

Allianz Invest ESG Defensiv

ISIN: AT0000657671 (A)

ISIN: AT0000657689 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Halbjahresbericht

vom 01.12.2021 – 31.05.2022

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 Martin Bruckner (bis 31.12.2021) Mag. Andreas Witzani (ab 01.01.2022)
Prokuristen	Mag. Doris Kals Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer Mag. Ivo Kreuzeder, LL.M. Michael Kocher Mag. Markus Reidlinger
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	Mag. Heidrun Zanetta Mag. Christoph Kreutler
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Erste Group Bank AG

Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 30.11.2021	per 31.05.2021
Fondsvolumen gesamt	32.249.667,90	29.439.757,25
errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	11,54	10,50
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	11,89	10,82
errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	17,26	15,80
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	17,78	16,27
Ausschüttung/Auszahlung in EUR		per 01.02.2022
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		0,1000
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,0401

Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	697.243,443
Thesaurierungsanteile	1.399.380,709
Gesamt umlaufende Anteile per 31.05.2022	2.096.624,152

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 %
14.09.19	31.680.311,49	11,71	0,1500	757.497	4,30
14.09.20	35.427.663,55	11,53	0,1000	706.526	-0,26
30.11.20	32.129.782,75	11,69	0,0027	691.295	-
30.11.21	32.249.667,90	11,54	0,1000	708.328,914	-1,26
31.05.22	29.439.757,25	10,50	-	697.243,443	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklun in %
14.09.19	17,14	-0,26	0,0000	1.330.874	4,22
14.09.20	17,10	0,04	0,0000	1.595.095	-0,23
30.11.20	17,50	0,25	0,0161	1.374.374	-
30.11.21	17,26	0,14	0,0401	1.394.844,796	-1,28
31.05.22	15,80	-	-	1.399.380,709	-

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

Wertpapierleihegeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden im Rechnungsjahr nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden deshalb nicht eingesetzt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) im Sinne der VO (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen laut Prospekt für den Fonds nicht eingesetzt werden. Total Return Swaps wurden deshalb nicht eingesetzt.

Vermögensaufstellung für den Allianz Invest ESG Defensiv per 31. Mai 2022

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
INVESTMENTZERTIFIKATE									
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO									
AT0000824685		ALLIANZ INVEST RENTENFONDS-A	EUR	50.893		7.609	85,300000	4.341.172,90	14,75
AT0000A05H33		ALLIANZ INVEST EURORENT-T	EUR	21.551	7.391		124,890000	2.691.504,39	9,14
AT0000A10KA3		ALLIANZ INVEST-AI60	EUR	2.147		617	1.067,920000	2.292.824,24	7,79
AT0000A1XFJ0		APOLLO NACHHALTIG NW WORL-A3	EUR	9.396			93,770000	881.062,92	2,99
DE000A2DTL86		ARAMEA RENDIT PL NACHHALTIG-I	EUR	29.793	9.681		90,870000	2.707.289,91	9,20
DE000A3CNGA8		ARAMEA RENDIT GLB NACH-I EUR	EUR	23.208	23.208		93,610000	2.172.500,88	7,38
IE0004931386		PIMCO-EURO BD-EINS ACC	EUR	19.721			23,670000	466.796,07	1,59
IE00B14X4Q57		ISHARES EUR GOVT 1-3YR	EUR	11.790	10.877	11.063	140,364900	1.654.902,17	5,62
LU0248062605		JPM-EUROPE HI YIELD BD-IACC	EUR	26.752	10.248		113,087000	3.025.303,42	10,28
LU0503630070		PICTET-GLOBAL SUST CREDIT-I	EUR	7.975			146,550000	1.168.736,25	3,97
LU0654138840		BNP EMERGING BD-IH EUR	EUR	8.730		5.758	91,140000	795.652,20	2,70
LU1033710234		ALLIANZ EM MRK SHRT DUR-IH2E	EUR	688			744,600000	512.284,80	1,74
LU1136108591		ALLIANZ EURO CREDIT SRI-W	EUR	1.144		1.766	984,570000	1.126.348,08	3,83
LU1505874849		ALLIANZ CREDIT OPPOR-IT13EUR	EUR	1.771	1.771		1.027,270000	1.819.295,17	6,18
INVESTMENTZERTIFIKATE US DOLLAR									
LU0503631128		PICTET-GLBL SUST CREDIT-IUSD	USD	4.452			219,530000	906.714,50	3,08
LU0858068314		MSIF-GLOBAL ASS BCKD SEC-Z	USD	17.457		2.564	35,110000	568.619,79	1,93
LU1665235328		M&G LUX SUS G HY BF B-ULA	USD	128.807			10,907800	1.303.461,36	4,43
SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE								28.434.469,05	96,59
SUMME WERTPAPIERVERMÖGEN								28.434.469,05	96,59
DEISENTERMINGESCHÄFTE									
DEISENTERMINGESCHÄFTE EURO									
DEISENTERMINGESCHÄFTE US DOLLAR									
DTG003508	0,0000	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 03.06.22	USD	-2.000.000			1,078023	-94.993,39	-0,32
SUMME DEISENTERMINGESCHÄFTE								-94.993,39	-0,32
BANKGUTHABEN									
EUR-Guthaben								1.056.093,59	3,59
GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WÄHRUNGEN									
JPY								39.880,48	0,14
CHF								4.307,52	0,01
SUMME BANKGUTHABEN								1.100.281,59	3,74
ZINSENANSPRÜCHE								0,00	0,00
SUMME Fondsvermögen								29.439.757,25	100,00

ERRECHNETER WERT 10017T01 Allianz Invest ESG Defensiv (A)	EUR	10,50
ERRECHNETER WERT 10017T02 Allianz Invest ESG Defensiv (T)	EUR	15,80
UMLAUFENDE ANTEILE 10017T01 Allianz Invest ESG Defensiv (A)	STUECK	697.243,443
UMLAUFENDE ANTEILE 10017T02 Allianz Invest ESG Defensiv (T)	STUECK	1.399.380,709

UMRECHNUNGSKURSE/DEISENKURSE

VERMÖGENSWERTE IN FREMDER WÄHRUNG ZU DEN DEISEN/UMRECHNUNGSKURSEN
DER LETZTEN PREISBERECHNUNG VOR DEM STICHTAG:

WÄHRUNG	EINHEIT in EUR	KURS
Schweizer Franken	CHF	1 = EUR 1,032060
Euro	EUR	1 = EUR 1,000000
Japanische Yen	JPY	1 = EUR 137,480000
US Dollar	USD	1 = EUR 1,077900

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge			
DEISENTERMINGESCHÄFTE EURO									
DTG002306		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 03.12.21	EUR	0		4.083.790			
DTG003507		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 03.12.21	EUR	0	4.423.604	4.423.604			
DEISENTERMINGESCHÄFTE US DOLLAR									
DTG002306		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 03.12.21	USD	0	5.000.000				
DTG003507		Devisentermingeschäft US Dollar Euro 03.12.21	USD	0	5.000.000	5.000.000			
INVESTMENTZERTIFIKATE									
IE00BYXVTY44		PIMCO GIS-GLB BD ESG-INSTA	USD	0		58.837			
LU0111549050		BNP EURO GOVERN BD-I	EUR	0		6.947			
LU1535992389		LUPUS ALPHA GL CONVTB BD-C H	EUR	0		7.487			