odpowiedzialnej społecznie działalności i do publikowania sprawozdań z wykonania tych polityk; subfundusz będzie wychodził z inwestycji w papiery wartościowe podmiotów, które nie będą wykazywały woli zmiany zachowania),*
- biorą udział w produkcji broni kontrowersyjnych rodzajów lub które osiągają ponad 10% przychodów z produkcji broni,*
- osiągają ponad 10% przychodów z wydobywania węgla energetycznego i spółek użyteczności publicznej, które osiągają ponad 20% przychodów z węgla,*
- osiągają ponad 5% przychodów z wytwarzania lub dystrybucji tytoniu.*

W przypadku państw, brana pod uwagę jest niska wartość wskaźnika Freedom House Index.

Kryteria wyłączenia mogą być zmieniane; bieżące informacje znajdują się na stronie

<https://regulatory.allianzgi.com/ESG/SRI-exclusions>. Różni dostawcy danych i analiz są wykorzystywani w celu określenia wykluczenia.

Transakcje mające za przedmiot instrumenty pochodne są opisane w innych częściach prospektu subfunduszu. Jeśli to możliwe, podmiot zarządzający subfunduszem będzie dawał pierwszeństwo tym transakcjom mającym za przedmiot instrumenty pochodne, które służyłyby wypełnieniu aspektów środowiskowych lub społecznych subfunduszu zarządzanego zgodnie ze Strategią SRI.