

Allianz European Pension

Investments

Auszugsbericht für die Schweiz
Anlagefonds luxemburgischen Rechts
Investmentgesellschaft mit variablem Kapital

R.C.S. Luxembourg No. B117.986

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2022

Allianz Global Investors GmbH

Allgemeine Informationen

Allianz European Pension Investments (die „Gesellschaft“) wurde als eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach luxemburgischem Recht gegründet. Die Gesellschaft wurde durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier als eine „Société d'Investissement à Capital Variable“ (SICAV) zugelassen und fällt in den Geltungsbereich von Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen. Die Gesellschaft wurde am 21. Juli 2006 gegründet.

Die Gesellschaft hat verschiedene Teilfonds (die „Teilfonds“) aufgelegt, die Aktien in mehreren Klassen ausgegeben haben. Für jeden Teilfonds werden ein separater Vermögensbestand sowie eine separate Buchhaltung geführt.

Die nachfolgenden Teilfonds standen am 30. September 2022 für Zeichnungen und Rücknahmen zur Verfügung:

- Allianz Strategy 50

Die in diesem Bericht enthaltenen Angaben beziehen sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022. Sie sollten nicht unbedingt als Hinweis auf die künftige Performance der Teilfonds angesehen werden.

Dieser Bericht stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der Teilfonds dar. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie aufgrund des aktuellen Verkaufspro-

pekts, der Satzung und der wesentlichen Anlegerinformationen, ergänzt durch den jüngsten vorliegenden geprüften Jahresbericht, getätigt werden. Liegt die Veröffentlichung des letzten Jahresberichts mehr als acht Monate zurück, muss darüber hinaus der jüngste Halbjahresbericht zur Verfügung gestellt werden.

Der Prospekt, die Satzung, das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen sowie die jeweiligen Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, bei den Vertriebsstellen, den Zahlstellen und den Informationsstellen erhältlich.

Einige während des Berichtszeitraums durchgeführte Transaktionen erscheinen nicht mehr im Anlageportfolio. Eine Aufstellung der Änderungen des Bestands ist auf Anfrage kostenlos beim eingetragenen Sitz der Gesellschaft in Luxemburg erhältlich.

Wichtige Mitteilung an unsere Anleger

Der russische Einmarsch in die Ukraine hat im Jahr 2022 zu erheblicher Volatilität und Unsicherheit auf den internationalen Kapitalmärkten geführt. Aufgrund dieser Situation sind allgemeine Prognosen über die Entwicklung der Kapitalmärkte und zukünftige Auswirkungen nur sehr eingeschränkt möglich. Zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresberichts ist es daher nicht möglich, die direkten Auswirkungen der russischen Invasion auf den Fonds abschließend zu bewerten.

Die Wirtschaftssanktionen gegen die Russische Föderation, die separatistischen Regionen Donezker Volksrepublik und Luhansker Volksrepublik sowie Weißrussland unterliegen einer ständigen Entwicklung. AllianzGI hält sich an alle relevanten gegenwärtigen und beabsichtigt die Einhaltung aller relevanten zukünftigen Sanktionen, insbesondere einschließlich, der von der EU, Japan, Singapur, Südkorea, der Schweiz, dem Vereinigten Königreich und den USA verhängten Sanktionen. Alle Transaktionen von AllianzGI mit seinen Kontrahenten, entsprechen den Verpflichtungen von AllianzGI im Rahmen der jeweiligen Sanktionen. AllianzGI verfügt über ein global koordiniertes Wirtschaftssanktionsteam aus den Bereichen Recht, Compliance und Risiko, das Wirtschaftssanktionen überwacht und deren Umsetzung koordiniert. Dieses Team beobachtet die aktuelle Situation aktiv und arbeitet mit den betroffenen Abteilungen, einschließlich Portfoliomanagement, Handel und Operations, zusammen, um entsprechende Maßnahmen zu ergreifen und eine zeitnahe Umsetzung sicherzustellen. Insbesondere koordiniert das Team die Umsetzung der multijurisdiktionalen Sanktionen gegen die Russische Föderation, die separatistischen Regionen der Volksrepublik Donezk und der Volksrepublik Luhansk sowie gegen Belarus.

Zum 30. September 2022 hat der Fonds keine direkten Investitionen in Russland, der Ukraine oder Weißrussland. Die hierin enthaltenen Aussagen entsprechen dem Stand zum angegebenen Datum und können sich ändern.

AllianzGI verfügt über Richtlinien, Verfahren und Systeme, um neue und bestehende Anleger anhand der geltenden Sanktionslisten zu überprüfen. Im Hinblick auf Artikel 5f der Verordnung (EU) Nr. 833/2014 und Artikel 1y der Verordnung (EG) Nr. 765/2006 hat AllianzGI beschlossen, nach dem 12. April 2022 keine Fondsanteile oder Wertpapiere mehr an russische und belarussische Staatsangehörige zu verkaufen. In diesem Zusammenhang hat AllianzGI ihre Vertriebspartner, Fondsplattformen und Dienstleister wie Transferstellen angewiesen, den Vertrieb von Fondsanteilen an russische und belarussische Staatsangehörige einzustellen. Soweit russische oder belarussische Staatsangehörige vor dem 12. April 2022 Anteile an Fonds halten, hat AllianzGI ihre Dienstleister angewiesen, das Konto des Anlegers für Zeichnungen und andere Transaktionen, bei denen es sich um einen Verkauf von Fondsanteilen handeln würde, zu sperren.

Diese Seite ist absichtlich unbeschrieben.

Inhalt

| | | |
|---|----|---|
| Wertentwicklung der Teilfonds | 2 | |
| | | |
| Anlagepolitik und Teilfondsvermögen | | |
| Allianz Strategy 50 | 4 | |
| | | |
| Kombinierte Finanzaufstellungen der Gesellschaft | | 6 |
| Ertrags- und Aufwandsrechnung | | |
| Zusammensetzung des Fondsvermögens | | |
| Entwicklung des Fondsvermögens | 7 | |
| | | |
| Finanzaufstellungen der Teilfonds | | |
| Vermögensaufstellungen | | |
| Ertrags- und Aufwandsrechnungen | | |
| Zusammensetzung der Teilfondsvermögen | | |
| Entwicklung der Teilfondsvermögen | | |
| Entwicklung der Aktien im Umlauf | | |
| Allianz Strategy 50 | 8 | |
| | | |
| Anhang | 19 | |
| | | |
| Prüfungsvermerk | 24 | |
| | | |
| Weitere Informationen (ungeprüft) | 27 | |
| | | |
| Hinweis für Anleger in der Schweiz (ungeprüft) | 33 | |
| | | |
| Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) | 35 | |
| | | |
| Artikel 173 des französischen Gesetzes zur Energiewende: Portfolio-Berichterstattung in Bezug auf Umwelt, Soziales, Unternehmensführung und Klima-Risiken | 39 | |
| | | |
| Ihre Partner | 40 | |

Wertentwicklung der Teilfonds

Wertentwicklung in Prozent

| Name des Teilfonds | Aktienklasse | Tag der Auflage | Erstausgabepreis |
|---------------------|----------------------------|-----------------|------------------|
| Allianz Strategy 50 | A (EUR) (ausschüttend) | 09.12.2013 | 100,00 |
| | CT (EUR) (thesaurierend) | 01.07.2008 | 100,00 |
| | C2 (EUR) (ausschüttend) | 18.10.2019 | 100,00 |
| | IT (EUR) (thesaurierend) | 14.06.2013 | 1.000,00 |
| | NT (EUR) (thesaurierend) | 04.10.2010 | 1.000,00 |
| | P (EUR) (ausschüttend) | 15.06.2016 | 1.000,00 |
| | PT (EUR) (thesaurierend) | 18.08.2015 | 1.000,00 |
| | RT (EUR) (thesaurierend) | 12.10.2017 | 100,00 |
| | WT (EUR) (thesaurierend) | 27.04.2017 | 1.000,00 |
| | AT (H-USD) (thesaurierend) | 09.03.2020 | 100,00 |
| | PT (USD) (thesaurierend) | 20.08.2015 | 1.000,00 |
| | RT (H-USD) (thesaurierend) | 09.03.2020 | 100,00 |

¹⁾ Berechnungsbasis: Aktienwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt), etwaige Ausschüttungen reinvestiert.

Die Performance wird nach der vom deutschen BVI (Bundesverband Investment und Asset Management e.V.) empfohlenen Methode berechnet.

²⁾ Für den Zeitraum vom 09. März 2020 bis 28. Juni 2022 (Tag der Auflösung).

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Aktien erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

| 1 Jahr (30.09.2021- 30.09.2022) % ¹⁾ | 2 Jahre (30.09.2020- 30.09.2022) % ¹⁾ | 3 Jahre (30.09.2019- 30.09.2022) % ¹⁾ | 5 Jahre (30.09.2017- 30.09.2022) % ¹⁾ | 10 Jahre (30.09.2012- 30.09.2022) % ¹⁾ | seit Auflage (Tag der Auflage - 30.09.2022) % ¹⁾ |
|--|---|---|---|--|--|
| -14,32 | -3,30 | -6,49 | 1,69 | - | 36,36 |
| -14,32 | -3,29 | -6,48 | 1,70 | 56,97 | 92,24 |
| -13,89 | -2,34 | - | - | - | -4,63 |
| -14,32 | -3,29 | -6,48 | 1,70 | - | 44,37 |
| -13,54 | -1,53 | -3,92 | 6,39 | 71,72 | 99,00 |
| -13,73 | -1,94 | -4,52 | 5,30 | - | 19,30 |
| -13,72 | -1,93 | -4,50 | 5,32 | - | 16,19 |
| -13,72 | -1,91 | -4,48 | - | - | 4,12 |
| -13,51 | -1,46 | -3,81 | 6,58 | - | 10,22 |
| -13,07 | -1,11 | - | - | - | -0,62 |
| -26,99 | -17,80 | -14,28 | -12,06 | - | 3,90 |
| -9,68 ²⁾ | 3,54 | - | - | - | - |

Allianz Strategy 50

Der Teilfonds engagiert sich in variablem Umfang am internationalen Aktienmarkt bzw. am Markt für Euro-Anleihen. Im Rahmen eines quantitativen Ansatzes senkt das Fondsmanagement das Aktienengagement in Phasen hoher Marktschwankungsintensität (Volatilität) und erhöht es in Phasen niedriger Volatilität. Insgesamt wird ein Ergebnis angestrebt, das mit der Rendite eines Mischportfolios aus 50 % internationalen Aktien und 50 % mittelfristigen EUR-Anleihen vergleichbar ist.

Im Berichtszeitraum gingen die Kurse an den internationalen Börsen in den meisten Regionen und Sektoren stark zurück. In den USA belastete neben dem Ukraine Konflikt vor allem die angesichts hoher Inflation restriktive Geldpolitik der Notenbank die Stimmung. In Europa sorgte zudem die sich abzeichnende Energiekrise für eine zunehmende Risikoscheu der Anleger. Erhebliche Kurseinbußen waren insgesamt auch in den Schwellenländern zu verzeichnen, die unter Kapitalabflüssen ausländischer Anleger litten. Am Euro-Anleihenmarkt kam es angesichts beschleunigter Geldentwertung und strafferer Geldpolitik sektorübergreifend zu einem Zinsanstieg. Dieser ging mit entsprechenden Kursrückgängen einher, welche bei längeren Laufzeiten besonders hoch ausfielen.

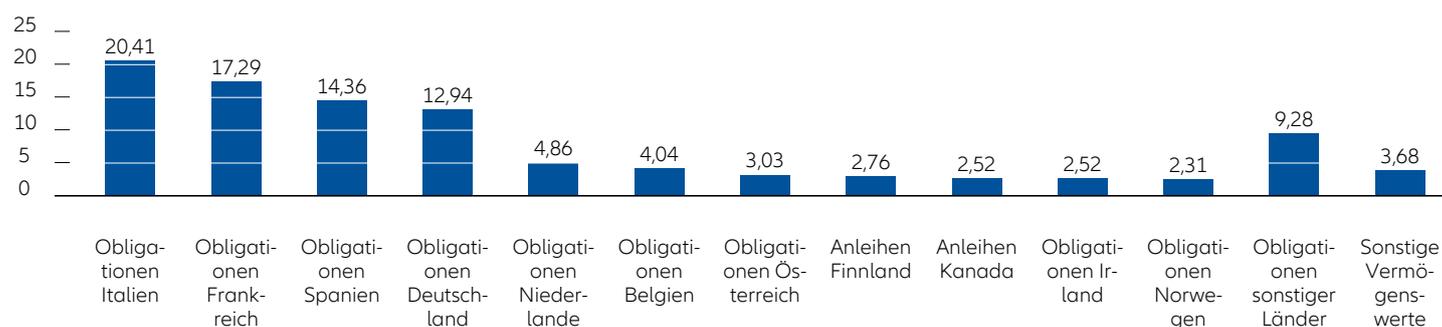
Die Wertpapierbestände des Teilfonds konzentrierten sich weiterhin auf Euro-Staatsanleihen. Dabei handelte es sich zum einen um Schuldverschreibungen von Ländern hoher Bonität wie Frankreich und Deutschland. Zum anderen bestanden in erheblichem Umfang Positionen in höher verzinsten öffentlich-rechtlichen Papieren aus Euro-Peripheriestaaten, vor allem

aus Italien und Spanien. Im Wesentlichen beibehalten wurde die Beimischung von Unternehmensanleihen und gedeckten Papieren. Im Schnitt verfügten die verzinslichen Anlagen am Berichtsstichtag über eine Bonitätsnote von AA-. Die Duration (mittlere Kapitalbindungsdauer) der Anleihenengagements einschließlich Derivaten wurde deutlich auf zuletzt etwas mehr als zweieinhalb Jahre gesenkt. Die Aktienbeimischung des Teilfonds wurde über Derivate auf gängige Börsenindizes realisiert. Dies erlaubte eine rasche Anpassung der Aktienquote an die Volatilität. Die Liquidität ging per saldo etwas zurück und lag am Berichtsstichtag auf moderatem Niveau.

Mit seiner Anlagestruktur gab der Teilfonds im gegebenen sehr ungünstigen Umfeld stark im Wert nach.

Das genaue Ergebnis im Berichtszeitraum ist in der Tabelle „Wertentwicklung der Teilfonds“ auf den Seiten 2 und 3 ausgewiesen. Weitergehende Informationen über den Fonds finden sich im Verkaufsprospekt sowie in den Wesentlichen Anlegerinformationen.

Struktur des Teilfondsvermögens in %



Der Teilfonds in Zahlen

| | | 30.09.2022 | 30.09.2021 | 30.09.2020 |
|-------------------------------------|---------------------------------|------------|------------|------------|
| Teilfondsvermögen in Mio. EUR | | 2.639,0 | 3.786,8 | 3.928,2 |
| Aktienumlauf in Stück | | | | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | WKN: A1W 8XH/ISIN: LU0995865168 | 108.189 | 125.512 | 138.399 |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAA/ISIN: LU0352312184 | 5.799.660 | 6.222.732 | 6.495.177 |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | WKN: A2P S88/ISIN: LU2064238384 | 17.286 | 3.580 | 646 |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAC/ISIN: LU0352312341 | 795.751 | 835.318 | 867.324 |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A1C XU3/ISIN: LU0535372949 | 46.500 | 56.613 | 172.914 |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | WKN: A2A H7P/ISIN: LU1405890556 | 2.078 | 6.322 | 7.856 |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A14 VR6/ISIN: LU1250163679 | 8.521 | 4.462 | 3.352 |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A2D WPS/ISIN: LU1673099179 | 19.228 | 32.136 | 66.601 |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAE/ISIN: LU0352312697 | 213.158 | 616.070 | 813.821 |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | WKN: A2P YKA/ISIN: LU2105731942 | 1.457 | 1.596 | 115 |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | WKN: A14 VR7/ISIN: LU1250163752 | 16.445 | 23.946 | 39.931 |
| - Klasse RT (H-USD) (thesaurierend) | WKN: A2P YKB/ISIN: LU2105732080 | -- | 115 | 115 |
| Aktienwert in EUR | | | | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | WKN: A1W 8XH/ISIN: LU0995865168 | 132,76 | 154,95 | 137,48 |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAA/ISIN: LU0352312184 | 192,24 | 224,36 | 198,78 |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | WKN: A2P S88/ISIN: LU2064238384 | 94,37 | 110,06 | 97,65 |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAC/ISIN: LU0352312341 | 1.443,66 | 1.684,90 | 1.492,77 |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A1C XU3/ISIN: LU0535372949 | 1.989,99 | 2.301,65 | 2.020,94 |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | WKN: A2A H7P/ISIN: LU1405890556 | 1.151,04 | 1.342,52 | 1.190,91 |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A14 VR6/ISIN: LU1250163679 | 1.161,87 | 1.346,57 | 1.184,71 |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A2D WPS/ISIN: LU1673099179 | 104,12 | 120,67 | 106,15 |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | WKN: A0N GAE/ISIN: LU0352312697 | 1.102,24 | 1.274,42 | 1.118,54 |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | WKN: A2P YKA/ISIN: LU2105731942 | 99,38 | 114,32 | 100,50 |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | WKN: A14 VR7/ISIN: LU1250163752 | 1.038,97 | 1.422,99 | 1.264,03 |
| - Klasse RT (H-USD) (thesaurierend) | WKN: A2P YKB/ISIN: LU2105732080 | -- | 115,65 | 100,89 |

Weitere Informationen über Auflegungs- und Auflösungsstermine finden Sie in den Tabellen zur Wertentwicklung auf den Seiten 2 bis 3.

Kombinierte Finanzaufstellungen der Gesellschaft

Ertrags- und Aufwandsrechnung

| für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 30.09.2022 | KOMBINIERT |
|---|------------------------|
| | EUR |
| Zinsen aus | |
| - Anleihen | 68.119.971,91 |
| - Swapgeschäften | 608.301,67 |
| Guthabenzinsen | |
| - positiver Zinssatz | 379.919,44 |
| - negativer Zinssatz | -1.362.407,83 |
| Dividenden | 12.922.887,20 |
| Sonstige Erträge | 23.534,08 |
| Summe der Erträge | 80.692.206,47 |
| Zinsaufwand aus | |
| - Swapgeschäften | -12.919.130,87 |
| Taxe d'Abonnement | -1.382.675,07 |
| Pauschalvergütung | -57.122.622,77 |
| Summe der Aufwendungen | -71.424.428,71 |
| Nettoertrag/-verlust | 9.267.777,76 |
| Realisierte Gewinne/Verluste aus | |
| - Wertpapiergeschäften | -178.893.555,52 |
| - Finanztermingeschäften | -203.278.284,79 |
| - Devisentermingeschäften | 314.599,94 |
| - Devisen | 4.084.280,43 |
| - Swapgeschäften | -11.212.786,80 |
| Nettogewinn/-verlust | -379.717.968,98 |
| Veränderungen der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus | |
| - Wertpapiergeschäften | -347.104.440,22 |
| - Finanztermingeschäften | -38.723.333,19 |
| - Devisentermingeschäften | 35.834,77 |
| - Devisen | -709.503,97 |
| - Swapgeschäften | 46.178.177,95 |
| Betriebsergebnis | -720.041.233,64 |

Zusammensetzung des Fondsvermögens

| zum 30.09.2022 | KOMBINIERT |
|--|-------------------------|
| | EUR |
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | |
| (Anschaffungspreis EUR 4,310,669,962.82) | 3.948.854.137,33 |
| Bankguthaben | 248.509.692,13 |
| Zinsansprüche aus | |
| - Anleihen | 27.266.994,34 |
| - Swapgeschäften | 523,17 |
| Dividendenansprüche | 193.784,70 |
| Forderungen aus | |
| - Verkauf von Fondsanteilen | 145.507,54 |
| Nicht realisierter Gewinn aus | |
| - Futuresgeschäften | 11.520.160,00 |
| - Swapgeschäften | 101.880.858,51 |
| - Devisentermingeschäften | 74.302,91 |
| Gesamtvermögen | 4.338.445.960,63 |
| Bankverbindlichkeiten | -1.493.037,78 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | -193.222,77 |
| Verbindlichkeiten aus | |
| - Rücknahme von Fondsanteilen | -1.399.272,65 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | -4.241.296,04 |
| Nicht realisierter Verlust aus | |
| - Futuresgeschäften | -108.729.113,48 |
| - Swapgeschäften | -54.706.091,13 |
| - Devisentermingeschäften | -2.048,43 |
| Gesamtverbindlichkeiten | -170.764.082,28 |
| Fondsvermögen | 4.167.681.878,35 |

Die Finanzaufstellungen der Teilfonds, die im englischen Originaldokument auf den Seiten 24 – 71 dargelegt sind, ergeben zusammen die oben aufgeführten Finanzaufstellungen der Gesellschaft.

Die Erläuterungen zu den Finanzaufstellungen stellen einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Entwicklung des Fondsvermögens

| für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 30.09.2022 | | KOMBINIERT |
|--|-------------------------|------------|
| | | EUR |
| Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | 5.815.859.307,60 | |
| Mittelzuflüsse | 1.143.799.011,54 | |
| Mittelrückflüsse | -2.071.652.176,15 | |
| Ausschüttung | -283.031,00 | |
| Betriebsergebnis | -720.041.233,64 | |
| Vermögen am Ende des Berichtszeitraums | 4.167.681.878,35 | |

Allianz Strategy 50

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen | |
|--|---------------------|---|-----------------------|------------|-------------------------|---------------------------------------|------|
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind | | | | | 2.542.021.292,12 | 96,32 | |
| Obligationen | | | | | 2.542.021.292,12 | 96,32 | |
| Australien | | | | | 37.109.757,23 | 1,41 | |
| XS1916387431 | 0,2500 % | Australia & New Zealand Banking Group EUR MTN 18/22 | EUR | 3.600,0 % | 99,881 | 3.595.709,52 | 0,14 |
| XS0864360358 | 1,8750 % | National Australia Bank EUR MTN 12/23 | EUR | 10.000,0 % | 100,196 | 10.019.598,00 | 0,38 |
| XS1321466911 | 0,8750 % | National Australia Bank EUR MTN 15/22 | EUR | 17.700,0 % | 99,963 | 17.693.516,49 | 0,67 |
| XS0903136736 | 2,5000 % | Telstra EUR MTN 13/23 | EUR | 5.800,0 % | 100,016 | 5.800.933,22 | 0,22 |
| Österreich | | | | | 80.059.767,65 | 3,03 | |
| AT0000A04967 | 4,1500 % | Austria Government EUR Bonds 07/37 | EUR | 2.300,0 % | 113,927 | 2.620.317,09 | 0,10 |
| AT0000A0DXC2 | 4,8500 % | Austria Government EUR Bonds 09/26 | EUR | 7.400,0 % | 109,466 | 8.100.469,20 | 0,31 |
| AT0000A0U3T4 | 3,4000 % | Austria Government EUR Bonds 12/22 | EUR | 8.350,0 % | 100,353 | 8.379.462,98 | 0,32 |
| AT0000A0VRQ6 | 3,1500 % | Austria Government EUR Bonds 12/44 | EUR | 2.850,0 % | 105,138 | 2.996.444,69 | 0,11 |
| AT0000A0U299 | 3,8000 % | Austria Government EUR Bonds 12/62 | EUR | 2.000,0 % | 120,950 | 2.418.991,80 | 0,09 |
| AT0000A105W3 | 1,7500 % | Austria Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 2.000,0 % | 100,233 | 5.800.650,00 | 0,08 |
| AT0000A10683 | 2,4000 % | Austria Government EUR Bonds 13/34 | EUR | 2.500,0 % | 95,465 | 2.386.614,50 | 0,09 |
| AT0000A185T1 | 1,6500 % | Austria Government EUR Bonds 14/24 S.1 | EUR | 3.530,0 % | 99,619 | 3.516.551,76 | 0,13 |
| AT0000A1K9F1 | 1,5000 % | Austria Government EUR Bonds 16/47 | EUR | 1.500,0 % | 75,202 | 1.128.035,10 | 0,04 |
| AT0000A1VGK0 | 0,5000 % | Austria Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 3.500,0 % | 92,340 | 3.231.912,60 | 0,12 |
| AT0000A1ZGE4 | 0,7500 % | Austria Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 3.000,0 % | 91,534 | 2.746.031,40 | 0,10 |
| AT0000A269M8 | 0,5000 % | Austria Government EUR Bonds 19/29 | EUR | 2.500,0 % | 87,933 | 2.198.313,25 | 0,08 |
| AT0000A2HLC4 | 0,8500 % | Austria Government EUR Bonds 20/20 | EUR | 1.000,0 % | 43,213 | 432.125,10 | 0,02 |
| AT0000A2WSC8 | 0,9000 % | Austria Government EUR Bonds 22/32 | EUR | 1.300,0 % | 84,565 | 1.099.350,33 | 0,04 |
| AT0000A1PE50 | 0,0000 % | Austria Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.07.2023 | EUR | 32.800,0 % | 98,852 | 32.423.495,36 | 1,23 |
| AT0000A2CQD2 | 0,0000 % | Austria Government EUR Zero-Coupon Bonds 20.02.2030 | EUR | 1.400,0 % | 82,759 | 1.158.627,12 | 0,04 |
| AT0000A2NW83 | 0,0000 % | Austria Government EUR Zero-Coupon Bonds 20.02.2031 | EUR | 3.500,0 % | 80,143 | 2.804.990,30 | 0,11 |
| AT0000A2KQ43 | 0,0000 % | Austria Government EUR Zero-Coupon Bonds 20.10.2040 | EUR | 700,0 % | 59,055 | 413.385,07 | 0,02 |
| Belgien | | | | | 106.719.856,69 | 4,04 | |
| BE0000320292 | 4,2500 % | Belgium Government EUR Bonds 10/41 S.60 | EUR | 4.000,0 % | 114,140 | 4.565.588,00 | 0,17 |
| BE0000324336 | 4,5000 % | Belgium Government EUR Bonds 11/26 S.64 | EUR | 2.300,0 % | 108,132 | 2.487.033,01 | 0,09 |
| BE0000326356 | 4,0000 % | Belgium Government EUR Bonds 12/32 S.66 | EUR | 3.000,0 % | 110,982 | 3.329.456,40 | 0,13 |
| BE0000328378 | 2,2500 % | Belgium Government EUR Bonds 13/23 S.68 | EUR | 40.000,0 % | 100,486 | 40.194.200,00 | 1,52 |
| BE0000331406 | 3,7500 % | Belgium Government EUR Bonds 13/45 S.71 | EUR | 700,0 % | 109,903 | 769.318,69 | 0,03 |
| BE0000332412 | 2,6000 % | Belgium Government EUR Bonds 14/24 S.72 | EUR | 8.050,0 % | 101,357 | 8.159.252,19 | 0,31 |
| BE0000333428 | 3,0000 % | Belgium Government EUR Bonds 14/34 S.73 | EUR | 1.900,0 % | 100,852 | 1.916.184,77 | 0,07 |
| BE0000334434 | 0,8000 % | Belgium Government EUR Bonds 15/25 S.74 | EUR | 4.550,0 % | 97,069 | 4.416.616,75 | 0,17 |
| BE0000335449 | 1,0000 % | Belgium Government EUR Bonds 15/31 S.75 | EUR | 4.300,0 % | 87,880 | 3.778.825,81 | 0,14 |
| BE0000336454 | 1,9000 % | Belgium Government EUR Bonds 15/38 S.76 | EUR | 1.000,0 % | 85,106 | 851.060,00 | 0,03 |
| BE0000338476 | 1,6000 % | Belgium Government EUR Bonds 16/47 S.78 | EUR | 3.000,0 % | 74,755 | 2.242.655,10 | 0,09 |
| BE0000340498 | 2,1500 % | Belgium Government EUR Bonds 16/66 S.80 | EUR | 1.000,0 % | 82,152 | 821.517,50 | 0,03 |
| BE0000341504 | 0,8000 % | Belgium Government EUR Bonds 17/27 S.81 | EUR | 5.000,0 % | 93,627 | 4.681.360,00 | 0,18 |
| BE0000344532 | 1,4500 % | Belgium Government EUR Bonds 17/37 S.84 | EUR | 4.400,0 % | 80,398 | 3.537.512,00 | 0,13 |
| BE0000343526 | 2,2500 % | Belgium Government EUR Bonds 17/57 S.83 | EUR | 3.300,0 % | 84,524 | 2.789.302,89 | 0,11 |
| BE0000345547 | 0,8000 % | Belgium Government EUR Bonds 18/28 S.85 | EUR | 5.600,0 % | 91,853 | 5.143.740,00 | 0,19 |
| BE0000346552 | 1,2500 % | Belgium Government EUR Bonds 18/33 S.86 | EUR | 2.000,0 % | 86,650 | 1.732.990,80 | 0,07 |
| BE0000347568 | 0,9000 % | Belgium Government EUR Bonds 19/29 S.87 | EUR | 2.000,0 % | 90,630 | 1.812.595,00 | 0,07 |
| BE0000348574 | 1,7000 % | Belgium Government EUR Bonds 19/50 S.88 | EUR | 2.000,0 % | 74,372 | 1.487.438,00 | 0,06 |
| BE0000349580 | 0,1000 % | Belgium Government EUR Bonds 20/30 | EUR | 500,0 % | 83,592 | 417.961,65 | 0,02 |
| BE0000291972 | 5,5000 % | Belgium Government EUR Bonds 98/28 S.31 | EUR | 2.500,0 % | 116,606 | 2.915.150,00 | 0,11 |
| BE0000352618 | 0,0000 % | Belgium Government EUR Zero-Coupon Bonds 22.10.2031 | EUR | 2.500,0 % | 78,894 | 1.972.350,00 | 0,07 |
| BE0002420926 | 2,7500 % | FLUVIUS System Operator EUR MTN 12/22 | EUR | 6.700,0 % | 99,966 | 6.697.748,13 | 0,25 |
| Kanada | | | | | 66.634.956,67 | 2,52 | |
| XS1706963284 | 0,2000 % | Bank of Montreal EUR Notes 17/23 | EUR | 10.000,0 % | 99,661 | 9.966.077,00 | 0,38 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|---------------------|---|--|-----------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| XS1377941106 | 0,3750 % Bank of Nova Scotia EUR MTN 16/23 | EUR | 13.400,0 | % 99,461 | 13.327.811,52 | 0,50 |
| XS1756725831 | 0,2500 % Canadian Imperial Bank of Commerce EUR MTN 18/23 | EUR | 24.100,0 | % 99,668 | 24.020.091,63 | 0,91 |
| XS1859275718 | 0,2500 % National Bank of Canada EUR MTN 18/23 | EUR | 5.650,0 | % 98,446 | 5.562.201,26 | 0,21 |
| XS1790069790 | 0,2500 % Toronto-Dominion Bank EUR MTN 18/23 | EUR | 13.800,0 | % 99,701 | 13.758.775,26 | 0,52 |
| Kaimaninseln | | | | | 6.768.604,40 | 0,26 |
| XS1391085740 | 1,2500 % CK Hutchison Finance 16 EUR Notes 16/23 | EUR | 6.800,0 | % 99,538 | 6.768.604,40 | 0,26 |
| Dänemark | | | | | 15.859.613,10 | 0,60 |
| XS1677902162 | 0,5000 % Carlsberg Breweries EUR MTN 17/23 | EUR | 5.000,0 | % 97,956 | 4.897.799,50 | 0,18 |
| DK0030407986 | 0,2500 % Danske Bank EUR MTN 17/22 | EUR | 3.400,0 | % 99,860 | 3.395.253,60 | 0,13 |
| DK0009525917 | 0,2500 % Nykredit Realkredit EUR MTN 19/23 | EUR | 7.600,0 | % 99,560 | 7.566.560,00 | 0,29 |
| Finnland | | | | | 72.881.764,20 | 2,76 |
| FI400006176 | 4,0000 % Finland Government EUR Bonds 09/25 | EUR | 1.000,0 | % 105,480 | 1.054.800,00 | 0,04 |
| FI4000037635 | 2,7500 % Finland Government EUR Bonds 12/28 | EUR | 2.000,0 | % 101,843 | 2.036.853,40 | 0,08 |
| FI4000046545 | 2,6250 % Finland Government EUR Bonds 12/42 | EUR | 2.300,0 | % 96,367 | 2.216.441,00 | 0,08 |
| FI4000062625 | 1,5000 % Finland Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 20.950,0 | % 100,180 | 20.987.710,00 | 0,79 |
| FI4000079041 | 2,0000 % Finland Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 5.000,0 | % 100,399 | 5.019.925,00 | 0,19 |
| FI4000167317 | 0,8750 % Finland Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 500,0 | % 96,410 | 482.050,00 | 0,02 |
| FI4000197959 | 0,5000 % Finland Government EUR Bonds 16/26 | EUR | 1.800,0 | % 94,620 | 1.703.160,00 | 0,06 |
| FI4000278551 | 0,5000 % Finland Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 500,0 | % 91,580 | 457.901,65 | 0,02 |
| FI4000306758 | 1,1250 % Finland Government EUR Bonds 18/34 | EUR | 950,0 | % 83,452 | 792.789,25 | 0,03 |
| FI4000440557 | 0,2500 % Finland Government EUR Bonds 20/40 | EUR | 100,0 | % 63,945 | 63.944,75 | 0,00 |
| FI4000480488 | 0,1250 % Finland Government EUR Bonds 21/52 | EUR | 2.000,0 | % 48,431 | 968.613,40 | 0,04 |
| FI4000219787 | 0,0000 % Finland Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.09.2023 | EUR | 35.150,0 | % 98,346 | 34.568.619,00 | 1,31 |
| FI4000441878 | 0,0000 % Finland Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.09.2030 | EUR | 3.100,0 | % 81,579 | 2.528.956,75 | 0,10 |
| Frankreich | | | | | 456.202.604,99 | 17,29 |
| FR0011011188 | 4,3000 % Caisse de Refinancement de l'Habitat EUR MTN 11/23 | EUR | 9.700,0 | % 101,065 | 9.803.297,24 | 0,37 |
| FR0013019510 | 0,6250 % Caisse Française de Financement Local EUR Notes 15/23 S.12 | EUR | 10.700,0 | % 99,780 | 10.676.486,75 | 0,41 |
| FR0013231081 | 0,3250 % Compagnie de Financement Foncier EUR MTN 17/23 | EUR | 13.000,0 | % 98,235 | 12.770.590,30 | 0,48 |
| FR0013328218 | 0,2500 % Compagnie de Financement Foncier EUR Notes 18/23 | EUR | 4.700,0 | % 99,223 | 4.663.482,88 | 0,18 |
| FR0012332450 | 0,6250 % Crédit Agricole Home Loan EUR MTN 14/22 | EUR | 17.500,0 | % 99,963 | 17.493.521,50 | 0,66 |
| XS1829348793 | 0,2500 % Dexia Crédit Local EUR MTN 18/23 | EUR | 7.200,0 | % 98,880 | 7.119.336,24 | 0,27 |
| FR0000187635 | 5,7500 % France Government EUR Bonds 01/32 | EUR | 1.600,0 | % 126,461 | 2.023.378,72 | 0,08 |
| FR0010070060 | 4,7500 % France Government EUR Bonds 04/35 | EUR | 7.900,0 | % 118,382 | 9.352.178,00 | 0,35 |
| FR0010171975 | 4,0000 % France Government EUR Bonds 05/55 | EUR | 8.300,0 | % 120,565 | 10.006.880,89 | 0,38 |
| FR0010371401 | 4,0000 % France Government EUR Bonds 06/38 | EUR | 8.500,0 | % 111,999 | 9.519.915,00 | 0,36 |
| FR0010466938 | 4,2500 % France Government EUR Bonds 07/23 | EUR | 11.000,0 | % 102,580 | 11.283.800,00 | 0,43 |
| FR0010773192 | 4,5000 % France Government EUR Bonds 09/41 | EUR | 500,0 | % 119,867 | 599.335,00 | 0,02 |
| FR0010916924 | 3,5000 % France Government EUR Bonds 10/26 | EUR | 11.950,0 | % 104,780 | 12.521.170,57 | 0,47 |
| FR0010870956 | 4,0000 % France Government EUR Bonds 10/60 | EUR | 500,0 | % 123,068 | 615.340,00 | 0,02 |
| FR0011317783 | 2,7500 % France Government EUR Bonds 12/27 | EUR | 8.800,0 | % 102,237 | 8.996.878,00 | 0,34 |
| FR0011486067 | 1,7500 % France Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 20.050,0 | % 100,190 | 20.088.095,00 | 0,76 |
| FR0011619436 | 2,2500 % France Government EUR Bonds 13/24 | EUR | 18.000,0 | % 100,647 | 18.116.460,00 | 0,69 |
| FR0011461037 | 3,2500 % France Government EUR Bonds 13/45 | EUR | 11.500,0 | % 104,020 | 11.962.280,45 | 0,45 |
| FR0011962398 | 1,7500 % France Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 11.300,0 | % 99,639 | 11.259.207,00 | 0,43 |
| FR0011883966 | 2,5000 % France Government EUR Bonds 14/30 | EUR | 11.350,0 | % 100,980 | 11.461.230,00 | 0,43 |
| FR0012517027 | 0,5000 % France Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 4.800,0 | % 96,213 | 4.618.200,00 | 0,18 |
| FR0012938116 | 1,0000 % France Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 6.100,0 | % 96,890 | 5.910.290,00 | 0,22 |
| FR0012993103 | 1,5000 % France Government EUR Bonds 15/31 | EUR | 2.600,0 | % 92,679 | 2.409.654,00 | 0,09 |
| FR0013200813 | 0,2500 % France Government EUR Bonds 16/26 | EUR | 21.900,0 | % 92,515 | 20.260.747,77 | 0,77 |
| FR0013154044 | 1,2500 % France Government EUR Bonds 16/36 | EUR | 9.900,0 | % 81,189 | 8.037.711,00 | 0,31 |
| FR0013154028 | 1,7500 % France Government EUR Bonds 16/66 | EUR | 1.600,0 | % 72,812 | 1.164.992,00 | 0,04 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|--------------------|---|--|-----------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| FR0013250560 | 1,0000 % France Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 3.150,0 | % 94,640 | 2.981.160,00 | 0,11 |
| FR0013286192 | 0,7500 % France Government EUR Bonds 17/28 | EUR | 7.500,0 | % 91,703 | 6.877.725,00 | 0,26 |
| FR0013234333 | 1,7500 % France Government EUR Bonds 17/39 | EUR | 7.800,0 | % 84,478 | 6.589.303,50 | 0,25 |
| FR0013341682 | 0,7500 % France Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 10.200,0 | % 90,926 | 9.274.477,50 | 0,35 |
| FR0013313582 | 1,2500 % France Government EUR Bonds 18/34 | EUR | 5.500,0 | % 84,341 | 4.638.755,00 | 0,18 |
| FR0013407236 | 0,5000 % France Government EUR Bonds 19/29 | EUR | 10.000,0 | % 88,613 | 8.861.300,00 | 0,34 |
| FR0013404969 | 1,5000 % France Government EUR Bonds 19/50 | EUR | 4.600,0 | % 72,254 | 3.323.684,00 | 0,13 |
| FR0013480613 | 0,7500 % France Government EUR Bonds 20/52 | EUR | 7.200,0 | % 56,740 | 4.085.256,24 | 0,16 |
| FR0014001NN8 | 0,5000 % France Government EUR Bonds 21/72 | EUR | 3.000,0 | % 38,891 | 1.166.724,90 | 0,04 |
| FR0014009O62 | 1,2500 % France Government EUR Bonds 22/38 | EUR | 5.000,0 | % 78,069 | 3.903.449,50 | 0,15 |
| FR0000571218 | 5,5000 % France Government EUR Bonds 98/29 | EUR | 7.600,0 | % 118,456 | 9.002.656,00 | 0,34 |
| FR0126893694 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 05.10.2022 | EUR | 42.800,0 | % 99,999 | 42.799.370,84 | 1,62 |
| FR0127034728 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 22.03.2023 | EUR | 20.000,0 | % 99,397 | 19.879.486,00 | 0,75 |
| FR0014003513 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.02.2027 | EUR | 8.000,0 | % 90,777 | 7.262.160,00 | 0,28 |
| FR0013283686 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.03.2023 | EUR | 550,0 | % 99,440 | 546.920,00 | 0,02 |
| FR0013344751 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.03.2024 | EUR | 16.750,0 | % 97,406 | 16.315.421,25 | 0,62 |
| FR0013415627 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.03.2025 | EUR | 3.100,0 | % 95,279 | 2.953.656,75 | 0,11 |
| FR0013451507 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.11.2029 | EUR | 13.800,0 | % 84,397 | 11.646.786,00 | 0,44 |
| FR0013516549 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.11.2030 | EUR | 11.000,0 | % 81,913 | 9.010.430,00 | 0,34 |
| FR0014002WK3 | 0,0000 % France Government EUR Zero-Coupon Bonds 25.11.2031 | EUR | 10.800,0 | % 79,239 | 8.557.847,64 | 0,32 |
| FR0011512193 | 2,2500 % Region of Ile de France EUR Notes 13/23 | EUR | 6.200,0 | % 100,413 | 6.225.625,22 | 0,24 |
| FR0012939841 | 1,5000 % Schneider Electric EUR MTN 15/23 | EUR | 5.000,0 | % 99,177 | 4.958.858,50 | 0,19 |
| FR0011001684 | 4,2500 % Société Générale EUR MTN 11/23 | EUR | 5.000,0 | % 100,956 | 5.047.777,00 | 0,19 |
| FR0013094869 | 0,5000 % Société Générale EUR MTN 16/23 | EUR | 17.600,0 | % 99,769 | 17.559.315,84 | 0,67 |
| Deutschland | | | | | 341.622.277,99 | 12,94 |
| DE000A289DB1 | 0,1010 % BASF EUR MTN 20/23 | EUR | 7.300,0 | % 98,304 | 7.176.202,22 | 0,27 |
| DE000BLB6JA9 | 0,3500 % Bayerische Landesbank EUR Notes 15/22 | EUR | 6.600,0 | % 99,918 | 6.594.584,70 | 0,25 |
| DE000CZ40LR5 | 0,5000 % Commerzbank EUR MTN 16/23 | EUR | 3.000,0 | % 97,547 | 2.926.422,60 | 0,11 |
| DE000DB5DCS4 | 2,3750 % Deutsche Bank EUR MTN 13/23 | EUR | 10.500,0 | % 100,157 | 10.516.465,05 | 0,40 |
| XS2177575177 | 0,3750 % E.ON EUR MTN 20/23 | EUR | 1.600,0 | % 98,873 | 1.581.966,40 | 0,06 |
| DE0001135176 | 5,5000 % Germany Government EUR Bonds 00/31 | EUR | 8.000,0 | % 126,137 | 10.090.959,20 | 0,38 |
| DE0001135226 | 4,7500 % Germany Government EUR Bonds 03/34 S.3 | EUR | 11.500,0 | % 127,019 | 14.607.185,00 | 0,55 |
| DE0001135275 | 4,0000 % Germany Government EUR Bonds 05/37 S.5 | EUR | 2.500,0 | % 121,765 | 3.044.125,00 | 0,12 |
| DE0001135325 | 4,2500 % Germany Government EUR Bonds 07/39 S.2007 | EUR | 1.500,0 | % 128,281 | 1.924.215,00 | 0,07 |
| DE0001135366 | 4,7500 % Germany Government EUR Bonds 08/40 S.8 | EUR | 3.350,0 | % 136,047 | 4.557.574,17 | 0,17 |
| DE0001135432 | 3,2500 % Germany Government EUR Bonds 10/42 | EUR | 3.000,0 | % 117,152 | 3.514.559,70 | 0,13 |
| DE0001135481 | 2,5000 % Germany Government EUR Bonds 12/44 | EUR | 4.300,0 | % 106,345 | 4.572.834,57 | 0,17 |
| DE0001102325 | 2,0000 % Germany Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 9.100,0 | % 100,409 | 9.137.219,00 | 0,35 |
| DE0001102358 | 1,5000 % Germany Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 9.850,0 | % 99,891 | 9.839.263,50 | 0,37 |
| DE0001102366 | 1,0000 % Germany Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 11.650,0 | % 98,874 | 11.518.821,00 | 0,44 |
| DE0001102341 | 2,5000 % Germany Government EUR Bonds 14/46 | EUR | 5.400,0 | % 107,772 | 5.819.688,00 | 0,22 |
| DE0001102382 | 1,0000 % Germany Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 700,0 | % 97,956 | 685.692,00 | 0,03 |
| DE0001102424 | 0,5000 % Germany Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 8.600,0 | % 93,617 | 8.051.062,00 | 0,31 |
| DE0001102432 | 1,2500 % Germany Government EUR Bonds 17/48 | EUR | 4.800,0 | % 83,636 | 4.014.528,00 | 0,15 |
| DE0001102440 | 0,5000 % Germany Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 3.600,0 | % 92,704 | 3.337.344,00 | 0,13 |
| DE0001102457 | 0,2500 % Germany Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 5.000,0 | % 90,626 | 4.531.300,00 | 0,17 |
| DE0001102465 | 0,2500 % Germany Government EUR Bonds 19/29 | EUR | 2.800,0 | % 89,788 | 2.514.063,72 | 0,10 |
| DE0001134922 | 6,2500 % Germany Government EUR Bonds 94/24 S.94 | EUR | 27.500,0 | % 105,724 | 29.074.100,00 | 1,10 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|----------------|---|--|-----------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| DE0001135085 | 4,7500 % Germany Government EUR Bonds 98/28 S.98 | EUR | 6.000,0 | % 114,837 | 6.890.220,00 | 0,26 |
| DE0001141844 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 09.10.2026 S.184 | EUR | 3.500,0 | % 92,829 | 3.249.015,00 | 0,12 |
| DE0001141836 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 10.04.2026 S.183 | EUR | 7.400,0 | % 94,026 | 6.957.924,00 | 0,26 |
| DE0001102531 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.02.2031 | EUR | 10.000,0 | % 84,526 | 8.452.599,00 | 0,32 |
| DE0001102580 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.02.2032 | EUR | 6.300,0 | % 82,381 | 5.190.002,37 | 0,20 |
| DE0001102408 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.08.2026 | EUR | 16.250,0 | % 93,393 | 15.176.362,50 | 0,57 |
| DE0001102473 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.08.2029 | EUR | 9.000,0 | % 87,376 | 7.863.839,10 | 0,30 |
| DE0001102507 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.08.2030 | EUR | 8.000,0 | % 85,537 | 6.842.959,20 | 0,26 |
| DE0001102481 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.08.2050 | EUR | 8.750,0 | % 56,273 | 4.923.886,63 | 0,19 |
| DE0001102572 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.08.2052 | EUR | 2.300,0 | % 53,946 | 1.240.757,54 | 0,05 |
| DE0001104859 | 0,0000 % Germany Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.09.2023 | EUR | 23.000,0 | % 98,573 | 22.671.790,00 | 0,86 |
| XS1382379318 | 0,1250 % Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale EUR MTN 16/22 | EUR | 3.800,0 | % 99,894 | 3.795.984,92 | 0,14 |
| XS1835983922 | 0,0500 % Landwirtschaftliche Rentenbank EUR MTN 18/23 | EUR | 20.000,0 | % 98,753 | 19.750.600,00 | 0,75 |
| XS1788515788 | 1,1250 % METRO EUR MTN 18/23 | EUR | 5.500,0 | % 97,179 | 5.344.871,40 | 0,20 |
| DE000NWB18G9 | 0,1250 % NRW Bank EUR Notes 18/23 | EUR | 20.900,0 | % 98,646 | 20.616.968,02 | 0,78 |
| DE000A1R06T9 | 1,8750 % State of Berlin EUR Notes 13/23 S.407 | EUR | 12.800,0 | % 99,980 | 12.797.498,88 | 0,48 |
| DE000A13R6X4 | 0,7500 % State of Berlin EUR Notes 14/22 | EUR | 11.500,0 | % 99,995 | 11.499.471,00 | 0,44 |
| DE000NRWOGS5 | 0,2000 % State of North Rhine-Westphalia EUR MTN 15/23 | EUR | 11.000,0 | % 99,253 | 10.917.834,40 | 0,41 |
| XS2282093769 | 0,0000 % Volkswagen Leasing EUR Zero-Coupon MTN 12.07.2023 | EUR | 8.000,0 | % 97,619 | 7.809.519,20 | 0,30 |
| Irland | | | | | 66.419.456,08 | 2,52 |
| IE00B4TV0D44 | 5,4000 % Ireland Government EUR Bonds 09/25 | EUR | 3.900,0 | % 108,229 | 4.220.931,00 | 0,16 |
| IE00B4S3JD47 | 3,9000 % Ireland Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 24.000,0 | % 101,294 | 24.310.560,00 | 0,92 |
| IE00B6X95T99 | 3,4000 % Ireland Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 450,0 | % 102,244 | 460.098,00 | 0,02 |
| IE00BJ38CR43 | 2,4000 % Ireland Government EUR Bonds 14/30 | EUR | 4.000,0 | % 99,882 | 3.995.280,00 | 0,15 |
| IE00BV8C9186 | 2,0000 % Ireland Government EUR Bonds 15/45 | EUR | 550,0 | % 83,944 | 461.689,25 | 0,02 |
| IE00BV8C9B83 | 1,7000 % Ireland Government EUR Bonds 17/37 | EUR | 1.000,0 | % 85,770 | 857.699,90 | 0,03 |
| IE00BDHDP44 | 0,9000 % Ireland Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 400,0 | % 92,365 | 369.460,00 | 0,02 |
| IE00BFZRPZ02 | 1,3000 % Ireland Government EUR Bonds 18/33 | EUR | 2.750,0 | % 87,001 | 2.392.527,23 | 0,09 |
| IE00BH3SQ895 | 1,1000 % Ireland Government EUR Bonds 19/29 | EUR | 1.500,0 | % 92,082 | 1.381.230,00 | 0,05 |
| IE00BH3SQB22 | 1,5000 % Ireland Government EUR Bonds 19/50 | EUR | 1.500,0 | % 71,804 | 1.077.059,85 | 0,04 |
| IE00BKFVC568 | 0,2000 % Ireland Government EUR Bonds 20/27 | EUR | 4.150,0 | % 91,270 | 3.787.705,00 | 0,14 |
| IE00BMQ5JM72 | 0,5500 % Ireland Government EUR Bonds 21/41 | EUR | 1.100,0 | % 65,215 | 717.365,00 | 0,03 |
| IE00BDHDPQ37 | 0,0000 % Ireland Government EUR Zero-Coupon Bonds 18.10.2022 | EUR | 21.200,0 | % 99,993 | 21.198.516,00 | 0,80 |
| IE00BMQ5JL65 | 0,0000 % Ireland Government EUR Zero-Coupon Bonds 18.10.2031 | EUR | 1.500,0 | % 79,289 | 1.189.334,85 | 0,05 |
| Italien | | | | | 538.684.443,17 | 20,41 |
| IT0004872328 | 3,6250 % Intesa Sanpaolo EUR MTN 12/22 | EUR | 4.500,0 | % 100,447 | 4.520.110,95 | 0,17 |
| IT0005140030 | 1,0000 % Intesa Sanpaolo EUR Notes 15/23 | EUR | 6.900,0 | % 99,844 | 6.889.267,05 | 0,26 |
| IT0005482929 | 0,0000 % Italy Buoni Ordinari Del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 14.02.2023 | EUR | 23.500,0 | % 99,487 | 23.379.360,40 | 0,89 |
| IT0005500027 | 0,0000 % Italy Buoni Ordinari Del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 14.07.2023 | EUR | 28.500,0 | % 98,390 | 28.041.198,45 | 1,06 |
| IT0005460305 | 0,0000 % Italy Buoni Ordinari Del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 14.10.2022 | EUR | 39.450,0 | % 99,995 | 39.448.086,68 | 1,50 |
| IT0005466609 | 0,0000 % Italy Buoni Ordinari Del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 14.11.2022 | EUR | 38.900,0 | % 99,922 | 38.869.549,08 | 1,47 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|--------------|--|--|-----------------------|-----------|--------------------|---------------------------------------|
| IT0001444378 | 6,0000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 00/31 | EUR | 11.800,0 | % 112,879 | 13.319.722,00 | 0,50 |
| IT0003256820 | 5,7500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 02/33 | EUR | 3.800,0 | % 110,506 | 4.199.209,00 | 0,16 |
| IT0003535157 | 5,0000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 03/34 | EUR | 3.200,0 | % 104,546 | 3.345.480,00 | 0,13 |
| IT0004286966 | 5,0000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 07/39 | EUR | 2.500,0 | % 105,940 | 2.648.493,75 | 0,10 |
| IT0004356843 | 4,7500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 08/23 | EUR | 43.800,0 | % 101,978 | 44.666.289,54 | 1,69 |
| IT0004532559 | 5,0000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 09/40 | EUR | 6.300,0 | % 105,799 | 6.665.352,75 | 0,25 |
| IT0004644735 | 4,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 10/26 | EUR | 6.850,0 | % 103,677 | 7.101.897,11 | 0,27 |
| IT0004848831 | 5,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 12/22 | EUR | 46.350,0 | % 100,375 | 46.523.580,75 | 1,76 |
| IT0004889033 | 4,7500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 13/28 | EUR | 10.000,0 | % 104,332 | 10.433.150,00 | 0,40 |
| IT0004923998 | 4,7500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 13/44 | EUR | 6.700,0 | % 103,733 | 6.950.077,50 | 0,26 |
| IT0005001547 | 3,7500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 14/24 | EUR | 8.400,0 | % 101,566 | 8.531.516,28 | 0,32 |
| IT0005083057 | 3,2500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 15/46 | EUR | 4.000,0 | % 83,134 | 3.325.353,20 | 0,13 |
| IT0005172322 | 0,9500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/23 | EUR | 22.800,0 | % 99,702 | 22.731.942,00 | 0,86 |
| IT0005215246 | 0,6500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/23 | EUR | 500,0 | % 98,370 | 491.851,25 | 0,02 |
| IT0005210650 | 1,2500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/26 | EUR | 10.000,0 | % 91,173 | 9.117.300,00 | 0,35 |
| IT0005177909 | 2,2500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/36 | EUR | 13.200,0 | % 77,537 | 10.234.818,00 | 0,39 |
| IT0005162828 | 2,7000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/47 | EUR | 4.600,0 | % 74,934 | 3.446.952,50 | 0,13 |
| IT0005217390 | 2,8000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 16/67 | EUR | 3.300,0 | % 70,836 | 2.337.588,00 | 0,09 |
| IT0005246340 | 1,8500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 17/24 | EUR | 24.800,0 | % 98,432 | 24.411.136,00 | 0,93 |
| IT0005282527 | 1,4500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 17/24 | EUR | 22.000,0 | % 96,964 | 21.332.135,00 | 0,81 |
| IT0005240830 | 2,2000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 17/27 | EUR | 4.750,0 | % 93,707 | 4.451.082,50 | 0,17 |
| IT0005325946 | 0,9500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 18/23 | EUR | 20.350,0 | % 99,733 | 20.295.563,75 | 0,77 |
| IT0005345183 | 2,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 18/25 | EUR | 9.600,0 | % 97,463 | 9.356.448,00 | 0,35 |
| IT0005340929 | 2,8000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 18/28 | EUR | 1.800,0 | % 93,930 | 1.690.739,82 | 0,06 |
| IT0005321325 | 2,9500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 18/38 | EUR | 2.500,0 | % 82,417 | 2.060.418,75 | 0,08 |
| IT0005384497 | 0,0500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 19/23 | EUR | 20.200,0 | % 99,696 | 20.138.592,00 | 0,76 |
| IT0005370306 | 2,1000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 19/26 | EUR | 14.800,0 | % 95,097 | 14.074.381,16 | 0,53 |
| IT0005358806 | 3,3500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 19/35 | EUR | 1.900,0 | % 89,144 | 1.693.736,00 | 0,06 |
| IT0005377152 | 3,1000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 19/40 | EUR | 4.000,0 | % 82,201 | 3.288.040,00 | 0,12 |
| IT0005408502 | 1,8500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 20/25 | EUR | 2.500,0 | % 96,102 | 2.402.537,50 | 0,09 |
| IT0005413171 | 1,6500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 20/30 | EUR | 10.100,0 | % 82,252 | 8.307.426,75 | 0,32 |
| IT0005422891 | 0,9000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 20/31 | EUR | 7.500,0 | % 76,073 | 5.705.437,50 | 0,22 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|------------------|--|--|-----------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| IT0005402117 | 1,4500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 20/36 | EUR | 6.000,0 | % 70,173 | 4.210.350,00 | 0,16 |
| IT0005398406 | 2,4500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 20/50 | EUR | 900,0 | % 68,895 | 620.055,00 | 0,02 |
| IT0005445306 | 0,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 21/28 | EUR | 15.800,0 | % 82,404 | 13.019.792,50 | 0,49 |
| IT0005438004 | 1,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 21/45 | EUR | 6.500,0 | % 58,877 | 3.826.972,50 | 0,15 |
| IT0001174611 | 6,5000 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 97/27 | EUR | 6.000,0 | % 112,965 | 6.777.915,00 | 0,26 |
| IT0001278511 | 5,2500 % Italy Buoni Poliennali Del Tesoro EUR Bonds 98/29 | EUR | 11.500,0 | % 107,937 | 12.412.755,00 | 0,47 |
| XS1754213947 | 1,0000 % UniCredit EUR MTN 18/23 | EUR | 11.500,0 | % 99,050 | 11.390.782,20 | 0,43 |
| Luxemburg | | | | | 33.481.052,17 | 1,27 |
| XS1960678099 | 0,3750 % Medtronic Global Holdings EUR Notes 19/23 | EUR | 9.100,0 | % 99,378 | 9.043.361,60 | 0,34 |
| XS2020670696 | 0,0000 % Medtronic Global Holdings EUR Zero-Coupon MTN 02.12.2022 | EUR | 15.500,0 | % 99,804 | 15.469.661,85 | 0,59 |
| XS2240133459 | 0,0000 % Medtronic Global Holdings EUR Zero-Coupon Notes 15.03.2023 | EUR | 9.050,0 | % 99,094 | 8.968.028,72 | 0,34 |
| Norwegen | | | | | 61.048.257,44 | 2,31 |
| XS1756428469 | 0,2500 % DNB Boligkreditt EUR MTN 18/23 | EUR | 15.000,0 | % 99,684 | 14.952.622,50 | 0,57 |
| XS1377237869 | 0,3750 % SpareBank 1 Boligkreditt EUR MTN 16/23 | EUR | 22.400,0 | % 99,501 | 22.288.192,64 | 0,84 |
| XS1827891869 | 0,7500 % SpareBank 1 SMN EUR Notes 18/23 | EUR | 3.500,0 | % 98,634 | 3.452.192,80 | 0,13 |
| XS1854532865 | 0,1250 % Sparebanken Vest Boligkreditt EUR MTN 18/23 | EUR | 20.500,0 | % 99,294 | 20.355.249,50 | 0,77 |
| Portugal | | | | | 24.066.177,24 | 0,91 |
| PTOTE5OE0007 | 4,1000 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 06/37 | EUR | 3.000,0 | % 107,811 | 3.234.329,70 | 0,12 |
| PTOTEAOE0021 | 4,9500 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 08/23 | EUR | 1.500,0 | % 103,242 | 1.548.630,00 | 0,06 |
| PTOTEQOE0015 | 5,6500 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 13/24 | EUR | 1.700,0 | % 104,783 | 1.781.311,00 | 0,07 |
| PTOTEROE0014 | 3,8750 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 14/30 | EUR | 2.150,0 | % 107,007 | 2.300.650,50 | 0,09 |
| PTOTEKOE0011 | 2,8750 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 15/25 | EUR | 600,0 | % 102,095 | 612.570,00 | 0,02 |
| PTOTEBOE0020 | 4,1000 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 15/45 | EUR | 1.000,0 | % 109,625 | 1.096.249,90 | 0,04 |
| PTOTETOE0012 | 2,8750 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 16/26 | EUR | 3.500,0 | % 102,183 | 3.576.405,00 | 0,14 |
| PTOTEVOE0018 | 2,1250 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 18/28 | EUR | 5.250,0 | % 96,965 | 5.090.662,50 | 0,19 |
| PTOTEMOE0035 | 0,7000 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 20/27 | EUR | 1.400,0 | % 91,287 | 1.278.018,00 | 0,05 |
| PTOTELOE0028 | 0,4750 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 20/30 | EUR | 1.100,0 | % 82,516 | 907.675,89 | 0,03 |
| PTOTEOOE0033 | 0,3000 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 21/31 | EUR | 2.500,0 | % 78,536 | 1.963.399,75 | 0,07 |
| PTOTEPOE0032 | 1,1500 % Portugal Obrigações do Tesouro EUR Bonds 22/42 | EUR | 1.000,0 | % 67,628 | 676.275,00 | 0,03 |
| Spanien | | | | | 378.843.113,76 | 14,36 |
| XS1679158094 | 1,1250 % CaixaBank EUR MTN 17/23 | EUR | 5.200,0 | % 99,807 | 5.189.949,44 | 0,20 |
| XS1752476538 | 0,7500 % CaixaBank EUR MTN 18/23 | EUR | 6.300,0 | % 98,973 | 6.235.291,44 | 0,24 |
| ES0422714123 | 0,8750 % Cajamar Caja Rural EUR Notes 18/23 | EUR | 10.000,0 | % 99,097 | 9.909.665,00 | 0,38 |
| XS2073787470 | 0,0000 % Instituto de Crédito Oficial EUR Zero-Coupon MTN 31.10.2022 | EUR | 7.900,0 | % 99,917 | 7.893.470,65 | 0,30 |
| ES0000012411 | 5,7500 % Spain Government EUR Bonds 01/32 | EUR | 700,0 | % 122,035 | 854.245,00 | 0,03 |
| ES0000012932 | 4,2000 % Spain Government EUR Bonds 05/37 | EUR | 5.200,0 | % 108,677 | 5.651.203,48 | 0,21 |
| ES00000121G2 | 4,8000 % Spain Government EUR Bonds 08/24 | EUR | 9.200,0 | % 103,565 | 9.527.980,00 | 0,36 |
| ES00000121S7 | 4,7000 % Spain Government EUR Bonds 09/41 | EUR | 7.000,0 | % 116,555 | 8.158.849,30 | 0,31 |
| ES00000122E5 | 4,6500 % Spain Government EUR Bonds 10/25 | EUR | 13.500,0 | % 106,542 | 14.383.170,00 | 0,55 |
| ES00000123C7 | 5,9000 % Spain Government EUR Bonds 11/26 | EUR | 600,0 | % 112,739 | 676.434,00 | 0,03 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|--------------------|---|--|-----------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------------|
| ES00000123U9 | 5,4000 % Spain Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 38.800,0 | % 101,359 | 39.327.292,00 | 1,49 |
| ES00000123X3 | 4,4000 % Spain Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 16.000,0 | % 102,577 | 16.412.320,00 | 0,62 |
| ES00000124C5 | 5,1500 % Spain Government EUR Bonds 13/28 | EUR | 400,0 | % 112,818 | 451.271,96 | 0,02 |
| ES00000124H4 | 5,1500 % Spain Government EUR Bonds 13/44 | EUR | 4.300,0 | % 124,941 | 5.372.463,00 | 0,20 |
| ES00000126Z1 | 1,6000 % Spain Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 900,0 | % 98,443 | 885.987,00 | 0,03 |
| ES00000127A2 | 1,9500 % Spain Government EUR Bonds 15/30 | EUR | 10.000,0 | % 92,816 | 9.281.599,00 | 0,35 |
| ES00000127Z9 | 1,9500 % Spain Government EUR Bonds 16/26 | EUR | 3.600,0 | % 98,351 | 3.540.636,00 | 0,13 |
| ES00000128H5 | 1,3000 % Spain Government EUR Bonds 16/26 | EUR | 7.750,0 | % 95,520 | 7.402.800,00 | 0,28 |
| ES00000128C6 | 2,9000 % Spain Government EUR Bonds 16/46 | EUR | 3.000,0 | % 89,525 | 2.685.749,70 | 0,10 |
| ES00000128E2 | 3,4500 % Spain Government EUR Bonds 16/66 | EUR | 2.100,0 | % 94,402 | 1.982.442,00 | 0,08 |
| ES0000012A97 | 0,4500 % Spain Government EUR Bonds 17/22 | EUR | 46.000,0 | % 99,990 | 45.995.400,00 | 1,74 |
| ES0000012A89 | 1,4500 % Spain Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 4.600,0 | % 94,218 | 4.334.027,54 | 0,16 |
| ES00000128Q6 | 2,3500 % Spain Government EUR Bonds 17/33 | EUR | 1.700,0 | % 91,639 | 1.557.862,83 | 0,06 |
| ES0000012B62 | 0,3500 % Spain Government EUR Bonds 18/23 | EUR | 19.700,0 | % 98,748 | 19.453.356,00 | 0,74 |
| ES0000012B39 | 1,4000 % Spain Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 5.000,0 | % 93,022 | 4.651.099,50 | 0,18 |
| ES0000012B88 | 1,4000 % Spain Government EUR Bonds 18/28 | EUR | 3.700,0 | % 92,516 | 3.423.091,63 | 0,13 |
| ES0000012B47 | 2,7000 % Spain Government EUR Bonds 18/48 | EUR | 1.500,0 | % 85,374 | 1.280.609,85 | 0,05 |
| ES0000012E69 | 1,8500 % Spain Government EUR Bonds 19/35 | EUR | 1.700,0 | % 84,016 | 1.428.271,83 | 0,05 |
| ES0000012G26 | 0,8000 % Spain Government EUR Bonds 20/27 | EUR | 4.100,0 | % 91,698 | 3.759.617,59 | 0,14 |
| ES0000012F76 | 0,5000 % Spain Government EUR Bonds 20/30 | EUR | 7.000,0 | % 83,528 | 5.846.959,30 | 0,22 |
| ES0000012G42 | 1,2000 % Spain Government EUR Bonds 20/40 | EUR | 2.800,0 | % 68,661 | 1.922.507,72 | 0,07 |
| ES0000012G00 | 1,0000 % Spain Government EUR Bonds 20/50 | EUR | 3.700,0 | % 54,666 | 2.022.645,70 | 0,08 |
| ES0000012I32 | 0,5000 % Spain Government EUR Bonds 21/31 | EUR | 13.500,0 | % 79,415 | 10.720.980,45 | 0,41 |
| ES0000012I24 | 0,8500 % Spain Government EUR Bonds 21/37 | EUR | 6.500,0 | % 69,136 | 4.493.839,35 | 0,17 |
| ES0000012H58 | 1,4500 % Spain Government EUR Bonds 21/71 | EUR | 2.500,0 | % 49,665 | 1.241.625,00 | 0,05 |
| ES0000012K53 | 0,8000 % Spain Government EUR Bonds 22/29 | EUR | 2.000,0 | % 86,870 | 1.737.392,00 | 0,07 |
| ES0000011868 | 6,0000 % Spain Government EUR Bonds 98/29 | EUR | 12.000,0 | % 118,422 | 14.210.640,00 | 0,54 |
| ES0000012F92 | 0,0000 % Spain Government EUR Zero-Coupon Bonds 31.01.2025 | EUR | 900,0 | % 94,962 | 854.658,00 | 0,03 |
| ES0000012G91 | 0,0000 % Spain Government EUR Zero-Coupon Bonds 31.01.2026 | EUR | 13.000,0 | % 92,305 | 11.999.650,00 | 0,45 |
| ES0L02210075 | 0,0000 % Spain Letras del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 07.10.2022 | EUR | 59.200,0 | % 100,006 | 59.203.611,20 | 2,24 |
| ES0L02303102 | 0,0000 % Spain Letras del Tesoro EUR Zero-Coupon Bonds 10.03.2023 | EUR | 23.000,0 | % 99,489 | 22.882.449,30 | 0,87 |
| Schweden | | | | | 27.212.941,76 | 1,03 |
| XS2259865926 | 0,0000 % Scania EUR Zero-Coupon MTN 23.11.2022 | EUR | 8.630,0 | % 99,818 | 8.614.321,88 | 0,33 |
| XS1333139746 | 1,1250 % Svenska Handelsbanken EUR MTN 15/22 | EUR | 18.600,0 | % 99,993 | 18.598.619,88 | 0,70 |
| Schweiz | | | | | 4.962.935,50 | 0,19 |
| XS2149270477 | 0,7500 % UBS (London) EUR MTN 20/23 | EUR | 5.000,0 | % 99,259 | 4.962.935,50 | 0,19 |
| Niederlande | | | | | 128.337.724,96 | 4,86 |
| XS2102355588 | 0,0000 % BMW Finance EUR Zero-Coupon MTN 14.04.2023 | EUR | 13.000,0 | % 98,934 | 12.861.446,00 | 0,49 |
| XS0842659426 | 4,8750 % Enel Finance International EUR MTN 12/23 | EUR | 5.000,0 | % 101,525 | 5.076.230,50 | 0,19 |
| XS0935034651 | 1,8750 % ING Bank EUR MTN 13/23 | EUR | 11.600,0 | % 99,954 | 11.594.645,44 | 0,44 |
| XS1882544627 | 1,0000 % ING Groep EUR MTN 18/23 | EUR | 3.000,0 | % 98,116 | 2.943.477,90 | 0,11 |
| DE000A289XH6 | 1,6250 % Mercedes-Benz International Finance EUR MTN 20/23 | EUR | 6.000,0 | % 98,910 | 5.934.582,00 | 0,23 |
| NL0000102234 | 4,0000 % Netherlands Government EUR Bonds 05/37 | EUR | 3.000,0 | % 116,878 | 3.506.339,70 | 0,13 |
| NL0009446418 | 3,7500 % Netherlands Government EUR Bonds 10/42 | EUR | 3.500,0 | % 118,780 | 4.157.299,65 | 0,16 |
| NL0010071189 | 2,5000 % Netherlands Government EUR Bonds 12/33 | EUR | 2.700,0 | % 100,483 | 2.713.040,73 | 0,10 |
| NL0010418810 | 1,7500 % Netherlands Government EUR Bonds 13/23 | EUR | 14.600,0 | % 100,026 | 14.603.796,00 | 0,56 |
| NL0010733424 | 2,0000 % Netherlands Government EUR Bonds 14/24 | EUR | 5.000,0 | % 100,505 | 5.025.250,00 | 0,19 |
| NL0010721999 | 2,7500 % Netherlands Government EUR Bonds 14/47 | EUR | 3.000,0 | % 106,116 | 3.183.479,70 | 0,12 |
| NL0011220108 | 0,2500 % Netherlands Government EUR Bonds 15/25 | EUR | 300,0 | % 95,654 | 286.962,00 | 0,01 |
| NL0011819040 | 0,5000 % Netherlands Government EUR Bonds 16/26 | EUR | 7.600,0 | % 94,752 | 7.201.152,00 | 0,27 |
| NL0012171458 | 0,7500 % Netherlands Government EUR Bonds 17/27 | EUR | 3.000,0 | % 93,866 | 2.815.980,00 | 0,11 |
| NL0013332430 | 0,2500 % Netherlands Government EUR Bonds 19/29 | EUR | 4.000,0 | % 87,568 | 3.502.720,00 | 0,13 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|--|---|--|-----------------------|-----------|-------------------------|---------------------------------------|
| NL0013552060 | 0,5000 % Netherlands Government EUR Bonds 19/40 | EUR | 3.000,0 | % 71,404 | 2.142.119,70 | 0,08 |
| NL0000102317 | 5,5000 % Netherlands Government EUR Bonds 98/28 | EUR | 5.000,0 | % 116,510 | 5.825.500,00 | 0,22 |
| NL0012650469 | 0,0000 % Netherlands Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.01.2024 | EUR | 3.100,0 | % 97,891 | 3.034.621,00 | 0,12 |
| NL0015614579 | 0,0000 % Netherlands Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.01.2052 | EUR | 2.700,0 | % 50,609 | 1.366.442,46 | 0,05 |
| NL0014555419 | 0,0000 % Netherlands Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.07.2030 | EUR | 5.400,0 | % 83,903 | 4.530.761,46 | 0,17 |
| NL00150006U0 | 0,0000 % Netherlands Government EUR Zero-Coupon Bonds 15.07.2031 | EUR | 2.000,0 | % 81,874 | 1.637.479,80 | 0,06 |
| XS2118276539 | 0,0000 % Siemens Financieringsmaatschappij EUR Zero-Coupon MTN 20.02.2023 | EUR | 7.000,0 | % 99,261 | 6.948.250,40 | 0,26 |
| XS1167644407 | 0,8750 % Volkswagen International Finance EUR MTN 15/23 | EUR | 7.000,0 | % 99,251 | 6.947.591,00 | 0,26 |
| DE000A192ZH7 | 0,8750 % Vonovia Finance EUR MTN 18/23 | EUR | 10.700,0 | % 98,117 | 10.498.557,52 | 0,40 |
| Vereinigtes Königreich | | | | | 46.920.096,61 | 1,78 |
| XS1308693867 | 0,7500 % Nationwide Building Society EUR MTN 15/22 | EUR | 12.600,0 | % 100,004 | 12.600.549,36 | 0,48 |
| XS1382368113 | 2,5000 % NatWest Group EUR MTN 16/23 | EUR | 9.500,0 | % 100,232 | 9.522.063,75 | 0,36 |
| XS1837997979 | 1,1250 % NatWest Markets EUR MTN 18/23 | EUR | 5.000,0 | % 99,111 | 4.955.563,50 | 0,19 |
| XS1594364033 | 0,3750 % Yorkshire Building Society EUR MTN 17/23 | EUR | 20.000,0 | % 99,210 | 19.841.920,00 | 0,75 |
| USA | | | | | 48.185.890,51 | 1,83 |
| XS0903433513 | 2,5000 % AT&T EUR Notes 13/23 | EUR | 1.800,0 | % 100,115 | 1.802.066,58 | 0,07 |
| XS1196373507 | 1,3000 % AT&T EUR Notes 15/23 | EUR | 8.000,0 | % 98,517 | 7.881.333,60 | 0,30 |
| XS1325825211 | 2,1500 % Booking Holdings EUR Notes 15/22 | EUR | 2.600,0 | % 99,979 | 2.599.448,80 | 0,10 |
| XS1223830677 | 1,0000 % General Mills EUR Notes 15/23 | EUR | 1.500,0 | % 99,176 | 1.487.633,40 | 0,06 |
| XS1265805090 | 2,0000 % Goldman Sachs Group EUR MTN 15/23 | EUR | 5.600,0 | % 99,227 | 5.556.730,48 | 0,21 |
| XS1310493744 | 1,5000 % JPMorgan Chase EUR MTN 15/22 | EUR | 8.900,0 | % 100,019 | 8.901.695,45 | 0,34 |
| XS1529838085 | 1,0000 % Morgan Stanley EUR MTN 16/22 | EUR | 11.150,0 | % 99,886 | 11.137.297,92 | 0,42 |
| XS1115208107 | 1,8750 % Morgan Stanley EUR Notes 14/23 | EUR | 5.000,0 | % 99,914 | 4.995.714,00 | 0,19 |
| XS1864037541 | 0,7500 % National Grid North America EUR MTN 18/23 | EUR | 3.900,0 | % 98,051 | 3.823.970,28 | 0,14 |
| Anlagen in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | 2.542.021.292,12 | 96,32 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 157.605.969,06 | 5,97 |
| Täglich fällige Gelder | | | | | 157.605.969,06 | 5,97 |
| | State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch | EUR | | | 33.745.045,39 | 1,28 |
| | Barmittel bei Brokern und Einlagen zur Besicherung von Derivaten | EUR | | | 123.860.923,67 | 4,69 |
| Summe Einlagen bei Kreditinstituten | | | | | 157.605.969,06 | 5,97 |

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Nicht- realisierter Gewinn/Verlust | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|---|--|-----------------------|---------------|--|---------------------------------------|
| Derivate | | | | | |
| Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen. | | | | | |
| Börsengehandelte Derivate | | | | -74.943.426,62 | -2,84 |
| Futuresgeschäfte | | | | -74.943.426,62 | -2,84 |
| Gekaufte Indexterminkontrakte | | | | -79.740.826,62 | -3,02 |
| DJ EURO STOXX 50 Index Futures 12/22 | Ktr | 3.630 | EUR 3.306,000 | -8.917.247,50 | -0,34 |
| FTSE 100 Index Futures 12/22 | Ktr | 552 | GBP 6.940,500 | -3.200.025,06 | -0,12 |
| S&P 500 E-mini Index Futures 12/22 | Ktr | 2.840 | USD 3.654,250 | -58.770.642,28 | -2,23 |
| S&P/TSX 60 Index Futures 12/22 | Ktr | 153 | CAD 1.117,700 | -1.698.422,06 | -0,06 |
| SPI 200 Index Futures 12/22 | Ktr | 477 | AUD 6.466,000 | -4.017.435,69 | -0,15 |
| Topix Index Futures 12/22 | Ktr | 588 | JPY 1.836,000 | -3.137.054,03 | -0,12 |
| Verkaufte Bondterminkontrakte | | | | 4.797.400,00 | 0,18 |
| 10-Year German Government Bond (Bund) Futures 12/22 | Ktr | -87 | EUR 138,220 | 368.880,00 | 0,02 |
| 2-Year German Government Bond (Schatz) Futures 12/22 | Ktr | -196 | EUR 107,095 | 96.930,00 | 0,00 |
| 30-Year German Government Bond (Buxl) Futures 12/22 | Ktr | -159 | EUR 147,100 | 1.681.960,00 | 0,06 |
| 5-Year German Government Bond (Bobl) Futures 12/22 | Ktr | -340 | EUR 119,540 | 622.290,00 | 0,02 |

Der Anhang stellt einen wesentlichen Bestandteil des Berichts dar.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2022

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Währung (in 1.000) bzw. Kontrakte | Bestand 30.09.2022 | Kurs | Nicht- realisierter Gewinn/Verlust in EUR | %-Anteil am Teilfonds- vermögen |
|--|--|-----------------------|-------------|--|---------------------------------------|
| Euro BTP Futures 12/22 | Ktr | -472 | EUR 111,550 | 2.027.340,00 | 0,08 |
| OTC-gehandelte Derivate | | | | 5.676,33 | 0,00 |
| Devisentermingeschäfte | | | | 5.676,33 | 0,00 |
| Sold AUD / Bought USD - 15 Nov 2022 | AUD | -0,06 | | 0,00 | 0,00 |
| Sold CAD / Bought USD - 15 Nov 2022 | CAD | -0,01 | | 0,00 | 0,00 |
| Sold EUR / Bought USD - 15 Nov 2022 | EUR | -149.540,01 | | 5.715,63 | 0,00 |
| Sold GBP / Bought USD - 15 Nov 2022 | GBP | -0,02 | | 0,00 | 0,00 |
| Sold USD / Bought AUD - 15 Nov 2022 | USD | -13,13 | | -0,78 | 0,00 |
| Sold USD / Bought CAD - 15 Nov 2022 | USD | -2,47 | | -0,13 | 0,00 |
| Sold USD / Bought EUR - 15 Nov 2022 | USD | -7.672,75 | | -37,42 | 0,00 |
| Sold USD / Bought GBP - 15 Nov 2022 | USD | -7,33 | | -0,53 | 0,00 |
| Sold USD / Bought JPY - 15 Nov 2022 | USD | -6,60 | | -0,44 | 0,00 |
| Anlage in Derivaten | | | | -74.937.750,29 | -2,84 |
| Sonstige Vermögenswerte/Verbindlichkeiten | EUR | | | 14.328.882,15 | 0,55 |
| Teilfondsvermögen | EUR | | | 2.639.018.393,04 | 100,00 |
| Nettoinventarwert je Anteil | | | | | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | EUR | | | 132,76 | |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | EUR | | | 94,37 | |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 192,24 | |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 1.443,66 | |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 1.989,99 | |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | EUR | | | 1.151,04 | |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 1.161,87 | |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 104,12 | |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | EUR | | | 1.102,24 | |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | USD | | | 99,38 | |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | USD | | | 1.038,97 | |
| Aktien im Umlauf | | | | | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | STK | | | 108.189 | |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | STK | | | 17.286 | |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 5.799.660 | |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 795.751 | |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 46.500 | |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | STK | | | 2.078 | |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 8.521 | |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 19.228 | |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | STK | | | 213.158 | |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | STK | | | 1.457 | |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | STK | | | 16.445 | |

Die Angaben der Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes während des Berichtszeitraums können kostenlos bei der Allianz Global Investors GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg, angefordert werden.

Ertrags- und Aufwandsrechnung

für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 30.09.2022

| | EUR |
|---|------------------------|
| Zinsen aus | |
| - Anleihen | 45.878.410,50 |
| - Swapgeschäften | 608.301,67 |
| Guthabenzinsen | |
| - positiver Zinssatz | 278.799,63 |
| - negativer Zinssatz | -919.567,88 |
| Sonstige Erträge | 21.447,59 |
| Summe der Erträge | 45.867.391,51 |
| Zinsaufwand aus | |
| - Swapgeschäften | -993,67 |
| Taxe d'Abonnement | -902.975,24 |
| Pauschalvergütung | -39.746.404,42 |
| Summe der Aufwendungen | -40.650.373,33 |
| Nettoertrag/-verlust | 5.217.018,18 |
| Realisierte Gewinne/Verluste aus | |
| - Wertpapiergeschäften | -92.020.733,85 |
| - Finanztermingeschäften | -149.395.442,02 |
| - Devisentermingeschäften | 23.327,74 |
| - Devisen | 2.972.961,59 |
| - Swapgeschäften | -34.997.479,82 |
| Nettogewinn/-verlust | -268.200.348,18 |
| Veränderungen der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus | |
| - Wertpapiergeschäften | -190.387.496,32 |
| - Finanztermingeschäften | -31.436.735,95 |
| - Devisentermingeschäften | 2.230,31 |
| - Devisen | -715.440,87 |
| - Swapgeschäften | 3.295.676,55 |
| Betriebsergebnis | -487.442.114,46 |

Zusammensetzung des Fondsvermögens

zum 30.09.2022

| | EUR |
|--|-------------------------|
| Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | |
| (Anschaffungspreis EUR 2.744.361.796,76) | 2.542.021.292,12 |
| Bankguthaben | 157.605.969,06 |
| Zinsansprüche aus | |
| - Anleihen | 18.944.253,66 |
| Forderungen aus | |
| - Verkauf von Fondsanteilen | 3.474,12 |
| Nicht realisierter Gewinn aus | |
| - Futuresgeschäften | 4.797.400,00 |
| - Devisentermingeschäften | 5.715,63 |
| Gesamtvermögen | 2.723.378.104,59 |
| Bankverbindlichkeiten | -694.412,28 |
| Verbindlichkeiten aus | |
| - Rücknahme von Fondsanteilen | -937.934,78 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | -2.986.498,57 |
| Nicht realisierter Verlust aus | |
| - Futuresgeschäften | -79.740.826,62 |
| - Devisentermingeschäften | -39,30 |
| Gesamtverbindlichkeiten | -84.359.711,55 |
| Fondsvermögen | 2.639.018.393,04 |

Entwicklung des Fondsvermögens

für den Zeitraum vom 01.10.2021 bis zum 30.09.2022

| | EUR |
|---|-------------------------|
| Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | 3.786.752.808,85 |
| Mittelzuflüsse | 335.929.838,71 |
| Mittelrückflüsse | -996.162.044,57 |
| Ausschüttung | -60.095,49 |
| Betriebsergebnis | -487.442.114,46 |
| Vermögen am Ende des Berichtszeitraums | 2.639.018.393,04 |

Entwicklung der Aktien im Umlauf

| | 01.10.2021 | 01.10.2020 |
|---|------------------|------------------|
| | - | - |
| | 30.09.2022 | 30.09.2021 |
| Aktien im Umlauf zu Beginn des Berichtszeitraums | 7.928.402 | 8.606.253 |
| Im Berichtszeitraum ausgegebene Aktien | 485.589 | 821.524 |
| Im Berichtszeitraum zurückgenommene Aktien | -1.385.718 | -1.499.375 |
| Aktien im Umlauf am Ende des Berichtszeitraums | 7.028.273 | 7.928.402 |

Anhang

Rechnungslegungsgrundsätze

Bilanzierungsgrundlage

Die Finanzaufstellungen wurden im Einklang mit den luxemburger Vorschriften über Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt.

Die Basiswährung von Allianz European Pension Investments ist der Euro (EUR).

Die Basiswährungen der Teilfonds sind nachstehend aufgeführt:

| Name des Teilfonds | Basiswährung |
|---------------------|--------------|
| Allianz Strategy 50 | EUR |

Bewertung der Vermögensgegenstände

Vermögensgegenstände, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren bezahlten Kurs bewertet.

Vermögensgegenstände, die nicht an einer Börse amtlich notiert sind, jedoch an einem geregelten Markt bzw. an anderen organisierten Märkten gehandelt werden, werden ebenfalls zum letzten verfügbaren bezahlten Kurs bewertet, sofern die Verwaltungsgesellschaft zur Zeit der Bewertung diesen Kurs für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögensgegenstände verkauft werden können.

Vermögensgegenstände, deren Kurse nicht marktgerecht sind, sowie alle anderen Vermögensgegenstände werden zum wahrscheinlichen Realisierungswert bewertet. Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie der Ansicht ist, dass diese den angemessenen Wert der Vermögensgegenstände besser darstellen.

Finanzterminkontrakte über Devisen, Wertpapiere, Finanzindizes, Zinsen und sonstige zulässige Finanzinstrumente sowie Optionen darauf und entsprechende Optionsscheine werden, soweit sie an einer Börse notiert sind, mit den zuletzt festgestellten Kursen der betreffenden Börse bewertet. Soweit keine Börsennotiz besteht, insbesondere bei sämtlichen OTC-Geschäften, erfolgt die Bewertung zum wahrscheinlichen Realisierungswert.

Zinsswaps werden zu ihrem Marktwert in Bezug auf die anwendbare Zinskurve bewertet. An Indizes und an Finanzinstrumente gebundene Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet, der unter Bezugnahme auf den betreffenden Index oder das betreffende Finanzinstrument ermittelt wird.

Swaps auf Indizes und Finanzinstrumente werden zu ihrem Marktwert bewertet, der unter Bezugnahme auf den jeweiligen Index oder das jeweilige Finanzinstrument ermittelt wird. Die Bewertung der Swap-Vereinbarung für Indizes und Finanzinstrumente basiert auf dem Marktwert dieses Swap-Geschäfts, der nach Treu und Glauben gemäß vom Verwaltungsrat festgelegten Verfahren ermittelt wird.

Aktien an OGAW oder OGA werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Rücknahmepreis bewertet.

Flüssige Mittel und Festgelder werden zu deren Nennwert zuzüglich Zinsen bewertet.

Nicht auf die für den Teilfonds festgelegte Währung (nachstehend „Basiswährung des Fonds“) lautende Vermögensgegenstände werden zu dem letzten Devisenmittelkurs in die Basiswährung des Teilfonds umgerechnet.

Wertpapierkurse

Die Berechnung des Nettoinventarwerts erfolgt im Einklang mit den Bestimmungen des Verkaufsprospekts anhand der am Bewertungstag zuletzt bekannten Wertpapierkurse.

Die Finanzaufstellungen des Berichts wurden auf der Grundlage der Wertpapierkurse des zuletzt errechneten und veröffentlichten Nettoinventarwerts des Berichtszeitraums erstellt.

Ertragsausweis

Zinserträge laufen täglich auf. Zinserträge der Bank werden periodengerecht abgegrenzt. Dividendenerträge laufen zum Ex-Dividende-Termin auf. Diese Erträge werden nach Abzug der Quellensteuern ausgewiesen.

Fremdwährungen

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in fremder Währung wurden zu folgenden Devisenkursen umgerechnet:

| | | | |
|----------------------|-------|-------------|------------|
| Australischer Dollar | (AUD) | 1 EUR = AUD | 1,510018 |
| Britisches Pfund | (GBP) | 1 EUR = GBP | 0,876917 |
| Kanadischer Dollar | (CAD) | 1 EUR = CAD | 1,344365 |
| Japanischer Yen | (JPY) | 1 EUR = JPY | 141,886941 |
| Schweizer Franken | (CHF) | 1 EUR = CHF | 0,960289 |
| US-Dollar | (USD) | 1 EUR = USD | 0,983550 |

Pauschalvergütung

Die Gesellschaft zahlt aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds sämtliche von dem Teilfonds zu tragende Kosten:

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft aus dem Vermögen des jeweiligen Teilfonds eine Vergütung („Pauschalvergütung“), es sei denn, diese Vergütung wird im Rahmen einer besonderen Aktienklasse direkt dem Aktionär in Rechnung gestellt.

Die Vergütungen der von der Verwaltungsgesellschaft eingesetzten Investmentmanager zahlt die Verwaltungsgesellschaft aus ihrer Pauschalvergütung und ggf. aus ihrer erfolgsbezogenen Vergütung.

Die Pauschalvergütung wird nachträglich monatlich gezahlt und anteilig auf den durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der jeweiligen Aktienklasse eines Teilfonds berechnet, es sei denn, diese Vergütung wird im Rahmen einer besonderen Aktienklasse direkt dem Aktionär in Rechnung gestellt.

Als Ausgleich für die Zahlung der Pauschalvergütung stellt die Verwaltungsgesellschaft die Gesellschaft von folgenden, abschließend aufgezählten Vergütungen und Aufwendungen frei:

- Verwaltungs- und Zentralverwaltungsvergütungen;
- Vertriebsgebühren;
- die Verwahrstellengebühr;
- die Gebühr der Register- und Transferstelle;

– Kosten für die Erstellung (inklusive Übersetzung) und den Versand des vollständigen Verkaufsprospekts, der Wesentlichen Anlegerinformationen, der Satzung sowie der Jahres-, Halbjahres- und ggf. Zwischenberichte sowie anderer Berichte und Mitteilungen an Aktionäre;

– Kosten für die Veröffentlichung des Verkaufsprospekts, der Wesentlichen Anlegerinformationen, der Satzung, der Jahres-, Halbjahres- und ggf. Zwischenberichte, sonstiger Berichte und Mitteilungen an die Aktionäre, der Steuerinformationen, der Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie offizieller Bekanntmachungen an die Aktionäre;

– die Kosten für die Rechnungsprüfung der Gesellschaft und ihrer Teilfonds durch den Abschlussprüfer;

– Kosten für die Registrierung der Aktien zum öffentlichen Vertrieb und/oder der Aufrechterhaltung einer solchen Registrierung;

– die Kosten für die Erstellung von Aktienzertifikaten und ggf. Kupons und Kuponerneuerungen;

– die Gebühren der Zahl- und Informationsstelle;

– Kosten für die Beurteilung der Teilfonds durch national und international anerkannte Rating-Agenturen;

– Aufwendungen im Zusammenhang mit der Errichtung eines Teilfonds;

– Kosten im Zusammenhang mit der Nutzung von Indexnamen, insbesondere Lizenzgebühren;

– Kosten und Auslagen der Gesellschaft sowie von ihr bevollmächtigter Dritter im Zusammenhang mit dem Erwerb, der Nutzung und der Aufrechterhaltung eigener oder fremder EDV-Systeme, die von den Fondsmanagern und Anlageberatern verwendet werden;

– Kosten im Zusammenhang mit dem Erlangen und Aufrechterhalten eines Status, der dazu berechtigt, in einem Land direkt in Vermögensgegenstände zu investieren oder an Märkten in einem Land direkt als Vertragspartner auftreten zu können;

– Kosten und Auslagen der Gesellschaft, der Verwahrstelle sowie von diesen beauftragter Dritter im Zusammenhang mit der Überwachung von Anlagegrenzen und -restriktionen;

– Kosten für die Ermittlung der Risiko- und Performancekennzahlen sowie der Berechnung einer erfolgsbezogenen Vergütung für die Verwaltungsgesellschaft durch beauftragte Dritte;

– Kosten im Zusammenhang mit der Informationsbeschaffung über Hauptversammlungen von Unternehmen oder über sonstige Versammlungen der Inhaber von Vermögensgegenständen sowie Kosten im Zusammenhang mit der eigenen Teilnahme oder der beauftragter Dritter an solchen Versammlungen;

– Porto-, Telefon-, Fax- und Telex-Kosten.

Besteuerung

Die Gesellschaft unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer „Taxe d'Abonnement“, die für das gesamte Nettovermögen der Teilfonds jeweils am Quartalsende berechnet wird und entsprechend zahlbar ist, es sei denn, das Vermögen wird in Luxemburger Fonds investiert, die ihrerseits einer „Taxe d'Abonnement“ unterliegen. Die Gesellschaft unterliegt in Luxemburg einer Steuer von 0,05 % p. a. ihres Nettoinventarwerts für private Aktienklassen und von 0,01 % p. a. für institutionelle Aktienklassen. Diese Steuer ist vierteljährlich zahlbar, und ihre Bemessungsgrundlage ist das Nettovermögen des Teilfonds am betreffenden Quartalsende. Die Erträge der Teilfonds sind in Luxemburg nicht steuerpflichtig. Ausgeschüttete und thesaurierte Erträge aus Aktien sind in Luxemburg derzeit nicht quellensteuerpflichtig.

Gebührenstruktur

| | Pauschalvergütung | | Taxe d'Abonnement | |
|-------------------------------------|-------------------|--|-------------------|--|
| | in % p.a. | | in % p.a. | |
| Allianz Strategy 50 | | | | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | 1,35 | | 0,05 | |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | 1,35 | | 0,05 | |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | 0,85 | | 0,05 | |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | 1,39 | | 0,01 | |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | 0,45 | | 0,05 | |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | 0,65 | | 0,05 | |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | 0,65 | | 0,05 | |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | 0,65 | | 0,05 | |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | 0,45 | | 0,01 | |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | 1,35 | | 0,05 | |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | 0,65 | | 0,05 | |
| - Klasse RT (H-USD) (thesaurierend) | 0,65 | | 0,05 | |

Transaktionskosten

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis 30. September 2022 für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von bestimmten Vermögensgegenständen stehen.

Die transaktionsbezogenen Kosten sind durch die Administrationsgebühr/Depotbankvergütung abgegolten.

| Name des Teilfonds | in EUR |
|---------------------|------------|
| Allianz Strategy 50 | 275.243,81 |

Retrozession der Verwaltungsvergütung

Die Gebühren für die Anlageverwaltung mancher zugrunde liegender Fonds, in die einige Teilfonds investieren, werden von den Fondsmanagern dieser zugrunde liegenden Fonds ganz oder teilweise erstattet. Die Fondsmanager haben mit Allianz Global Investors GmbH entsprechende Vereinbarungen getroffen. Diese Beträge sind unter „Sonstige Erträge“ aufgeführt.

Wenn ein Teilfonds Anteile eines OGAW oder OGA erwirbt, der direkt oder indirekt vom selben Fondsmanager oder von einem anderen Fondsmanager verwaltet wird, mit dem die Gesellschaft durch gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder

durch eine wesentliche unmittelbare oder mittelbare Beteiligung gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 zu Organismen für gemeinsame Anlagen verbunden ist, so dürfen weder die Gesellschaft noch der verbundene Fondsmanager für die Zeichnung oder den Rückkauf der Anteile Gebühren berechnen. Im Fall des vorhergehenden Satzes wird die Gesellschaft zudem ihre Pauschalvergütung für den auf Anteile an solchen verbundenen OGAW oder OGA entfallenden Teil jeweils um die von den erworbenen OGAW oder OGA tatsächlich berechnete fixe Verwaltungsvergütung kürzen. Eine Kürzung im Hinblick auf diese verbundenen OGAW oder OGA erfolgt jedoch nicht, insoweit dem jeweiligen Teilfonds diese tatsächlich berechnete fixe Verwaltungsvergütung gutgeschrieben wird.

Wertpapierleihen

Bitte beachten Sie, dass zum 30. September 2022 keine Leihposition besteht, da das Programm seit November 2020 geschlossen ist.

Laufende Kosten

Die laufenden Kosten sind die bei der Verwaltung der Teilfonds innerhalb des vorangegangenen Geschäftsjahres zulas- ten der Teilfonds (bzw. der jeweiligen Aktienklasse) angefallenen Kosten (ohne Transaktionskosten) und werden als Quote des durchschnittlichen Fondsvolumens (bzw. des durchschnittlichen Volumens der jeweiligen Aktienklasse) ausgewiesen („laufende Kosten“). Berücksichtigt werden neben der Pauschalvergütung sowie der Taxe d'Abonnement alle übrigen Kosten mit Ausnahme der angefallenen Transaktionskosten sowie etwaiger erfolgsbezogener Vergütungen. Ein Aufwands- ausgleich für die angefallenen Kosten wird nicht bei der Be-

rechnung berücksichtigt. Legt der Teilfonds mehr als 20 % sei- ner Vermögenswerte in anderen OGAW oder OGA an, die lau- fende Kosten veröffentlichen, werden bei der Ermittlung der laufenden Kosten des Fonds die laufenden Kosten der ande- ren OGAW oder OGA berücksichtigt; veröffentlichen diese OGAW oder OGA allerdings keine eigenen laufenden Kosten, ist insoweit für die Berechnung eine Berücksichtigung der lau- fenden Kosten der anderen OGAW oder OGA bei der Ermitt- lung der laufenden Kosten nicht möglich. Legt ein Teilfonds nicht mehr als 20 % seiner Vermögenswerte in anderen OGAW oder OGA an, werden Kosten, die eventuell auf Ebene dieser OGAW oder OGA anfallen, nicht berücksichtigt.

Laufende Kosten in %

| | Laufende Kosten in % |
|-------------------------------------|----------------------|
| Allianz Strategy 50 | |
| - Klasse A (EUR) (ausschüttend) | 1,40 |
| - Klasse CT (EUR) (thesaurierend) | 1,40 |
| - Klasse C2 (EUR) (ausschüttend) | 0,91 |
| - Klasse IT (EUR) (thesaurierend) | 1,40 |
| - Klasse NT (EUR) (thesaurierend) | 0,50 |
| - Klasse P (EUR) (ausschüttend) | 0,70 |
| - Klasse PT (EUR) (thesaurierend) | 0,70 |
| - Klasse RT (EUR) (thesaurierend) | 0,70 |
| - Klasse WT (EUR) (thesaurierend) | 0,46 |
| - Klasse AT (H-USD) (thesaurierend) | 1,40 |
| - Klasse PT (USD) (thesaurierend) | 0,70 |
| - Klasse RT (H-USD) (thesaurierend) | 0,69 |



Prüfungsvermerk

An die Aktionäre der
Allianz European Pension Investments

Unser Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Allianz European Pension Investments (der „Fonds“) und ihrer jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2022 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Fondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Was wir geprüft haben

Der Abschluss des Fonds besteht aus:

- der Zusammensetzung des kombinierten Vermögens des Fonds und der Zusammensetzung des Vermögens der Teilfonds zum 30. September 2022;
- der Vermögensaufstellung der Teilfonds zum 30. September 2022;
- der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds und der Ertrags- und Aufwandsrechnung der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr;
- der Entwicklung des kombinierten Vermögens des Fonds und der Entwicklung des Vermögens der Teilfonds für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr; und
- dem Anhang, einschließlich einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISAs) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs wird im Abschnitt „Verantwortung des „Réviseur d’entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung“ weitergehend beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards“, herausgegeben vom „International Ethics Standards Board for Accountants“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, sowie den beruflichen Verhaltensanforderungen, die wir im Rahmen der Abschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt.



Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Abschluss und unseren Prüfungsvermerk zu diesem Abschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Abschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Abschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnenen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Abschlusses, und für die internen Kontrollen, die er als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Abschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds und seiner Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit und, sofern einschlägig, Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Tätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren oder einen seiner Teilfonds zu schließen, die Geschäftstätigkeit einzustellen, oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

Verantwortung des „Réviseur d’entreprises agréé“ für die Abschlussprüfung

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist, und darüber einen Prüfungsvermerk, der unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentliche falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Unzutreffende Angaben können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.



Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Abschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können;
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und den entsprechenden Anhangsangaben;
- schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Tätigkeit durch den Verwaltungsrat des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Tätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Prüfungsvermerk auf die dazugehörigen Anhangsangaben zum Abschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Prüfungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds seine Tätigkeit nicht mehr fortführen kann;
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Anhangsangaben, und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, die wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 19. Dezember 2022

Sandra Paulis

Weitere Informationen (ungeprüft)

Ermittlung des Marktrisikos und Hebelwirkung

Im Rahmen des Risikomanagement-Verfahrens wird das Marktrisiko des Fonds entweder über den Commitment-Ansatz oder den Value-at-Risk (relativer oder absoluter VaR-Ansatz) gemessen und limitiert. Der Commitment-Ansatz berücksichtigt bei der Ermittlung des Marktrisikos des Fonds das zusätzliche Risiko, welches durch den Einsatz von derivativen

Finanzinstrumenten generiert wird. Der VaR-Ansatz repräsentiert eine statistische Methode zur Berechnung des Verlustpotentials auf Grund von Wertänderungen des gesamten Fonds. Die VaR-Berechnung basiert grundsätzlich auf der „Delta Normal“-Methode (Konfidenzniveau von 99 %, eine angenommene Haltedauer von 10 Tagen, verwendete Datenhistorie von 260 Tagen), ansonsten ist die abweichende Berechnungsmethodik in der folgenden Tabelle ersichtlich.

Zum Geschäftsjahresende war für die Teilfonds folgender Ansatz zur Berechnung des Marktrisikos gültig:

| Name des Teilfonds | Ansatz | Vergleichsvermögen/absolutes VaR Limit |
|---------------------|------------|--|
| Allianz Strategy 50 | Commitment | - |

Aus der folgenden Tabelle kann die minimale, maximale und durchschnittliche Risikobudgetauslastung (RBA) der Teilfonds im Berichtszeitraum entnommen werden. Bei Teilfonds mit relativem VaR-Ansatz wird die Auslastung gegenüber dem regulatorisch festgelegten Limit (d. h. 2 mal VaR des definierten Vergleichsvermögens), bei Teilfonds mit absolutem VaR-Ansatz gegenüber dem in der obigen Tabelle ersichtlichen abso-

luten VaR-Limit ausgewiesen. Darüber hinaus ist der Tabelle die durchschnittliche Hebelwirkung der Teilfonds im Berichtszeitraum zu entnehmen. Die durchschnittliche Hebelwirkung wird als die durchschnittliche Summe der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet.

| Name des Teilfonds | Durchschnittliche Hebelwirkung in % | Minimale RBA in % | Maximale RBA in % | Durchschnittliche RBA in % |
|---------------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|----------------------------|
| Allianz Strategy 50 | - | - | - | - |

Weitere Informationen (ungeprüft)

Angaben zur Mitarbeitervergütung (alle Werte in EUR) der Allianz Global Investors GmbH für das Geschäftsjahr vom 01.01.2021 bis zum 31.12.2021

Die folgende Aufstellung zeigt die Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr tatsächlich gezahlten Vergütungszahlen für Mitarbeiter der Allianz Global Investors GmbH („Verwaltungsgesellschaft“ oder „AllianzGI“) gegliedert in fixe und variable Bestandteile sowie nach Geschäftsleitern, Risiko-

trägern, Beschäftigten mit Kontrollfunktionen und Mitarbeitern, die eine Gesamtvergütung erhalten, auf Grund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Geschäftsleiter und Risikoträger.

Anzahl Mitarbeiter 1.668

| | | davon Risk Taker | davon Geschäftsleiter | davon andere Risk Taker | davon mit Kontrollfunktion | davon mit gleichem Einkommen |
|--------------------|-------------|---------------------|--------------------------|----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|
| Fixe Vergütung | 155.709.850 | 6.149.684 | 853.418 | 1.430.671 | 220.480 | 3.645.115 |
| Variable Vergütung | 103.775.068 | 10.383.891 | 746.730 | 1.949.415 | 155.462 | 7.532.283 |
| Gesamtvergütung | 259.484.918 | 16.533.575 | 1.600.148 | 3.380.086 | 375.942 | 11.177.398 |

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung enthalten keine Vergütungen, die von ausgelagerten Managern an deren Mitarbeiter gezahlt werden. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft zahlt keine direkten Vergütungen aus dem Fonds an Mitarbeiter der Auslagerungsunternehmen.

Festlegung der Vergütung

Allianz Global Investors GmbH („Verwaltungsgesellschaft“) unterliegt den für die Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung des Vergütungssystems. Für die Entscheidung über die Festlegung der Vergütung der Mitarbeiter ist regelmäßig die Geschäftsführung der Allianz Global Investors GmbH („Verwaltungsgesellschaft“) zuständig. Für die Geschäftsführung selbst liegt die Entscheidung über die Festlegung der Vergütung beim Gesellschafter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Die „Verwaltungsgesellschaft“ hat einen Vergütungsausschuss eingerichtet, der die gesetzlich vorgeschriebenen Aufgaben wahrnimmt. Dieser Vergütungsausschuss setzt sich zusammen aus zwei Mitgliedern des Aufsichtsrats der Gesellschaft, die jeweils vom Aufsichtsrat gewählt werden, wobei ein Mitglied ein Mitarbeitervertreter sein sollte.

Der Bereich Personal entwickelte in enger Zusammenarbeit mit den Bereichen Risikomanagement und Recht & Compliance sowie externen Beratern und unter Einbindung der Ge-

schäftsführung die Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft unter den Anforderungen der OGAW und AIFM-Richtlinie. Diese Vergütungspolitik gilt sowohl für die in Deutschland ansässige Verwaltungsgesellschaft als auch deren Zweigniederlassungen.

Vergütungsstruktur

Die Hauptkomponenten der monetären Vergütung sind das Grundgehalt, das typischerweise den Aufgabenbereich, Verantwortlichkeiten und Erfahrung widerspiegelt, wie sie für eine bestimmte Funktion erforderlich sind, sowie die Gewährung einer jährlichen variablen Vergütung.

Die Summe der unternehmensweit bereitzustellenden variablen Vergütungen ist vom Geschäftserfolg sowie der Risikoposition der Verwaltungsgesellschaft abhängig und schwankt daher von Jahr zu Jahr. In diesem Rahmen orientiert sich die Zuweisung konkreter Beträge zu einzelnen Mitarbeitern an der Leistung des Mitarbeiters bzw. seiner Abteilung während der jeweiligen Betrachtungsperiode.

Die variable Vergütung umfasst eine jährliche Bonuszahlung in bar nach Abschluss des Geschäftsjahres. Für Beschäftigte deren variable Vergütung einen bestimmten Wert überschreitet, wird ein signifikanter Anteil der jährlichen variablen Vergütung um drei Jahre aufgeschoben.

Weitere Informationen (ungeprüft)

Die aufgeschobenen Anteile steigen entsprechend der Höhe der variablen Vergütung. Die Hälfte des aufgeschobenen Betrags ist an die Leistung der Verwaltungsgesellschaft gebunden, die andere Hälfte wird in von AllianzGI verwaltete Fonds investiert. Die letztendlich zur Auszahlung kommenden Beträge sind vom Geschäftserfolg der Verwaltungsgesellschaft oder der Wertentwicklung von Anteilen an bestimmten Investmentfonds während einer mehrjährigen Periode abhängig.

Des Weiteren können die aufgeschobenen Vergütungselemente gemäß der Planbedingungen verfallen.

Leistungsbewertung

Die Höhe der Zahlung an die Mitarbeiter ist an qualitative und quantitative Leistungsindikatoren geknüpft.

Für Investment Manager, deren Entscheidungen große Auswirkungen auf den Erfolg der Investmentziele unserer Kunden haben, orientieren sich quantitative Indikatoren an einer nachhaltigen Anlage-Performance. Insbesondere bei Portfolio Managern orientiert sich das quantitative Element an der Benchmark des Kundenportfolios oder an der vom Kunden vorgegebenen Renditeerwartung - gemessen über einen mehrjährigen Zeitraum.

Zu den Zielen von Mitarbeitern im direkten Kundenkontakt gehört auch die unabhängig gemessene Kundenzufriedenheit.

Die Vergütung der Mitarbeiter in Kontrollfunktionen ist nicht unmittelbar an den Geschäftserfolg einzelner von der Kontrollfunktion überwachten Bereiche gekoppelt.

Risikoträger

Als Risikoträger wurden folgende Mitarbeitergruppen qualifiziert: Mitarbeiter der Geschäftsleitung, Risikoträger und Mitar-

beiter mit Kontrollfunktionen (welche anhand aktueller Organisation Diagramme und Stellenprofile identifiziert, sowie anhand einer Einschätzung hinsichtlich des Einflusses auf das Risikoprofils beurteilt wurden) sowie alle Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, aufgrund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Mitglieder der Geschäftsleistung und Risikoträger, und deren Tätigkeit sich wesentlich auf die Risikoprofile der Gesellschaft und der von dieser verwalteten Investmentvermögen auswirkt.

Risikovermeidung

AllianzGI verfügt über ein umfangreiches Risikoreporting, das sowohl aktuelle und zukünftige Risiken im Rahmen unserer Geschäftstätigkeit berücksichtigt. Risiken, welche den Risikoappetit der Organisation überschreiten, werden unserem Globalen Vergütungsausschuss vorgelegt, welcher ggf. über die eine Anpassung des Gesamt-Vergütungspools entscheidet.

Auch individuelle variable Vergütung kann im Fall von Verstößen gegen unsere Compliance Richtlinien oder durch Eingehen zu hoher Risiken für die Kapitalverwaltungsgesellschaft reduziert oder komplett gestrichen werden.

Jährliche Überprüfung und wesentliche Änderungen des Vergütungssystems

Der Vergütungsausschuss hat während der jährlichen Überprüfung des Vergütungssystems, einschließlich der Überprüfung der bestehenden Vergütungsstrukturen sowie der Umsetzung und Einhaltung der regulatorischen Anforderungen, keine Unregelmäßigkeiten festgestellt. Durch diese zentrale und unabhängige Überprüfung wurde zudem festgestellt, dass die Vergütungspolitik gemäß den vom Aufsichtsrat festgelegten Vergütungsvorschriften umgesetzt wurde. Ferner gab es im abgelaufenen Geschäftsjahr keine wesentlichen Änderungen der Vergütungspolitik.

Weitere Informationen (ungeprüft)

Techniken einer effizienten Portfolioverwaltung

Die Abschnitte 35 (a)-(c), 40 (a)-(c) und 48 (a),(b) der Leitlinie der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (European Securities and Markets Authority, ESMA) zu börsengehandelten Indexfonds (ETF) und zu anderen OGAW-Themen (ES-MA/2014/937) erfordern die Offenlegung von Risiken im Jahresbericht des Fonds, die im Zusammenhang mit Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung (Wertpapierleihe, Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte) und/oder Derivaten eingegangen werden, die Offenlegung der Identität der Kontrahenten dieser Transaktionen, Nachweise in Bezug auf Art und Höhe der diesbezüglich erhaltenen Sicherheiten sowie Nachweise über die Identität von Emittenten in Zusammenhang mit den OTC-Derivaten und Sicherheiten in Form von Wertpapieren, die von einem Mitgliedstaat begeben werden.

Das minimale, maximale und durchschnittliche Risiko, das während des Berichtszeitraums eingegangen wurde, wird in der folgenden Tabelle, untergliedert nach eingesetzter Technik, aufgeführt. Die Risikoangaben zum minimalen oder maximalen Engagement der Gesellschaft werden im Verhältnis zum Vermögen der Gesellschaft an dem jeweiligen Tag mit dem minimalen oder maximalen während des Berichtszeitraums eingegangenen Risiko aufgezeigt. Das durchschnittliche Risiko wird als einfacher Durchschnitt des täglichen Risikos der Gesellschaft im Verhältnis zu ihrem Vermögen an dem jeweiligen Tag berechnet. Das Risiko (Kontrahentenrisiko) aufgrund des Einsatzes von Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung oder von Derivaten wurde für börsengehandelte Derivate, OTC-Derivate (inklusive Total Return Swaps), Pensionsgeschäfte (inklusive umgekehrter Pensionsgeschäfte) und Wertpapierleihgeschäfte separat analysiert.

| | Instrument | Minimales Risiko in % | Maximales Risiko in % | Durchschnittliches Risiko in % |
|---------------------|---|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|
| Allianz Strategy 50 | Börsengehandelte Derivate ¹⁾ | 0,00 | 3,43 | 0,81 |
| | OTC-Derivate | 0,00 | 0,21 | 0,01 |
| | Rückkaufvereinbarungen (Repos/ Reverse-Repos) ²⁾ | - | - | - |
| | Wertpapierleihe ³⁾ | - | - | - |

¹⁾ Im Berichtszeitraum hatte der Teilfonds keine Positionen in börsengehandelten Derivaten.

²⁾ Im Berichtszeitraum hatte der Teilfonds keine Rückkaufvereinbarungen getätigt.

³⁾ Im Berichtszeitraum ist der Teilfonds keine Vereinbarungen in Form von Wertpapierleihen eingegangen.

⁴⁾ Im Berichtszeitraum hatte der Teilfonds Positionen in börsengehandelten Derivaten, die jedoch zu jedem Zeitpunkt mit einer Initial und Variation Margin hinterlegt waren und daher kein offenes Exposure hatten.

Folgender Tabelle können die minimalen, maximalen und durchschnittlichen Beträge der erhaltenen Sicherheiten zur Reduzierung des Kontrahentenrisikos der Gesellschaft entnommen werden. Die minimalen und maximalen Sicherheiten der Gesellschaft werden als prozentualer Anteil am Vermögen der Gesellschaft am jeweiligen Tag des Berichtszeitraums dargestellt. Der durchschnittliche Betrag der Sicherheiten wird als einfacher Durchschnitt des täglichen Betrags der Sicherheiten, berechnet als prozentualer Anteil am Vermögen der Gesellschaft an jedem Tag, wiedergegeben.

| | Sicherheiten (Minimum in %) | Sicherheiten (Maximum in %) | Sicherheiten (Durchschnittlich in %) |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| Allianz Strategy 50 | 0,00 | 0,21 | 0,01 |

Weitere Informationen (ungeprüft)

Die Gesellschaft hat im Berichtszeitraum Geschäfte im Rahmen effizienter Portfolioverwaltung bzw. Derivate mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

State Street Corp, Barclays Plc, BNP Paribas SA.

Zum Berichtsstichtag gab es keinen Emittenten, bei welchem die von diesem Emittenten erhaltenen Sicherheiten 20 % des Nettoinventarwerts der Gesellschaft überschreiten.

Zum Berichtsstichtag wurde die Gesellschaft nicht vollständig durch Wertpapiere besichert, die von einem Mitgliedstaat begeben oder garantiert werden.

Während des Berichtszeitraums wurden keine Einnahmen gemäß Abschnitt 35 (d) aus Techniken eines effizienten Portfoliomanagements erzielt, einschließlich direkter und indirekter Betriebskosten und angefallener Gebühren für die Teilfonds.

Weitere Informationen (ungeprüft)

Ausschüttungspolitik

Wir verweisen auf die Registerkarte „Ausschüttung“ unter den Abschnitten für die einzelnen Teilfonds auf der Website von Allianz Global Investors: <https://regulatory.allianzgi.com>

Taxonomieverordnung in Verbindung mit der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungsverordnung

Die Anlagen, die diesem Teilfonds zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für eine ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit.

Hinweis für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

1. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz

Für die in der Schweiz vertriebenen Aktien ist die BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz.

2. Bezugsort der massgeblichen Dokumente

Der Verkaufsprospekt, das Verwaltungsreglement, die wesentlichen Anlegerinformationen, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Aufstellung der Änderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierportfolios während des Referenzzeitraums sind beim Vertreter in der Schweiz kostenlos erhältlich.

3. Publikationen

Publikationsorgan in der Schweiz ist www.fundinfo.com. In der Schweiz werden Ausgabe- und Rücknahmepreise gemeinsam bzw. der Nettoinventarwert (mit dem Hinweis „exklusive Kommissionen“) der Anteile täglich auf www.fundinfo.com publiziert.

4. Zahlung von Retrozessionen und Rabatten

Retrozessionen:

Die Verwaltungsgesellschaft sowie ihre Beauftragten können Retrozessionen zur Entschädigung der Vertriebstätigkeit von Aktien in der Schweiz oder von der Schweiz aus bezahlen. Mit dieser Entschädigung können insbesondere folgende Dienstleistungen abgegolten werden:

- Einrichten von Prozessen für die Zeichnung und das Halten bzw. Verwahren der Aktien;
- Erstellung, Vorrätighalten und Abgabe von Marketing- und rechtlichen Dokumenten;
- Weiterleiten bzw. Zugänglichmachen von gesetzlich vorgeschriebenen und anderen Publikationen;
- Wahrnehmung von durch die Verwaltungsgesellschaft delegierten Sorgfaltspflichten in Bereichen wie Geldwäscherei, Abklärung der Kundenbedürfnisse und Vertriebsbeschränkungen;

- Beauftragung einer zugelassenen Prüfgesellschaft mit der Prüfung der Einhaltung gewisser Pflichten des Vertriebssträgers, insbesondere der Richtlinien für den Vertrieb kollektiver Kapitalanlagen der Asset Management Association Switzerland (AMAS);

- Betrieb und Unterhalt einer elektronischen Vertriebs- und/oder Informationsplattform;

- Abklären und Beantworten von auf die Verwaltungsgesellschaft, die Fonds oder die Sub-Investmentmanager bezogenen speziellen Anfragen von Anlegern;

- Erstellen von Fondsresearch-Material;

- Zentrales Relationship Management;

- Zeichnen von Aktien als Nominee für verschiedene Kunden nach Instruktion durch die Verwaltungsgesellschaft;

- Schulung von Kundenberatern im Bereich der kollektiven Kapitalanlagen;

- Beauftragung und Überwachung von weiteren Vertriebssträgern.

Retrozessionen gelten nicht als Rabatte auch wenn sie ganz oder teilweise letztendlich an die Anleger weitergeleitet werden.

Die Empfänger der Retrozessionen gewährleisten eine transparente Offenlegung und informieren den Anleger von sich aus kostenlos über die Höhe der Entschädigungen, die sie für den Vertrieb erhalten könnten.

Auf Anfrage legen die Empfänger der Retrozessionen die effektiv erhaltenen Beträge, welche sie für den Vertrieb der kollektiven Kapitalanlagen dieser Anleger erhalten, offen.

Rabatte:

Die Verwaltungsgesellschaft und deren Beauftragte können im Vertrieb in der Schweiz oder von der Schweiz aus Rabatte auf Verlangen direkt an Anleger bezahlen. Rabatte dienen dazu, die auf die betreffenden Anleger entfallenden Gebühren oder Kosten zu reduzieren. Rabatte sind zulässig, sofern sie

- aus Gebühren der Verwaltungsgesellschaft bezahlt werden und somit das Fondsvermögen nicht zusätzlich belasten;
- aufgrund von objektiven Kriterien gewährt werden;
- sämtlichen Anlegern, welche die objektiven Kriterien erfüllen und Rabatte verlangen, unter gleichen zeitlichen Voraussetzungen im gleichen Umfang gewährt werden.

Die objektiven Kriterien zur Gewährung von Rabatten durch die Verwaltungsgesellschaft sind:

- Das vom Anleger gezeichnete Volumen bzw. das von ihm gehaltene Gesamtvolumen in der kollektiven Kapitalanlage oder gegebenenfalls in der Produktpalette des Promoters;
- die Höhe der vom Anleger generierten Gebühren;
- das vom Anleger praktizierte Anlageverhalten (z.B. erwartete Anlagedauer);
- die Unterstützungsbereitschaft des Anlegers in der Lancierungsphase einer kollektiven Kapitalanlage.

Auf Anfrage des Anlegers legt die Verwaltungsgesellschaft die entsprechende Höhe der Rabatte kostenlos offen.

5. Erfüllungsort und Gerichtsstand

Erfüllungsort und Gerichtsstand ist mit Bezug auf die in der Schweiz vertriebenen Aktien der Sitz des Vertreters in der Schweiz.

Der folgende Teilfonds ist in der Schweiz seit 30.09.2015 registriert: Allianz Strategy 50.

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Allianz Strategy 50

Vermögenswerte im Zusammenhang mit jeder Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps in EUR in % des Fondsvermögens

| | | |
|---|---|---|
| Das durch Total Return Swaps erzielte zugrundeliegende Exposure | - | - |
| Das durch Wertpapierdarlehen erzielte zugrundeliegende Exposure | - | - |
| Das durch Pensionsgeschäfte erzielte zugrundeliegende Exposure | - | - |

Die 10 größten Gegenparteien jeder Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR 1. Sitzstaat

| | | |
|--|---|---|
| für Total Return Swaps | - | - |
| für Wertpapierdarlehen | - | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | - | - |

Art(en) von Abwicklung und Clearing

Total Return Swaps: bilateral
Wertpapierdarlehen: trilateral
Pensionsgeschäfte: bilateral

Laufzeit von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps Bruttovolumen offene Geschäfte in EUR

| | |
|--|---|
| für Total Return Swaps | |
| - unter 1 Tag | - |
| - 1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage) | - |
| - 1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage) | - |
| - 1 bis 3 Monate | - |
| - 3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage) | - |
| - über 1 Jahr | - |
| - unbefristet | - |
| für Wertpapierdarlehen | |
| - unbefristet | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | |
| - unbefristet | - |

Art(en) der erhaltenen Sicherheiten Marktwert der Sicherheiten in EUR

| | |
|--|---|
| für Total Return Swaps | |
| - Bankguthaben | - |
| - Aktien | - |
| - Schuldverschreibungen | - |
| für Wertpapierdarlehen | |
| - Bankguthaben | - |
| - Aktien | - |
| - Schuldverschreibungen | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | |
| - Bankguthaben | - |
| - Aktien | - |
| - Schuldverschreibungen | - |

| Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten | Marktwert der Sicherheiten in EUR |
|--|--|
| für Total Return Swaps | |
| - AAA (Aaa) | - |
| - AA+ (Aa1) | - |
| - AA (Aa2) | - |
| - AA- (Aa3) | - |
| - A+ (A1) | - |
| - A (A2) | - |
| - A- (A3) | - |
| - BBB+ (Baa1) | - |
| - BBB (Baa2) | - |
| - BBB- (Baa3) | - |
| für Wertpapierdarlehen | |
| - AAA (Aaa) | - |
| - AA+ (Aa1) | - |
| - AA (Aa2) | - |
| - AA- (Aa3) | - |
| - A+ (A1) | - |
| - A (A2) | - |
| - A- (A3) | - |
| - BBB+ (Baa1) | - |
| - BBB (Baa2) | - |
| - BBB- (Baa3) | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | |
| - AAA (Aaa) | - |
| - AA+ (Aa1) | - |
| - AA (Aa2) | - |
| - AA- (Aa3) | - |
| - A+ (A1) | - |
| - A (A2) | - |
| - A- (A3) | - |
| - BBB+ (Baa1) | - |
| - BBB (Baa2) | - |
| - BBB- (Baa3) | - |

| Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten | Marktwert der Sicherheiten in EUR |
|--|--|
| für Total Return Swaps | |
| - EUR | - |
| - USD | - |
| - GBP | - |
| - JPY | - |
| für Wertpapierdarlehen | |
| - EUR | - |

| | |
|--|---|
| - USD | - |
| - GBP | - |
| - JPY | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | |
| - EUR | - |
| - USD | - |
| - GBP | - |
| - JPY | - |

Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten

Marktwert der Sicherheiten in EUR

| | |
|--|---|
| für Total Return Swaps | |
| - unter 1 Tag | - |
| - 1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage) | - |
| - 1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage) | - |
| - 1 bis 3 Monate | - |
| - 3 Monate bis 1 Jahr (= 365 Tage) | - |
| - über 1 Jahr | - |
| - unbefristet | - |
| für Wertpapierdarlehen | |
| - unbefristet | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | |
| - unbefristet | - |

Ertrags- und Kostenanteile

Ertrag/Kosten in EUR in % der Bruttoerträge

| | | |
|--|----------------|-----|
| für Total Return Swaps | | |
| - Ertragsanteil des Fonds | 1.301.868,17 | 100 |
| - Kostenanteil des Fonds | -36.299.347,99 | 100 |
| - Ertragsanteil der KVG | 0 | 0 |
| - Kostenanteil der KVG | - | |
| - Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent) | 0 | 0 |
| - Kostenanteil Dritter | - | |
| für Wertpapierdarlehen | | |
| - Ertragsanteil des Fonds | 0 | 0 |
| - Kostenanteil des Fonds | - | |
| - Ertragsanteil der KVG | 0 | 0 |
| - Kostenanteil der KVG | - | |
| - Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent) | 0 | 0 |
| - Kostenanteil Dritter | - | |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| - Ertragsanteil des Fonds | | |
| - Kostenanteil des Fonds | - | |
| - Ertragsanteil der KVG | 0 | 0 |
| - Kostenanteil der KVG | - | |

| | | |
|--|--|------|
| - Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent) | 0 | 0 |
| - Kostenanteil Dritter | - | |
| Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps | | n.a. |
| Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensggt. des Fonds | | n.a. |
| Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps | Marktwert der Sicherheiten in EUR | |
| für Total Return Swaps | | - |
| für Wertpapierdarlehen | | - |
| für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte | | - |
| Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps | | n.a. |
| Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFin-Gesch. und Total Return Swaps | Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer | 1 |
| Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps | In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps | |
| Verwahrart bestimmt Empfänger | | 100 |

Artikel 173 des französischen Gesetzes zur Energiewende: Portfolio-Berichterstattung in Bezug auf Umwelt, Soziales, Unternehmensführung und Klima-Risiken

Alle relevanten Informationen finden Sie auf der folgenden Website:

<https://regulatory.allianzgi.com/fr-FR/B2C/France-FR/funds/mutual-funds> unter der Registerkarte „Dokumente“ im Abschnitt für den entsprechenden Fonds.

Ihre Partner

Verwaltungsgesellschaft und Zentralverwaltung

Allianz Global Investors GmbH
Bockenheimer Landstraße 42 - 44
D-60323 Frankfurt am Main

Allianz Global Investors GmbH
Zweigniederlassung Luxemburg
6A, route de Trèves
L-2633 Senningerberg

Internet: lu.allianzgi.com
E-mail: info-lux@allianzgi.com

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

Markus Nilles
Verwaltungsratsmitglied – Senior Executive Fund
Boards & Branch Manager
Allianz Global Investors GmbH,
Zweigniederlassung Luxemburg, Senningerberg

Verwaltungsratsmitglieder

Carina Feider
Vice President - Head of Product Setup &
Domiciliation
Allianz Global Investors GmbH,
Zweigniederlassung Luxemburg
Senningerberg

Shariff Ahmed (seit dem 17.02.2022),

Marc Ploner (zurückgetreten am
17.02.2022)

Director - Product Development Europe
Allianz Global Investors GmbH,
Zweigniederlassung UK
London

Die Anlageverwaltung wird von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführt

Allianz Global Investors GmbH
Bockenheimer Landstraße 42-44
D-60323 Frankfurt am Main
Deutschland

Allianz Global Investors GmbH, durch die
Succursale Française (Succursale Française)
handelnd
3, Boulevard des Italiens
75002 Paris,
Frankreich

Investmentmanager/ Investmentmanager eines Teilfonds

Allianz Global Investors Asia Pacific
Limited („AllianzGI AP“)
27/F, ICBC Tower,
3 Garden Road, Central,
Hongkong

AllianzGI AP ist Teil der Allianz Global Investors-
Gruppe, einem Unternehmen des Allianz-
Unternehmenskonzerns.

Allianz Global Investors U.S. LLC
(„AllianzGI US“)
1633 Broadway,
43rd Floor
New York,
NY 10019
USA

600 West Broadway,
31st Floor
San Diego, CA 92101
USA

555 Mission Street,
Suite 1700
San Francisco, CA 94105
USA

Verwahrstelle, Fondsbuchhaltung, Nettoinventarwertermittlung, Register- und Transferstelle

State Street Bank International GmbH,
Zweigniederlassung Luxemburg

49, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Weitere Vertriebsgesellschaften

in Luxemburg

Allianz Global Investors GmbH,
Zweigniederlassung Luxemburg
6A, route de Trèves
L-2633 Senningerberg

in der Bundesrepublik Deutschland

Commerzbank AG
Kaiserplatz
D-60261 Frankfurt am Main

in Frankreich

Allianz Global Investors GmbH,
Succursale Française
3, Boulevard des Italiens
F-75002 Paris

in der Schweiz

Allianz Global Investors
(Schweiz) AG
Gottfried-Keller-Strasse 5
CH-8001 Zurich

Hauptvertriebsstelle Europa

im Vereinigten Königreich

Allianz Global Investors GmbH
Niederlassung Großbritannien,
199 Bishopsgate
London EC2M 3TY
Vereinigtes Königreich

Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Allianz Global Investors GmbH
Bockenheimer Landstraße 42–44
D-60323 Frankfurt am Main
Sales & Product Services
Internet: <https://de.allianzgi.com>
E-mail: info@allianzgi.de

Zahlstelle in der Bundesrepublik Deutschland

State Street Bank International GmbH
Briener Straße 59
D-80333 München

Zahl- und Informationsstellen

in Luxemburg

State Street Bank International GmbH,
Zweigniederlassung Luxemburg
49, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

in Belgien

CACEIS Bank
Avenue du Port / Havenlaan 86C b 320
BE-1000 Brüssel

in der Schweiz

BNP Paribas Securities Services, Paris
succursale de Zurich
Selnaustrasse 16
CH-8002 Zürich

in Frankreich

State Street Bank International GmbH,
Niederlassung Paris
Défense Plaza
23–25, rue Delarivière-Lefouillon
F-92064 Paris La Défense Cedex

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich

Kontakt- und Informationsstelle in Österreich gemäß den Bestimmungen nach EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92:

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Am Belvedere 1
A-1100 Wien

UK Facilities Agent im Vereinigten Königreich

Allianz Global Investors GmbH
UK Branch
199 Bishopsgate London EC2M 3TY

Der Verkaufsprospekt, die Satzung, die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte, die Wesentlichen Anlegerinformationen, die Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie Informationen zur Rücknahme von Aktien sind kostenlos vor und nach Vertragsschluss an der o.g. Adresse erhältlich.

Eventuelle Beschwerden können an den „Complaints Officer“ unter der oben genannten Adresse gerichtet werden. Eine Beschreibung des Prozessablaufs zur Bearbeitung von Beschwerden ist auf Anfrage erhältlich. Darüber hinaus besteht für Beschwerdeführer die Möglichkeit ihre Beschwerden an den Ombudsmann zu adressieren, soweit sie mit der finalen Antwort von Allianz Global Investors GmbH UK Branch nicht einverstanden sind.

Bestellung des inländischen Vertreters gegenüber den Abgabenbehörden in der Republik Österreich

Das folgende Finanzinstitut wurde zum österreichischen Vertreter gegenüber den Steuerbehörden zur Meldung der ausschüttungsgleichen Erträge im Sinne von § 186 Abs. 2 Z. 2 InvFG bestellt:

Deloitte Tax Wirtschaftsprüfungs GmbH
Renngasse 1/Freyung
A-1010 Wien

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers,
Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443 L-1014 Luxemburg

Die Verwaltungsgesellschaft unterliegt in ihrem Sitzland im Hinblick auf das Investmentgeschäft einer staatlichen Aufsicht.

Die Verwaltungsgesellschaft hat der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) ihre Absicht angezeigt, Aktien des Allianz European Pension Investments in Deutschland öffentlich zu vertreiben. Die Rechte aus diesen Vertriebsanzeigen sind nicht erloschen.

Stand: 30. September 2022

