

# Allianz Invest ESG Portfolio Blue

ISIN: AT0000A0HJB4 (A)

ISIN: AT0000A0HJC2 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

## Halbjahresbericht

vom 01.09.2022 – 28.02.2023

[www.allianzinvest.at](http://www.allianzinvest.at)



# Allgemeines zur Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Gesellschaft	Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH Hietzinger Kai 101-105, 1130 Wien Tel: 01/ 505 54 80; Fax: 01/ 505 54 81
Gründung	29. April 1991
Gesellschafter	Allianz Elementar Versicherungs AG
Aufsichtsrat	Mag. Rémi Vrignaud, Vorsitzender Dr. Kay Müller, stellvertretender Vorsitzender Mag. Susanne Althaler Wolfgang Jerabek (Mitarbeitervertreter) Mag. Daniel Planer (Mitarbeitervertreter)
Geschäftsführung	Mag. Sonja König Mag. Andreas Witzani
Prokuristen	Mag. Doris Kals (bis 30.09.2022) Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer Mag. Ivo Kreuzeder, LL.M. Michael Kocher Mag. Markus Reidlinger
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	MMag. Paul Schieder Mag. Christoph Kreutler
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Erste Group Bank AG

## Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 31.08.2022	per 28.02.2023
Fondsvolumen gesamt	29.477.203,09	33.591.354,51
errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	11,94	11,44
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	12,54	12,01
errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	13,17	12,72
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	13,83	13,36
<b>Ausschüttung/Auszahlung in EUR</b>		<b>per 02.11.2022</b>
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		0,0900
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,0000

## Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	171.259,143
Thesaurierungsanteile	2.485.999,061
<b>Gesamt umlaufende Anteile per 28.02.2023</b>	<b>2.657.258,204</b>

## Überblick über die ausgewiesenen Erträge und Fondsentwicklung der letzten Rechnungsjahre in EUR:

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.20	18.379.863,17	12,55	0,2000	87.895	4,58
30.11.20	19.632.313,70	13,04	0,0137	93.418	-
30.11.21	28.570.932,82	14,28	0,2500	118.073,16	9,62
31.08.22	29.477.203,09	11,94	0,0900	156.660,672	-14,83**)
28.02.23	33.591.354,51	11,44	-	171.259,143	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.20	13,66	0,54	0,0582	1.264.699	4,67
30.11.20	14,35	0,07	0,0151	1.283.665	-
30.11.21	15,72	1,20	0,2383	1.710.600,4	9,66
31.08.22	13,17	-0,8198	0,0000	2.095.938,5	-14,87**)
28.02.23	12,72	-	-	2.485.999,061	-

## **Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung**

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Investmentfonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Investmentfonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

- a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, welcher bei der letzten Preisberechnung vor dem Stichtag verwendet wurde.
- b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

## **Berechnung des Gesamtrisikos**

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

## **Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps**

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 wurden, insoweit sie laut Fondsbestimmungen zulässig sind, im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

# Vermögensaufstellung für den Allianz Invest ESG Portfolio Blue per 28. Februar 2023

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>									
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>									
AT0000824685		ALLIANZ INVEST RENTENFONDS-A	EUR	28.990	3.922		79,460000	2.303.545,40	6,86
AT0000A05H33		ALLIANZ INVEST EURORENT-T	EUR	13.262	2.913		120,810000	1.602.182,22	4,77
AT0000A0AZW1		ALLIANZ INVEST NACHALTIGKE-T	EUR	1.128		1.090	275,320000	310.560,96	0,92
DE000A2DTL86		ARAMEA RENDIT PL NACHALTIG-I	EUR	17.031	17.031		87,190000	1.484.932,89	4,42
DE000A3CNGA8		ARAMEA RENDIT GLB NACH-I EUR	EUR	13.314		9.279	91,920000	1.223.822,88	3,64
IE00B52VJ196		ISHARES MSCI EUROPE SRI	EUR	28.826	28.826		59,974900	1.728.836,47	5,15
IE00BYVTJH35		CROWN SIG LGT SUS EQ GLB-CEU	EUR	1.071			1.349,800000	1.445.635,80	4,30
LU0144509550		PICTET QUEST EU SUS EQ-IEUR	EUR	1.884		1.540	367,740000	692.822,16	2,06
LU0230817925		T. ROWE PRICE JAPANESE EQY-I	EUR	10.749	10.749		15,730000	169.081,77	0,50
LU0248062605		JPM-EUROPE HI YIELD BD-IA-CC	EUR	19.426	19.426	5.337	113,672000	2.208.192,27	6,57
LU0503630070		PICTET-GLOBAL SUST CREDIT-I	EUR	12.948	12.948		137,210000	1.776.595,08	5,29
LU0654138840		BNP EMERGING BD-IH EUR	EUR	23.309	23.309		90,550000	2.110.629,95	6,28
LU1240329547		INVESCO EURO EQ-Z A-CC EUR	EUR	45.180	45.180		15,320000	692.157,60	2,06
LU1291109616		BNP P ENERGY & METAL UCITS	EUR	92.090	92.090		14,024000	1.291.470,16	3,84
LU2483535543		BELLE SUSTAINABLE HC-U2 EUR	EUR	8.093		3.113	123,390000	998.595,27	2,97
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE US DOLLAR</b>									
IE00BF1XKT19		CI-COHO ESG US LARGE CE-USDI	USD	2.947	2.947		179,859800	499.619,97	1,49
IE00BYVJRP78		ISHARES MSCI EM SRI UCITS	USD	249.992	249.992		6,784200	1.598.638,63	4,76
IE00BYVJRR92		ISHARES SUST MSCI USA SRI	USD	118.631	129.882	11.251	12,113600	1.354.556,02	4,03
IE00BZ02LR44		X ESG MSCI WORLD	USD	68.152	50.142	152.692	29,684800	1.906.945,51	5,68
LU0205193807		SCHRODER IFL US SM & MC-C-AC	USD	1.710			474,921500	765.497,00	2,28
LU0230635905		NATIXIS HAR ASSC USEQF-SA USD	USD	5.599	5.599		219,540000	1.158.643,10	3,45
LU0234572450		GS EMRG MARKET EQTY IA	USD	26.136	26.136		19,650000	484.091,24	1,44
LU0248041781		JPMORGAN F-AMERICA EQTY-IA-CC	USD	3.211		1.808	351,770000	1.064.693,63	3,17
LU1321847714		BLACKROCK ST EMVK EQ ST-D2USD	USD	7.217	1.407		191,200000	1.300.679,05	3,87
LU1665235328		M&G LUX SUS G HY BF B-ULA	USD	182.892	182.892		10,842000	1.869.087,63	5,56
LU1917951649		T. ROWE PRICE EMKT DS EQ-I9	USD	46.241		38.086	11,210000	488.605,53	1,45
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE JAPANISCHE YEN</b>									
LU0270819245		SISF-JAPANESE OPPORT-C YEN-A	JPY	9.841	9.841		2.533,603000	172.571,89	0,51
LU0607514808		INVESCO JAPANESE EQ ADV-CA-Y	JPY	3.612		3.240	6.761,000000	169.025,00	0,50
<b>SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE</b>								<b>32.871.715,08</b>	<b>97,86</b>
<b>SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN</b>								<b>32.871.715,08</b>	<b>97,86</b>
<b>BANKGUTHABEN</b>									
EUR-Guthaben								711.287,80	2,12
GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WÄHRUNGEN									
USD								5.126,61	0,02
<b>SUMME BANKGUTHABEN</b>								<b>716.414,41</b>	<b>2,13</b>
<b>ABGRENZUNGEN</b>									
ZINSENANSPRÜCHE								3.225,02	0,01
<b>SUMME ABGRENZUNGEN</b>								<b>3.225,02</b>	<b>0,01</b>
<b>SUMME Fondsvermögen</b>								<b>33.591.354,51</b>	<b>100,00</b>
ERRECHNETER WERT 10050T01 Allianz Invest ESG Portfolio Blue (A)								EUR	11,44
ERRECHNETER WERT 10050T02 Allianz Invest ESG Portfolio Blue (T)								EUR	12,72
UMLAUFENDE ANTEILE 10050T01 Allianz Invest ESG Portfolio Blue (A)								STUECK	171.259,143
UMLAUFENDE ANTEILE 10050T02 Allianz Invest ESG Portfolio Blue (T)								STUECK	2.485.999,061

UMRECHNUNGSKURSE/DEISENKURSE						
VERMÖGENSWERTE IN FREMDER WÄHRUNG ZU DEN DEISEN/UMRECHNUNGSKURSEN DER LETZTEN PREISBERECHNUNG VOR DEM STICHTAG:						
WÄHRUNG			EINHEIT in EUR	KURS		
Euro			EUR	1 = EUR	1,000000	
Japanische Yen			JPY	1 = EUR	144,480000	
US Dollar			USD	1 = EUR	1,060900	
<b>WÄHREND DES BERICHTSZEBITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND</b>						
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
<b>DEISENTERMINGESCHÄFTE EURO</b>						
DTG005608		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	EUR	0		1.959.737
DTG006334		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	EUR	0	2.018.054	2.018.054
<b>DEISENTERMINGESCHÄFTE US DOLLAR</b>						
DTG005608		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	USD	0	2.000.000	
DTG006334		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	USD	0	2.000.000	2.000.000
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>						
AT0000A10KA3		ALLIANZ INVEST-A160	EUR	0		802
DE000A0Q4RZ9		ISHR EB.REXX GV DE 0-1Y EURD	EUR	0	60.646	60.646
IE00B14X4Q57		ISHARES EUR GOVT 1-3Y R	EUR	0		12.822
IE00BF1T6S03		BROWN ADV US SUST-B USD	USD	0		38.215
LU0242506524		GS EMRG MKT DEBT PT IAEH	EUR	0		51.329
LU0665631031		ALLIANZ EURO MICRO CAP-WE	EUR	0		99
LU0858068314		MSIF-GLOBAL ASS BCKD SEC-Z	USD	0		44.153
LU1001014080		JB MULTIPART-K GLD ETY-C USD	USD	0		5.777