

# Allianz Invest Portfolio Blue

ISIN: AT0000A0HJB4 (A)

ISIN: AT0000A0HJC2 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

## Halbjahresbericht

vom 15.09.2019 – 14.03.2020

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



## Allgemeines zur **Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH**

Gesellschaft	Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH Hietzinger Kai 101-105, 1130 Wien Tel: 01/ 505 54 80; Fax: 01/ 505 54 81
Gründung	29. April 1991
Gesellschafter	Allianz Investmentbank AG
Aufsichtsrat	Dr. Harald Lankisch (Vorsitzender) Univ.-Prof. Dr. Christian Nowotny (Vorsitzender-Stellvertreter) RA Dr. Corvin Hummer Dkfm. Reinhard Pinzer Wolfgang Jerabek (Mitarbeitervertreter) Mag. Daniel Planer (Mitarbeitervertreter)
Geschäftsführung	Michael Bode Mag. Christian Ramberger
Prokuristen	Mag. Doris Kals Mag. Anton Kuzmanoski Mag. Jan Fellmayer
Staatskommissär Staatskommissärstellvertreter	Mag. Heidrun Zanetta AD Thomas Galee
Prüfer	KPMG Austria GmbH Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Depotbank	Allianz Investmentbank AG

## Zusammensetzung des Fondsvermögens per 14. März 2020

<u>1. Wertpapiere</u>	EUR	%
<b>Amtlich notierte Wertpapiere</b>		
Investmentfondsanteile		
EUR	8.899.667,15	60,60
USD	4.741.905,12	32,29
<b>Summe Wertpapiere</b>	<b>13.641.572,27</b>	<b>92,89</b>
 <b><u>2. Derivative Produkte</u></b>		
Devisentermingeschäfte		
EUR	-12.678,15	-0,09
USD	-8.981,54	-0,06
<b>Summe Derivative Produkte</b>	<b>-21.659,69</b>	<b>-0,15</b>
 <b><u>3. Bankguthaben / -verbindlichkeiten</u></b>		
EUR	1.077.385,58	7,34
<b>Summe Bankguthaben / -verbindlichkeiten</b>	<b>1.077.385,58</b>	<b>7,34</b>
 <b><u>4. Abgrenzungen</u></b>		
Anteilige Erträge (aus Wertpapieren/Bankguthaben und Aufwendungen)	<b>-11.639,18</b>	<b>-0,08</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>14.685.658,98</b>	<b>100,00</b>

## Darstellung der Fondsdaten zum Berichtsstichtag:

Fondsdaten in EUR	per 14.09.2019	per 14.03.2020
Fondsvolumen gesamt	15.820.143,93	14.685.658,98
errechneter Wert je Ausschüttungsanteil	12,20	10,95
Ausgabepreis je Ausschüttungsanteil	12,81	11,50
errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	13,05	11,92
Ausgabepreis je Thesaurierungsanteil	13,70	12,52
<b>Ausschüttung/Auszahlung in EUR</b>		<b>per 15.11.2019</b>
Ausschüttung je Ausschüttungsanteil		0,2000
Auszahlung je Thesaurierungsanteil		0,0000

## Umlaufende Anteile zum Berichtsstichtag:

Ausschüttungsanteile	81.528
Thesaurierungsanteile	1.157.162
<b>Gesamt umlaufende Anteile per 14.03.2020</b>	<b>1.238.690</b>

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

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.16	4.308.312,39	11,40	0,12	25.717	4,41
14.09.17	8.223.297,36	11,97	0,3000	47.395	6,11
14.09.18	12.456.091,38	12,08	0,3000	56.013	3,46
14.09.19	15.820.143,93	12,20	0,2000	76.869	3,63
14.03.20	14.685.658,98	10,95	-	81.528	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.16	11,74	0,17	0,04	342.028	4,45
14.09.17	12,41	0,48	0,1060	616.811	6,07
14.09.18	12,73	0,62	0,1283	925.419	3,44
14.09.19	13,05	-0,2919	0,0000	1.140.020	3,58
14.03.20	11,92	-	-	1.157.162	-

## **Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung**

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

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

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

## **Berechnung des Gesamtrisikos**

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

## **Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps**

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

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

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

## Vermögensaufstellung für den Allianz Invest Portfolio Blue per 14. März 2020

ISIN	Zugang	Abgang	Stand am 13.03.2020	Tageskurs	Kurswert EUR	Anteil in %	
Amtlich notierte Wertpapiere							
Investmentfondsanteile							
Währung: EUR							
AT0000824685	AI-RENTENFONDS (A)	12.121,00	-18.970,00	16.407,00	95,46	1.566.212,22	10,66
AT0000A10KA3	AI60 (T)	722,00	0,00	722,00	1.220,29	881.049,38	6,00
DE000A2DTL86	ARA-REND PL NA-I	5.262,00	0,00	5.262,00	95,91	504.678,42	3,44
IE0004931386	PIMCO-EUB-EURINSAC	78.548,00	-49.799,00	52.825,00	26,07	1.377.147,75	9,38
LU0111549050	BNP EU GOV BD-I	5.912,00	0,00	5.912,00	232,95	1.377.200,40	9,38
LU0214705203	T. ROWE-US-I H EUR	27.984,00	-25.845,00	51.160,00	12,27	627.733,20	4,27
LU0223332320	MP-GOLD EQTY-BEUR	0,00	-601,00	2.532,00	120,04	303.941,28	2,07
LU0242506524	GS-EM DBT PT-IEURH	3.451,00	0,00	32.377,00	18,73	606.421,21	4,13
LU0285831334	T. ROWE-EU EQU-I	57.140,00	-28.570,00	28.570,00	13,27	379.123,90	2,58
LU0564079449	INV-US SEN-GHEUR	2.402,00	-2.402,00	0,01	123,33	1,11	0,00
LU0654138840	BNP EMER BD-EURIH	5.376,00	0,00	5.376,00	100,62	540.933,12	3,68
LU1505874849	ALZ-CRD OP-IT13EUR	363,00	-788,00	314,00	1.031,72	323.960,08	2,21
LU1637618239	BEREN-EURO FOC-I	3.866,00	0,00	3.866,00	106,38	411.265,08	2,80
	Summe EUR					8.899.667,15	60,60
Währung: USD							
LU0096363154	THREAD-GL FO-IU\$	67.819,00	0,00	67.819,00	12,50	754.118,30	5,14
LU0234572450	GS-EM MKT EQ-IA	46.355,00	0,00	46.355,00	17,13	706.460,10	4,81
LU0248041781	JPM-AM EQ-IACC\$	0,00	-1.374,00	1.496,00	208,41	277.385,55	1,89
LU0858068314	MSIF-GLB ABS-Z	20.443,00	0,00	20.443,00	34,80	632.932,74	4,31
LU0868754200	MS-GLOB ADV-I\$	9.050,00	0,00	9.050,00	48,97	394.286,92	2,68
LU1321847714	BSF-EMK EQ S-D2\$	0,00	-2.283,00	1.511,00	130,52	175.458,82	1,19
LU1645744589	AL-SAU250-W14\$	826,00	-579,00	1.107,00	989,07	974.110,75	6,63
LU1842711688	MSIF-GL SUST-Z	17.674,00	0,00	17.674,00	25,67	403.640,20	2,75
LU1942584027	ALZ-AL CHE-IT\$	374,00	0,00	374,00	1.272,80	423.511,74	2,88
	Summe USD					4.741.905,12	32,29
	Devisenmittelkurs:	1,124000					
Gesamtsumme Wertpapiere					13.641.572,27	92,89	
Derivative Produkte							
Devisentermingeschäfte							
	Verkauf		Kauf		Kursdifferenz EUR	Anteil in%	
	-2.000.000,00	USD	1.760.244,18	EUR	-12.678,15	-0,09	
	-1.781.903,88	EUR	2.000.000,00	USD	-8.981,54	-0,06	
Summe Devisentermingeschäfte					-21.659,69	-0,15	
Gesamtsumme Derivative Produkte					-21.659,69	-0,15	
Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt wurden:							
Währung: EUR							
AT0000739248	AI-OSTEUROPA (T)	0,00	-2.446,00				
AT0000A1PKR9	RAIFFEISEN-NACHHALTIGKEIT-MOMENTUM	1.724,00	-1.724,00				
DE000A0NEKQ8	ARAMEA RENDITE PLUS	263,00	-2.774,00				
IE00B52VJ196	ISHARES MSCI EUROPE SRI UCITS ETF EUR ACC	20.446,00	-20.446,00				
IE00BJ0KDR00	DB X-TRACKERS MSCI USA INDEX UCITS ETF DR -	4.482,00	-27.633,00				
IE00BYVTJH35	LGT SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL SUB-FUND	913,00	-913,00				
LU0159054922	JPMORGAN FUNDS - EUROPE HIGH YIELD BOND FUND	20.000,00	-42.771,00				
LU0230817925	T ROWE PRICE FUNDS SICAV - JAPANESE EQUITY	20.701,00	-39.595,00				
LU0234682044	GOLDMAN SACHS FUNDS SICAV - EUROPE CORE	0,00	-26.690,00				
LU0248049172	JPMORGAN FUNDS - EUROPE STRATEGIC GROWTH	0,00	-1.808,00				
LU0248062605	JPM FUNDS - EUROPE HIGH YIELD BOND FUND	2.802,00	-2.802,00				
LU0665631031	ALLIANZ EUROPEAN MICRO CAP	0,00	-58,00				
LU0951484251	ALLIANZ GLOBAL INVESTORS FUND - ALLIANZ BEST	184,00	-184,00				
LU1033710234	ALLIANZ EMERGING MARKETS SHORT DURATION	99,00	-1.099,00				
LU1322386266	FIDELITY FUNDS - WORLD FUND	0,00	-58.714,00				
Währung: USD							
IE00BDZZTM54	ISHARES MSCI WORLD SRI UCITS ETF	314.889,00	-314.889,00				
IE00BYVJRP78	ISHARES MSCI EM SRI UCITS ETF USD ACC	80.475,00	-80.475,00				
LU0236212311	GOLDMAN SACHS GLOBAL CORE SM EQUITY	0,00	-14.903,00				
LU0360482987	MORGAN STANLEY INVESTMENT FUNDS - GLOBAL	0,00	-11.578,00				
LU0702159939	FIDELITY FUNDS - ASIAN SMALLER COMPANIES	3.449,00	-20.657,00				
LU1282651634	ALLIANZ GLOBAL INVESTORS FUND - ALLIANZ US	0,00	-132,00				
LU1353442657	FIDELITY FUNDS - EMERGING MARKETS DEBT	5.774,00	-56.188,00				
LU1917951649	T ROWE PRICE FUNDS SICAV - EMERGING MARKETS	4.277,00	-33.934,00				