

# ESG-Reporting & Metadaten

# SUSAN HOFLEITHNER



+43 5 0100 6 - 19722



[susan.hofleithner@erste-am.com](mailto:susan.hofleithner@erste-am.com)



# MARGERITA NENNING



+43 5 0100 - 19737



[margerita.nenning@erste-am.com](mailto:margerita.nenning@erste-am.com)



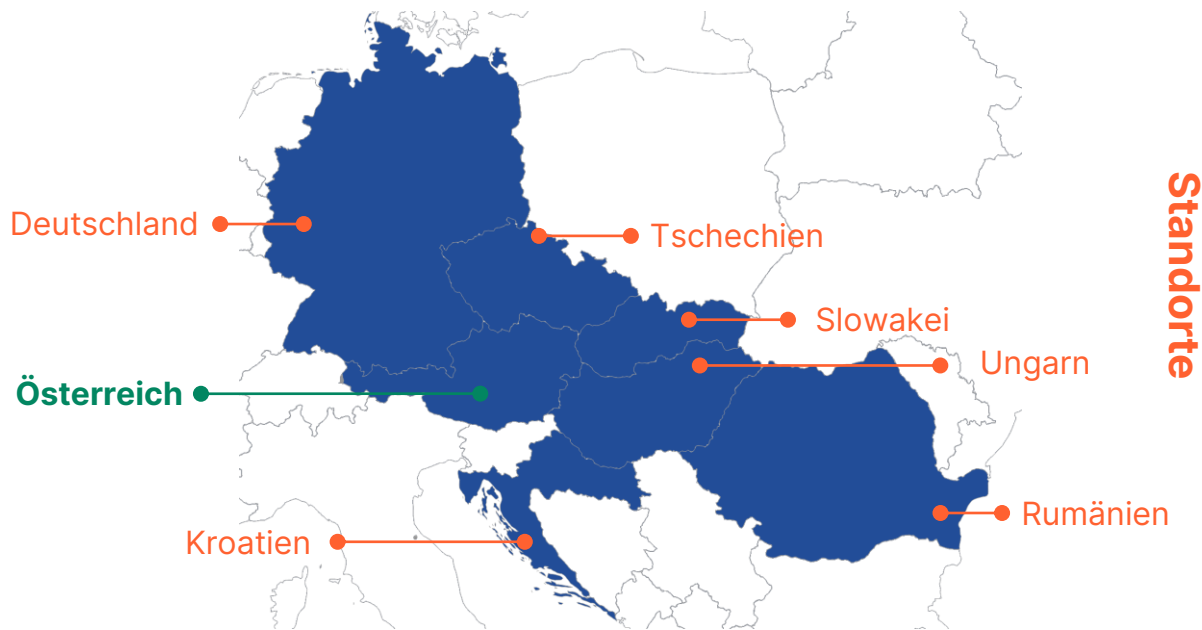
# AGENDA

1. Erste Asset Management: **Profil & grüne Produktpalette**
2. Einblicke in eine **“ergrünende“ Datenwelt**
3. **Reports** mit ESG Schwerpunkt
4. Erste Asset Management: **SFDR Projekt – in Zahlen**

# 01

## Erste Asset Management: **Profil & grüne Produktpalette**

# ERSTE ASSET MANAGEMENT - AUF EINEN BLICK



Die **Erste Asset Management (EAM)** versteht sich als internationale Vermögensverwalterin und Asset Managerin mit einer starken Position in Zentral- und Osteuropa.

Zu den **Kernkompetenzen** der EAM zählen die Koordination und Verwaltung von **nachhaltig hochwertigen Investmentfonds** und **Vermögensverwaltungslösungen**.

Unsere mehr als **400 Mitarbeiter: innen** bemühen sich täglich um die Zufriedenheit unserer institutionellen und Privatanleger: innen.

## ECKDATEN

<b>Assets</b>	<b>69,35</b>
Investment Funds	56,94
Portfolio Management	11,51
ESG investments volume	15,50

Angaben zum 31.12.2022 in Mrd. EUR

# NACHHALTIGE MILESTONES, FACTS & FIGURES



**2001**

Auflage des ersten Nachhaltigkeitsfonds

**2006**

Kooperation mit dem WWF Österreich

**2009**

Unterzeichnung der UN PRI

**2012**

Keine Investitionen in Produzenten kontroverser Waffen

**2015**

Wir messen den CO<sub>2</sub>-Fußabdruck unserer Publikumsfonds

**2016**

Keine Investitionen in Produzenten von Kohle

**2018**

Wir messen den Wasser-Fußabdruck unserer Publikumsfonds

**2020/21**

Auflage von zwei weiteren Artikel 9-Aktiefonds

**2022**

Bestätigung der Artikel 9-Fonds im Zuge der Umsetzung von SFDR Level 2

**20+**

ESG-Investment-Experten

**€ 15,5 Mrd.**

nachhaltig verwaltetes Vermögen

**+22%**

jährlicher Zuwachs an nachhaltig verwaltetem Vermögen seit 2013

**47%**

unserer Publikumsfonds in Österreich sind gemäß SFDR als nachhaltig eingestuft

**17**

Fonds nach FNG oder Österreichischen Umweltzeichen zertifiziert

# WIR INVESTIEREN GRÜN

Wir verwalten rund EUR 1,4 Mrd. an reinen Umweltfonds im Publikumsfondsbereich.

Mit dem Fondsstart in Jahr 2001 wurde mit dem **ERSTE WWF STOCK ENVIRONMENT\*** (Master-Fonds des ERSTE STOCK ENVIRONMENT) einer der ältesten Umwelt-Aktienfonds durch die Erste Asset Management aufgelegt.

Als Artikel 9-Fonds gem. OffenlegungsVO steht die messbare positive Auswirkung (Impact) auf Umwelt und Gesellschaft bei der Titelselektion im Vordergrund.

Die Erste Asset Management unterstützt mit einem Teil der Verwaltungsgebühr des Fonds die Wasser-, Klima- und Naturschutzprogramme des WWF Österreich. Seither sind rund EUR 5 Mio. in entsprechende Projekte geflossen.

Die Zertifizierung mit dem Österreichischen Umwelt-zeichen und die Auszeichnung mit der FNG-Bestnote von 3 Sternen sowie zahlreiche Top-Platzierungen bei Tests und Auszeichnungen unterstreichen unsere Research- und Managementqualität bei nachhaltigen Investments.

*\* Der Fonds ist nicht zum Vertrieb in Deutschland zugelassen.*

Hinweis: Wichtige rechtliche Hinweise zu den Fonds finden Sie am Ende der Präsentation.

Quelle: Erste Asset Management, FONDSprofessionell, ECOreporter, Refinitiv



*„Der bisher nachhaltigste von ECOreporter getestete Fonds. Auch finanziell herausragend.“*

(ECOreporter 02/2023)

*„Bester Fonds über 10 Jahre in der Kategorie Alternative Energy“*

(Refinitiv Lipper Fund Awards Austria 2022)

*„Der ERSTE WWF STOCK ENVIRONMENT zählt zu den Top-Portfolios in der Kategorie Sustainable Investments.“*

(Österreichischer Fondspreis/FONDSprofessionell 03/2022)

# 02

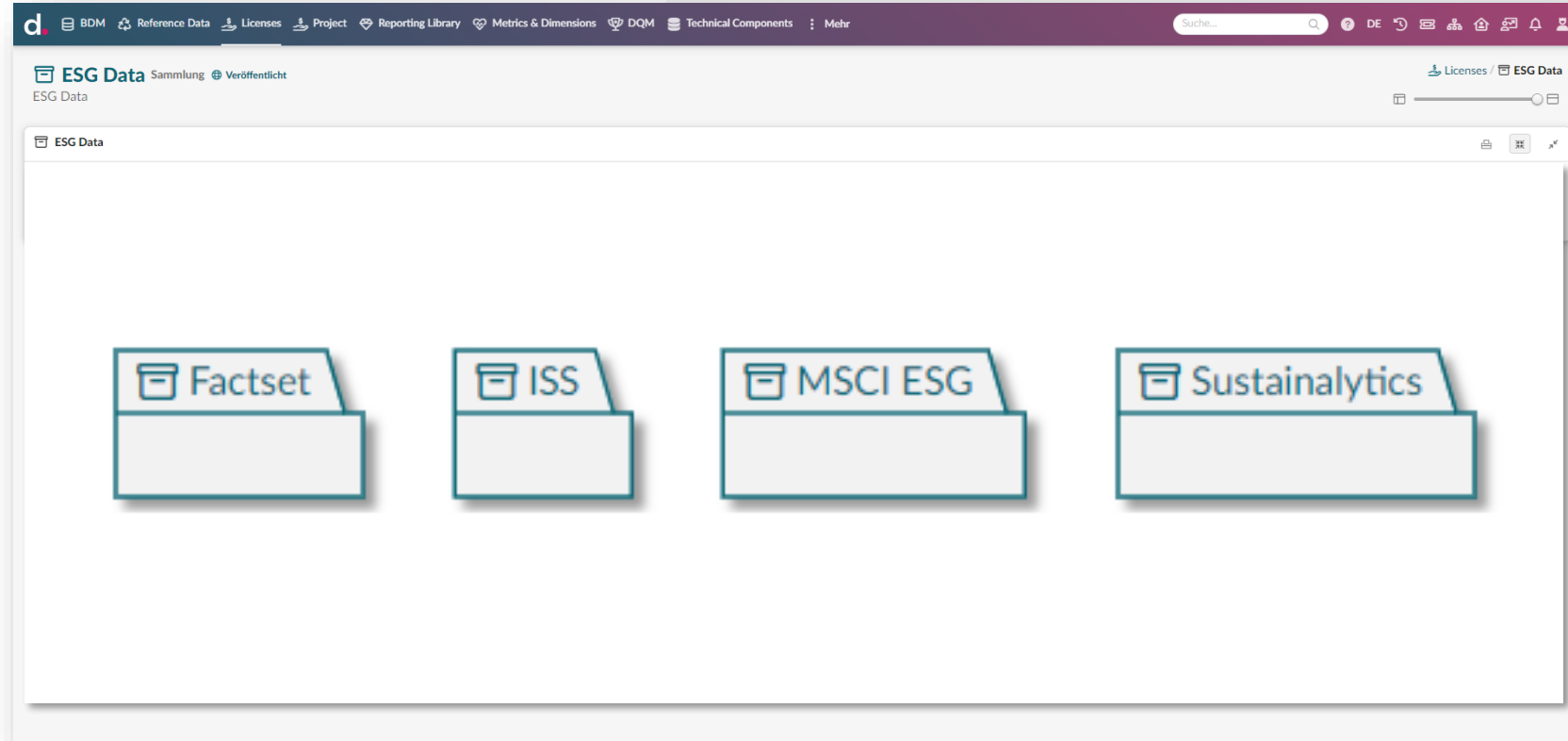
Einblicke in eine **“ergrünende“ Datenwelt**



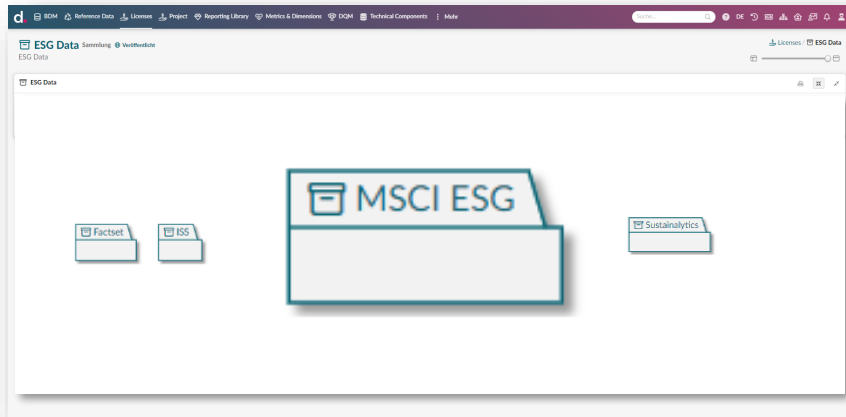
# 261

ESG Data Feeds

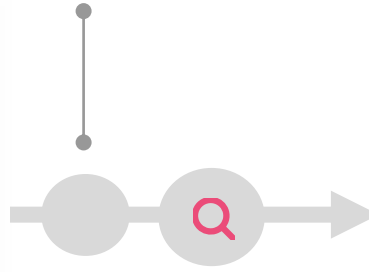
> **9.000**  
**Attribute** von  
diversen Data  
Providern



# LIZENZEN



MSCI Lizenzen



ZOOM IN

The screenshot shows a detailed view of a project in the ESG Data system. The breadcrumb trail is 'Licenses / ESG Data / MSCI ESG / ECA\_00283883.0'. The project name is 'ECA\_00283883.0' and it is 'Veröffentlicht' (Published). The subject is 'SFDR & Taxonomy'. The project details include:  
- **Projekt**: MSCI Sustainable Finance Module MSCI SFDR Adverse Impact Metrics • Universe: All-then currently available MSCI EU Taxonomy Alignment Universe: All-then currently available  
- **Start Datum**: 23.02.2021, **End Datum**: 30.03.2022  
- **Daten können verwendet werden von**: EAM Group & SPK, **Verlängerungszeitraum**: Jährlich  
- **Anlieferung**: FTP  
Below the details, there are sections for 'Verwendungen' (2) and 'Subprojekte'. The 'Verwendungen' section has a search bar and a table with the following entries:  

Verwendung ↓	Status
Technical Components / ... / MSCI_ESG_Data / MSCI EU Taxonomy Factors MSCI EU Taxonomy Factors	🌐 ✎
Technical Components / ... / MSCI_ESG_Data / MSCI SFDR Indicators MSCI SFDR Indicators	🌐 ✎

At the bottom, there's a section for 'ECA\_00283883.0' with a search bar and a button labeled 'ECA\_00283883.0'.

**MSCI SFDR Indicators** Datei

Veröffentlicht ESG SFDR

Technical Components / External Data Feeds / MSCI / MSCI\_ESG\_Data / MSCI SFDR Indicators

**Datei**

MSCI SFDR Indicators hat noch keine Beschreibung!

**Schlagworte**

- ESG
- SFDR

**Lieferfrequenz**  
weekly

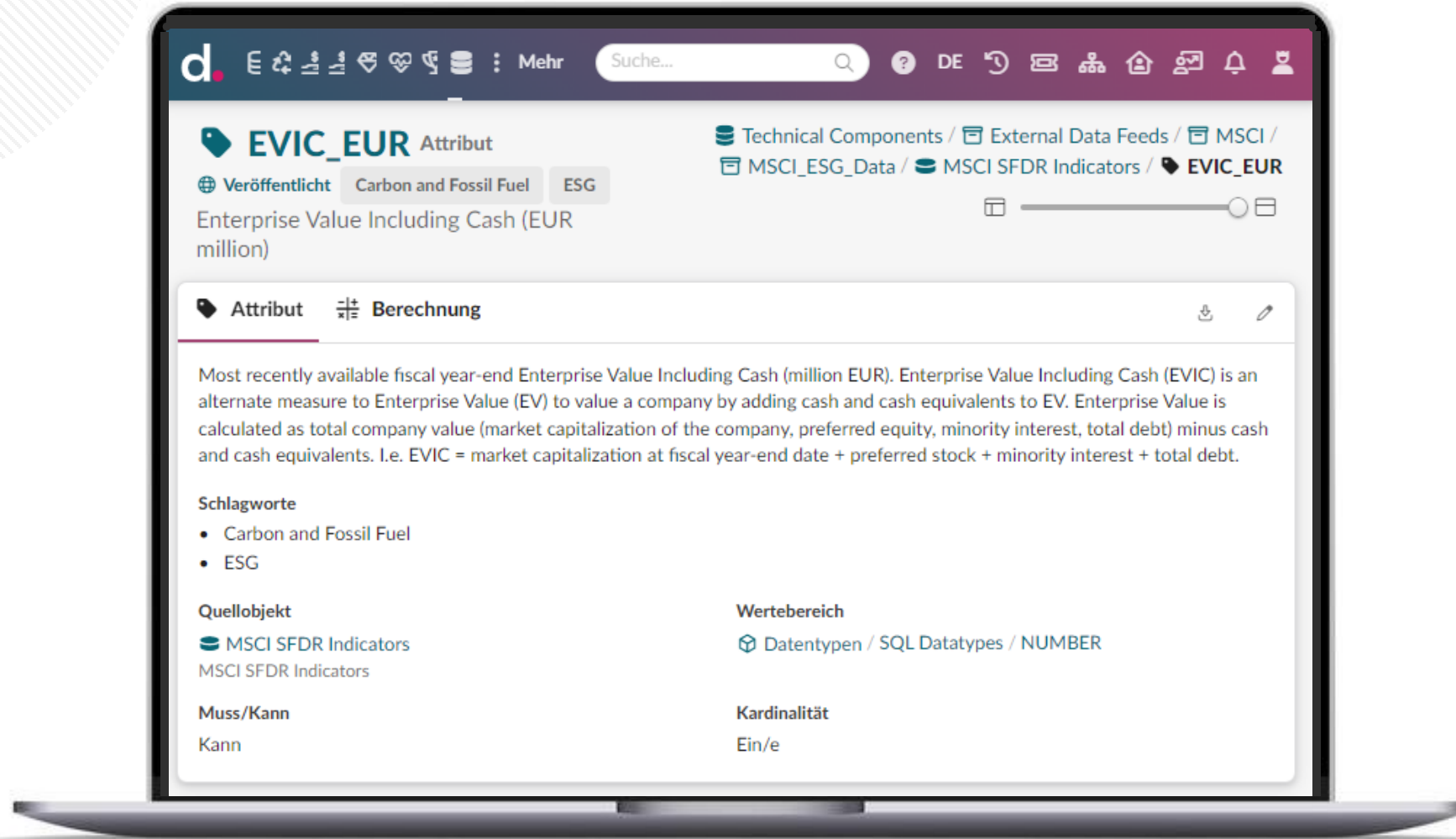
**Attribute** 119 **Beziehungen**

EVIC\_EUR

# ↓	Bezeichnung	Wertebereich	Status	
63	<b>EVIC_EUR</b> Enterprise Value Including Cash (EUR million)	NUMBER	🌐	✎
106	<b>CARBON_EMISSIONS_EVIC_EUR_SCOPE123_INTEN</b> Total GHG Emissions Intensity per EUR million EVIC (t/EUR million EVIC)	VARCHAR	🌐	✎

25 Ergebnisse pro Seite

« < 1 > »





## Impact Report

Technical Components > MSCI SFDR Indicators > EVIC\_EUR

datapot.

be data excellent

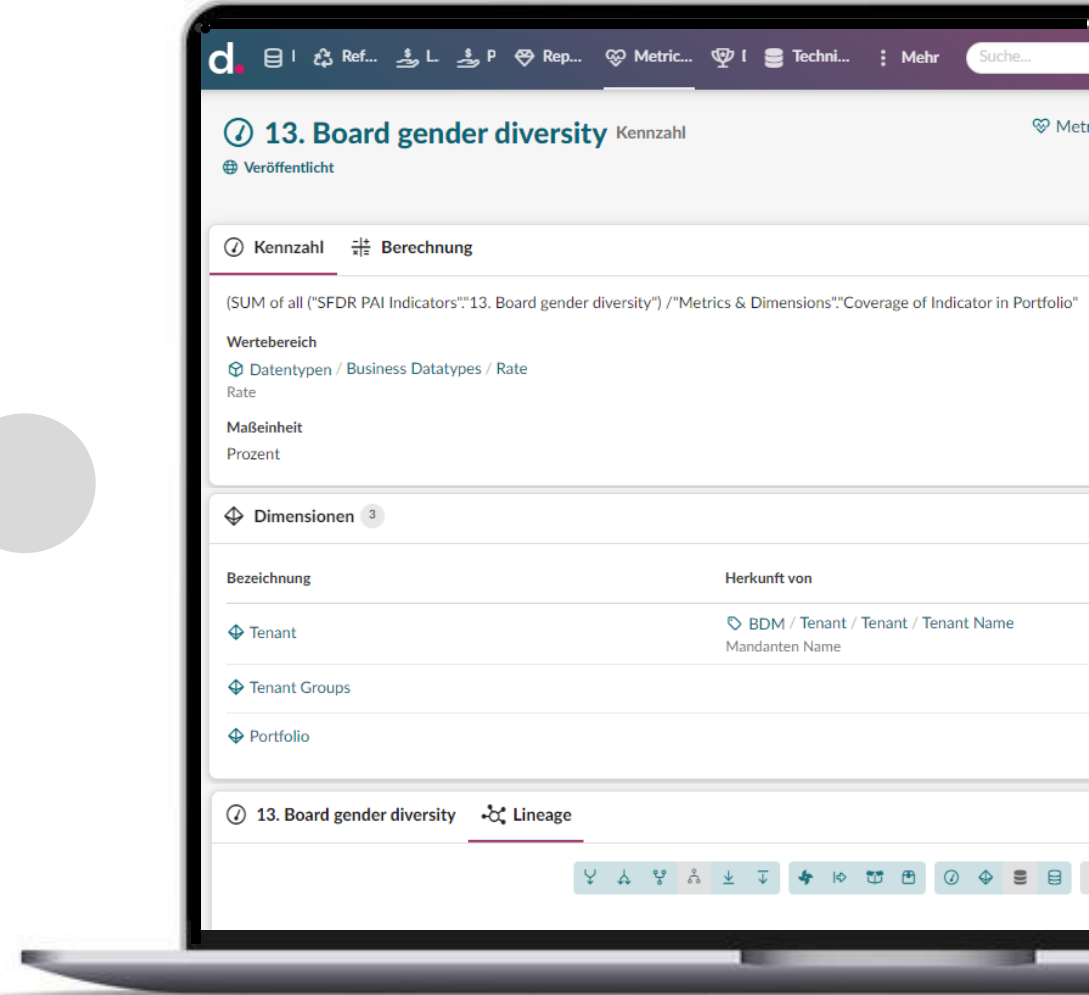
Version v4.0.4

#	Pfad	Verknüpfung	Asset	Bezeichnung
1	EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Import BDM > ESG > PAI factors > MSCI SFDR Indicators 2 Pal Factors > 1
	EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > MSCI_ESG_SFDR_V > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57
2	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57	Transformation zu	Attribut	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > MSCI_ESG_SFDR_V > EVIC_EUR
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 Pal Factors > 1	Transformation zu	Attribut	Import BDM > ESG > PAI factors > Enterprise value including cash (in EUR)
3	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 Pal Factors > 1 > Enterprise value including cash (in EUR)	Herkunft zu	Attribut	Import BDM > Party > Issuer > Enterprise Value
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 100
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 15
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 16
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 2
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 24
	EVIC_EUR > MSCI SFDR Indicators 2 MSCI_ESG_SFDR_V > 57 > EVIC_EUR	Transformation zu	Transformationsregel	Technical Components > Databases > F_APP_ES-GENIUS > ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > MSCI_ESG_SFDR_V 2 ESGENIUSAPP_PAI_FACTORS_TB > 25

> 4000

ESG Kennzahlen

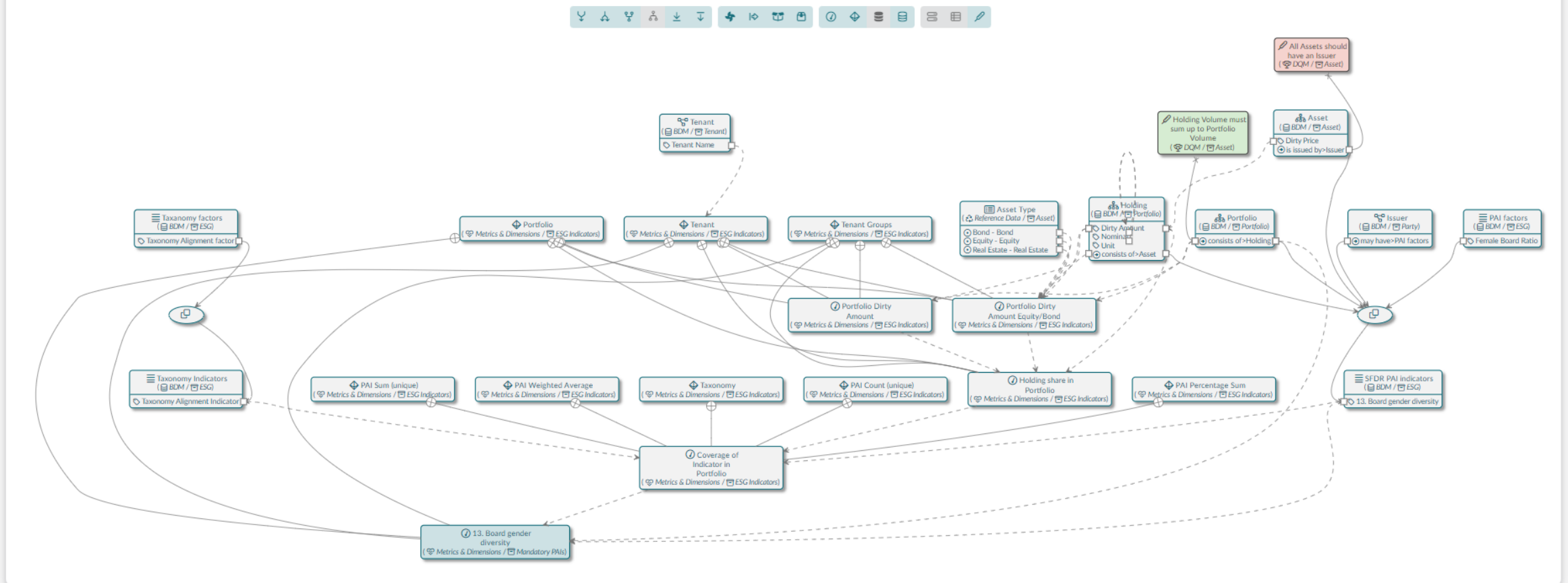
# 1 aus >400 Kennzahlen





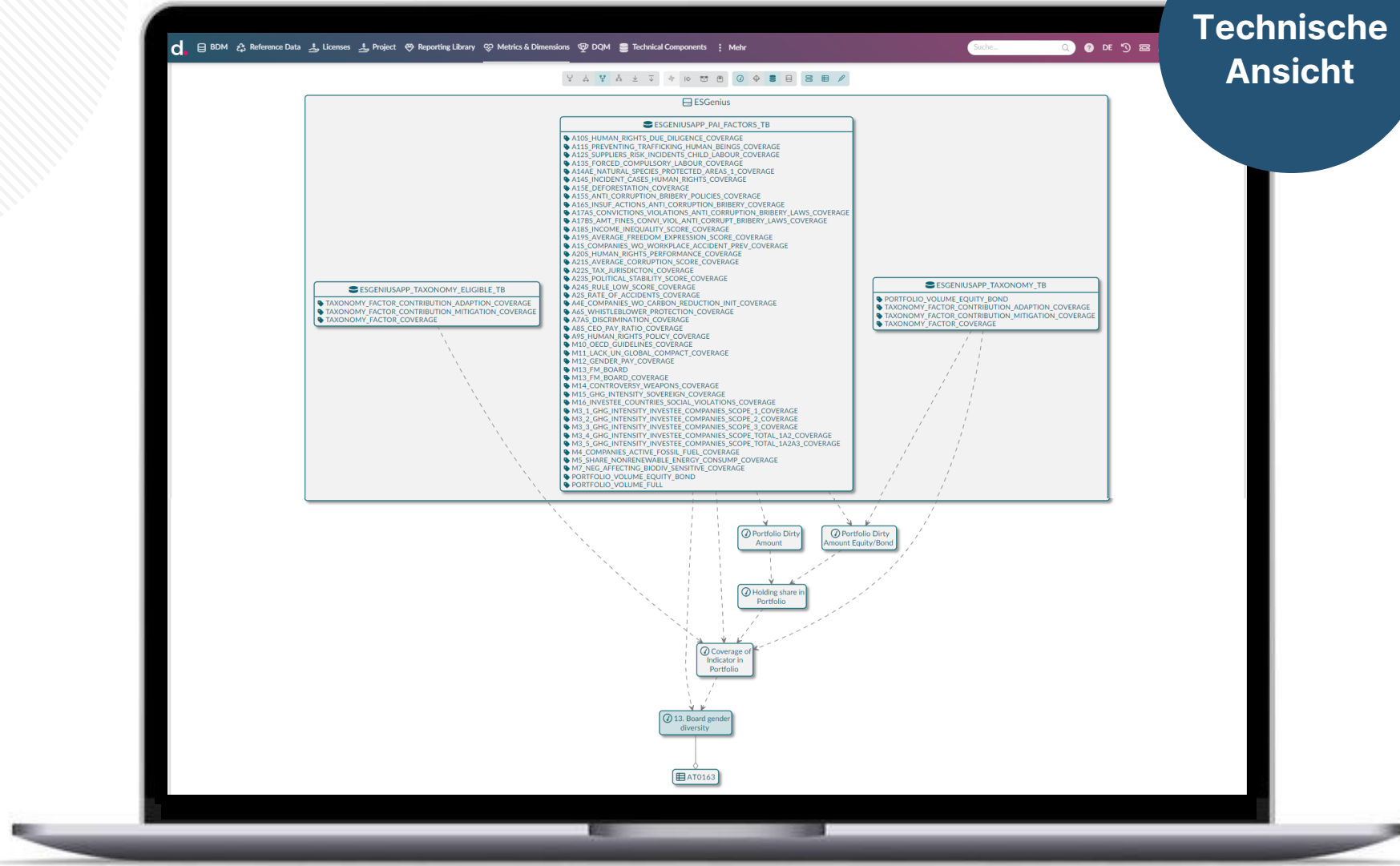
13. Board gender diversity Kennzahl Veröffentlicht

13. Board gender diversity Lineage



# TECHNICAL LINEAGE

Technische Ansicht

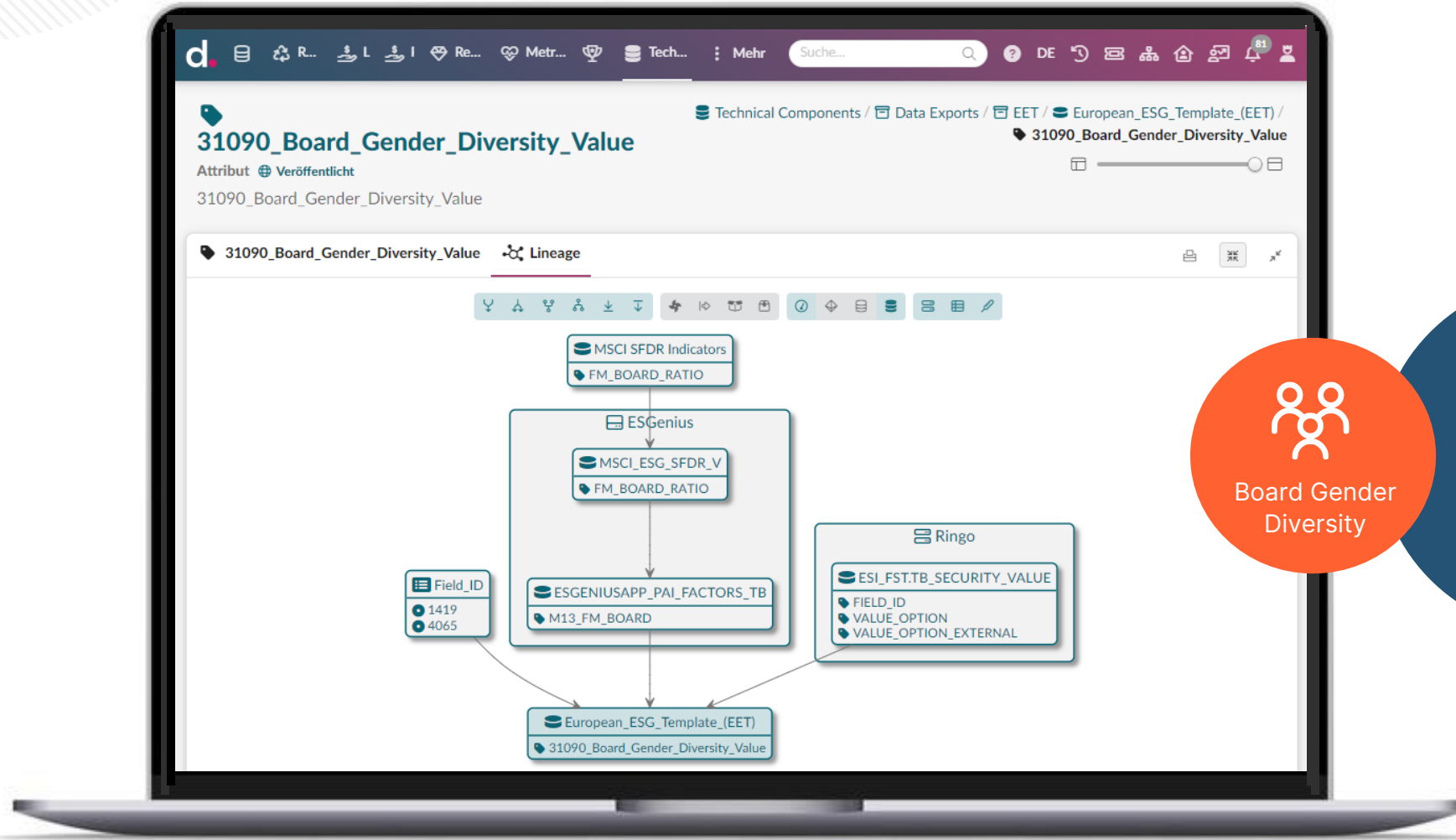


# 03

## Reports mit ESG Schwerpunkt

> 50

ESG Report Types



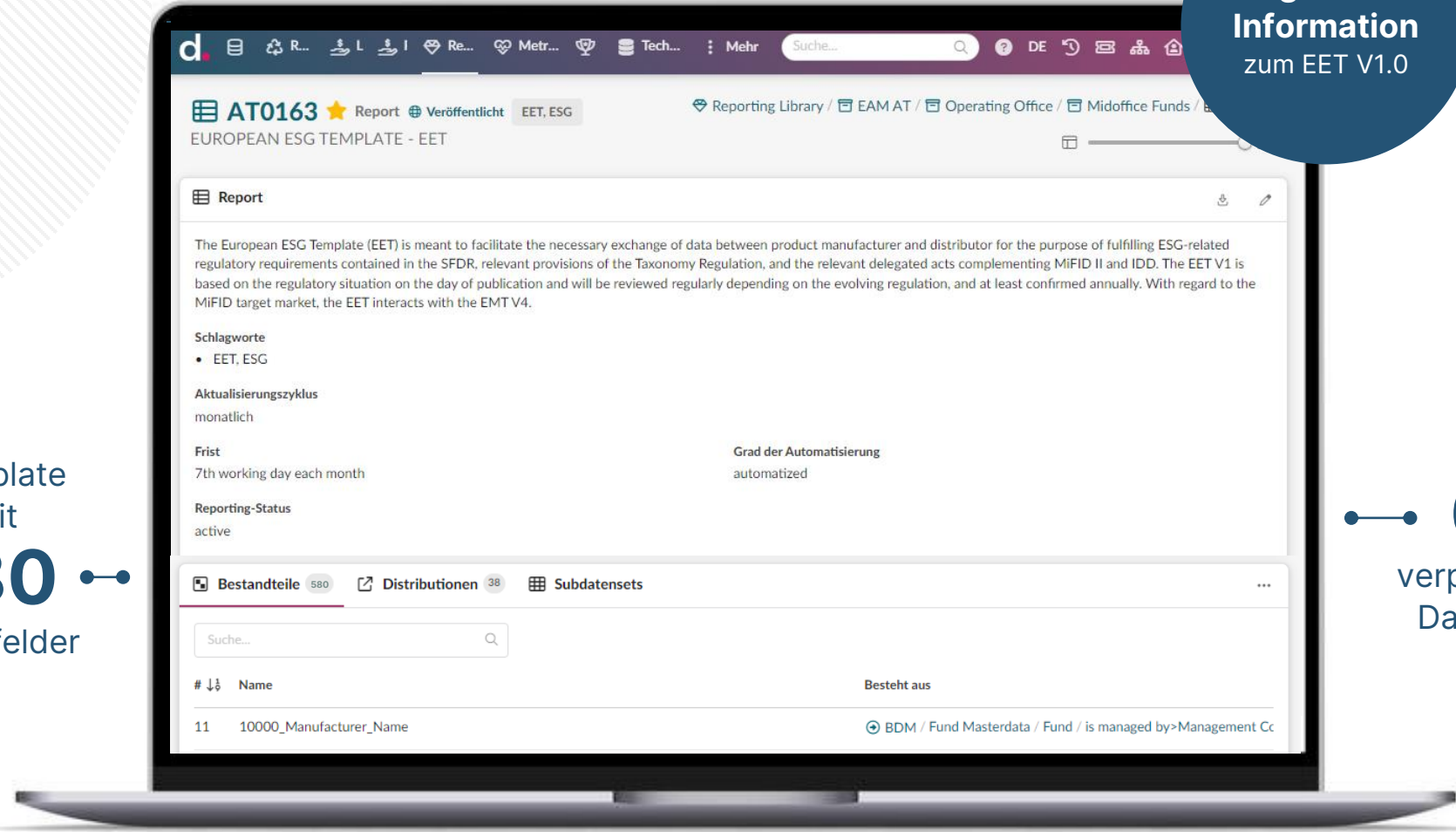
  
Board Gender Diversity

European ESG Template (EET V1.0)

1 / > 50 REPORTS - EET

Template mit **580** Datenfelder

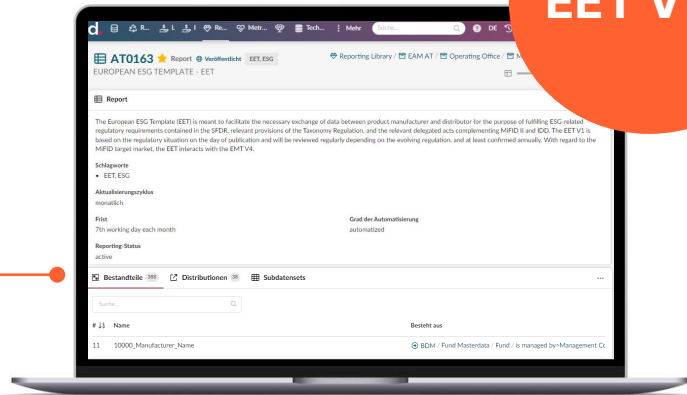
Allgemeine Information zum EET V1.0



61 verpflichtende Datenfelder

1 / > 50 REPORTS - EET

388 Datenfelder von EAM befüllt

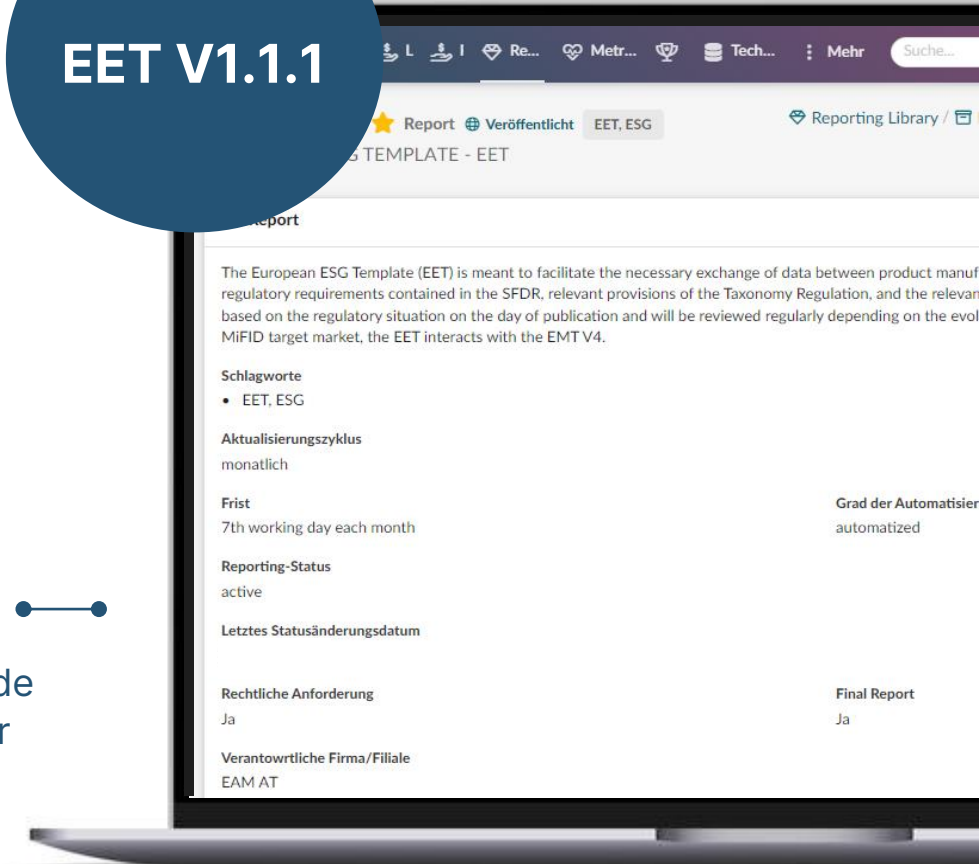


EET V1.0

VS.

~ 200 verpflichtende Datenfelder

EET V1.1.1



The European ESG Template (EET) is meant to facilitate the necessary exchange of data between product manufacturer and distributor for the purpose of fulfilling ESG-related regulatory requirements contained in the SFDR, relevant provisions of the Taxonomy Regulation, and the relevant provisions of the MiFID II and ESMA. The EET is based on the regulatory situation on the day of publication and will be reviewed regularly depending on the evolution of the regulatory situation. With regard to the MiFID target market, the EET interacts with the EMT V4.

Schlagnamen

- EET, ESG

Aktualisierungszyklus

monatlich

Frist

7th working day each month

Reporting-Status

active

Letztes Statusänderungsdatum

Rechtliche Anforderung

Ja

Verantwortliche Firma/Filiale

EAM AT

Grad der Automatisierung

automatized

Final Report

Ja

# 04

## Erste Asset Management: **SFDR Projekt – in Zahlen**



## Zweck und Geltungsbereich:

**Offenlegungspflichten auf Unternehmens- und Produktebene** für Asset Manager, Versicherungen und Banken mit Portfolioverwaltung.

**Inkrafttreten:** 10. März 2021

## Zweck & Geltungsbereich:

Konkretisierung der Inhalte, Methodik und Art der Darstellung der zu offenlegenden Information

**Inkrafttreten:** 14. August 2022

**Anzuwenden seit:** 1. Januar 2023

## 3 Kategorien:

### (1) Artikel 8 – light green:

Finanzprodukte mit ökologischen oder sozialen Merkmalen

### (2) Artikel 9 – dark green:

Finanzprodukte mit einer angestrebten Nachhaltigkeitswirkung

### (3) Artikel 6:

Sonstige Finanzprodukte

## 39 Verpflichtende Indikatoren

+ **61 optional Indikatoren** aus den Bereichen Treibhausgasemissionen, Energieeffizienz, Biodiversität, Wasser, Abfall, Soziales und Mitarbeiter, Menschenrechte und Korruption.



Verordnungsartikel

# 412

SFDR Dokumente

451

Textblöcke

6

Länder

11

Sprachen

28 FTE

# 9 Abteilungen



# 437

Arbeitstage zw. SFDR Inkrafttreten  
und EAM Implementierung

2.624

Aufwand in PT

140kg

Schokolade

○ ○ ○  
**ANNEX**

# CHANCEN & RISIKEN

## ERSTE STOCK ENVIRONMENT

### Vorteile für Anlegerinnen und Anleger

- ✓ Breite Streuung in Unternehmen der Umweltbranche schon mit geringem Kapitaleinsatz.
- ✓ Chancen auf attraktive Wertsteigerung.
- ✓ Der Fonds eignet sich als Beimischung zu einem bestehenden Aktienportfolio und ist für einen langfristigen Substanzzuwachs bestimmt.

### Zu beachtende Risiken

- ⚠ Der Fondspreis kann stark schwanken (hohe Volatilität).
- ⚠ Aufgrund der Anlage in Fremdwährungen kann der Anteilwert in Euro durch Wechselkursänderungen belastet werden.
- ⚠ Kapitalverlust ist möglich.
- ⚠ Da der Feeder-Fonds den Großteil seines Vermögens in den Master investiert, hängt die Kursentwicklung des Feeder-Fonds maßgeblich von der Kursentwicklung des Master-Fonds ab. Weitere Risiken, die für den Feeder-Fonds von Bedeutung sein können, sind insb.: Kredit- und Kontrahenten-, Liquiditäts-, Verwahr-, Derivatrisiko sowie operationelle Risiken. Umfassende Informationen zu den Risiken des Feeder-Fonds sind dem Prospekt bzw. den Informationen für Anleger gem. § 21 AIFMG, Abschnitt II, Kapitel „Risikohinweise“ zu entnehmen.

### WARNHINWEISE GEMÄSS INVFG 2011

Für den Investmentfonds werden dauerhaft mindestens zu 85 % des Fondsvermögens Anteile des ERSTE WWF STOCK ENVIRONMENT (Master-Fonds) erworben.

# CHANCEN & RISIKEN

## ERSTE WWF STOCK ENVIRONMENT

### Vorteile für Anlegerinnen und Anleger

- ✓ Breite Streuung in Unternehmen der Umweltbranche schon mit geringem Kapitaleinsatz.
- ✓ Unterstützung der Umweltschutzprogramme des WWF durch die Erste AM.
- ✓ Chancen auf attraktive Wertsteigerung.
- ✓ Der Fonds eignet sich als Beimischung zu einem bestehenden Aktienportfolio und ist für einen langfristigen Substanzzuwachs bestimmt.

### Zu beachtende Risiken

- ⚠ Der Fondspreis kann stark schwanken (hohe Volatilität).
- ⚠ Aufgrund der Anlage in Fremdwährungen kann der Anteilwert in Euro durch Wechselkursänderungen belastet werden.
- ⚠ Kapitalverlust ist möglich.
- ⚠ Risiken, die für den Fonds von Bedeutung sein können, sind insb.: Kredit- und Kontrahenten-, Liquiditäts-, Verwahr-, Derivatrisiko sowie operationelle Risiken. Umfassende Informationen zu den Risiken des Fonds sind dem Prospekt bzw. den Informationen für Anleger gem. § 21 AIFMG, Abschnitt II, Kapitel „Risikohinweise“ zu entnehmen.

### WARNHINWEISE GEMÄSS INVFG 2011

Der ERSTE WWF STOCK ENVIRONMENT kann aufgrund der Zusammensetzung des Portfolios eine erhöhte Volatilität aufweisen, d.h. die Anteilswerte können auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt sein.

# WICHTIGE RECHTLICHE HINWEISE

## APPENDIX

Hierbei handelt es sich um eine Werbemitteilung. Sofern nicht anders angegeben, Datenquelle Erste Asset Management GmbH. Unsere Kommunikationssprachen sind Deutsch und Englisch.

Der Prospekt für OGAW-Fonds (sowie dessen allfällige Änderungen) wird entsprechend den Bestimmungen des InvFG 2011 idgF erstellt und im „Amtsblatt zur Wiener Zeitung“ veröffentlicht. Für die von der Erste Asset Management GmbH verwalteten Alternative Investment Fonds (AIF) werden entsprechend den Bestimmungen des AIFMG iVm InvFG 2011 „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“ erstellt.

Der Prospekt, die „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“ sowie das Basisinformationsblatt sind in der jeweils aktuell gültigen Fassung auf der Homepage [www.erste-am.com](http://www.erste-am.com) jeweils in der Rubrik Pflichtveröffentlichungen abrufbar und stehen dem/der interessierten Anleger:in kostenlos am Sitz der jeweiligen Verwaltungsgesellschaft sowie am Sitz der jeweiligen Depotbank zur Verfügung. Das genaue Datum der jeweils letzten Veröffentlichung des Prospekts, die Sprachen, in denen das Basisinformationsblatt erhältlich ist, sowie allfällige weitere Abholstellen der Dokumente, sind auf der Homepage [www.erste-am.com](http://www.erste-am.com) ersichtlich. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte ist in deutscher und englischer Sprache auf der Homepage [www.erste-am.com/investor-rights](http://www.erste-am.com/investor-rights) abrufbar sowie bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Die Verwaltungsgesellschaft kann beschließen, die Vorkehrungen, die sie für den Vertrieb von Anteilscheinen im Ausland getroffen hat, unter Berücksichtigung der regulatorischen Vorgaben wieder aufzuheben.

Umfassende Informationen zu den, mit der Veranlagung möglicherweise verbundenen Risiken sind dem Prospekt bzw. „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“ des jeweiligen Fonds zu entnehmen. Ist die Fondswährung eine andere Währung als die Heimatwährung des/der Anleger:in, so können Änderungen des entsprechenden Wechselkurses den Wert der Anlage sowie die Höhe der im Fonds anfallenden Kosten - umgerechnet in die Heimatwährung - positiv oder negativ beeinflussen.

Diese Unterlage dient als zusätzliche Information für unsere Anleger:innen und basiert auf dem Wissensstand der mit der Erstellung betrauten Personen zum Redaktionsschluss. Unsere Analysen und Schlussfolgerungen sind genereller Natur und berücksichtigen nicht die individuellen Bedürfnisse unserer Anleger:innen hinsichtlich des Ertrags, steuerlicher Situation oder Risikobereitschaft. Die Wertentwicklung der Vergangenheit lässt keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung eines Fonds zu. Bitte beachten Sie, dass eine Veranlagung in Wertpapieren neben den geschilderten Chancen auch Risiken birgt. Der Wert von Anteilen und deren Ertrag können sowohl steigen als auch fallen. Auch Wechselkursänderungen können den Wert einer Anlage sowohl positiv als auch negativ beeinflussen. Es besteht daher die Möglichkeit, dass Sie bei der Rückgabe Ihrer Anteile weniger als den ursprünglich angelegten Betrag zurückerhalten. Personen, die am Erwerb von Investmentfondsanteilen interessiert sind, sollten vor einer etwaigen Investition den/die aktuelle(n) Prospekt(e) bzw. die „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“, insbesondere die darin enthaltenen Risikohinweise, lesen.

Zu den Beschränkungen des Vertriebs des Fonds an amerikanische Staatsbürger entnehmen Sie die entsprechenden Hinweise dem Prospekt bzw. den „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“.

Der öffentliche Vertrieb von Anteilen der genannten Fonds in Deutschland wurde gemäß Deutsches Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht, Bonn, angezeigt. Zahl- und Informationsstelle in Deutschland ist HSBC Trinkaus & Burkhardt AG, Königsallee 21 - 23, D - 40212 Düsseldorf. Bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle können Rücknahmeanträge für Anteile am/an den Fonds eingereicht und die Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen sowie sonstige Zahlungen durch die deutsche Zahlstelle an die Anteilinhaber:innen auf deren Wunsch in bar in der Landeswährung ausgezahlt werden. Alle erforderlichen Informationen für die Anleger:innen vor und auch nach Vertragsabschluss - die Fondsbestimmungen, der Prospekt, die „Informationen für Anleger gemäß § 21 AIFMG“ bzw. das Basisinformationsblatt, die Jahres- und Halbjahresberichte - sind ebenfalls bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle kostenlos erhältlich. Die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile werden in Deutschland in elektronischer Form auf der Internetseite unter [www.erste-am.com](http://www.erste-am.com) (sowie zusätzlich unter [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com)) veröffentlicht. Etwaige sonstige Informationen an die Anteilinhaber:innen werden im „Bundesanzeiger“, Köln, veröffentlicht.

### Präsentationen:

In Präsentationen wird ausdrücklich keine Anlageberatung und auch keine Anlageempfehlung erteilt, sondern lediglich die aktuelle Marktmeinung wiedergegeben. Die Präsentationen stellen keine Vertriebsaktivität dar und dürfen somit nicht als Angebot zum Erwerb oder Verkauf von Finanz- oder Anlageinstrumenten verstanden werden. Alle Entscheidungen, die der/die Anleger:in möglicherweise aufgrund dieser Präsentation trifft, bleiben ausschließlich in seiner/ihrer Verantwortung. Druckfehler und Irrtümer vorbehalten.