

Allianz PIMCO Mortgage

ISIN: AT0000675459 (A)

ISIN: AT0000675467 (T)

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Abwicklungsbericht

vom 01.12.2022 – 31.03.2023

www.allianzinvest.at



Die Verwaltung des OGAW wurde mit Wirksamkeit zum 30.11.2022 gemäß § 60 Abs 1 InvFG gekündigt. Die Anteilhaber wurden über die Kündigung gemäß § 133 InvFG 2011 direkt verständigt.

Der Allianz PIMCO Mortgage wurde in Folge der Beendigung der Verwaltung ab 01.12.2022 liquidiert. Jegliche zuvor vereinbarten Veranlagungsstrategien traten im Liquidationsverfahren außer Kraft.

Am 31. März 2023 wurde der Allianz PIMCO Mortgage aufgelöst.

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

Datum	Fonds- vermögen gesamt	Errechneter Wert je Ausschüttungs- anteil	Ausschüttung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.20	156.960.130,66	57,31	0,5000	2.537.207	1,74
30.11.20	156.364.907,54	56,61	0,0000	2.559.325	-
30.11.21	150.430.790,16	55,87	0,0000	2.542.106,425	-1,31
30.11.22	73.952.444,70	47,50	0,0000	1.515.238,943	-14,98
31.03.23	0,00	0,00	-	-	-

Datum	Errechneter Wert je Thesaurierungs- anteil	Zur Thesaurierung verwendeter Betrag	Auszahlung je Anteil	Anteile	Wertent- wicklung in %
14.09.20	83,26	6,83	0,1302	138.643	1,55
30.11.20	82,84	-0,56	0,0000	138.665	-
30.11.21	81,76	-3,18	0,0000	102.763,449	-1,30
30.11.22	69,40	-12,84	0,0000	28.590,961	-15,12
31.03.23	0,00	-	-	-	-

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens für den Berichtszeitraum

1. Wertentwicklung des Berichtszeitraumes (Fonds Performance)

Ermittlung nach OeKB-Berechnungsmethode: pro Anteil in Fondswährung (in EUR)
ohne Berücksichtigung eines Ausgabezuschlages bzw. Rücknahmeabschlages

Ausschüttungsanteil AT0000675459	2022/2023 in EUR
Anteilswert am Beginn des Berichtszeitraumes	47,50
Kapitalrückzahlung am 20.12.2022 von EUR 34,04 je Anteil	
entspricht 0,716632 Anteilen	34,04
Kapitalrückzahlung am 29.12.2022 von EUR 4,6900 je Anteil	
entspricht 0,09873684 Anteilen	4,69
Ausschüttung am 01.02.2023 von EUR 0,0000 je Anteil	
entspricht 0,000000 Anteilen	0,00
Kapitalrückzahlung am 28.02.2023 von EUR 8,65 je Anteil	
entspricht 0,182106 Anteilen	8,65
Kapitalrückzahlung am 31.03.2023 von EUR 0,0700 je Anteil	
entspricht 0,001474 Anteilen	0,07
Anteilswert am Ende des Berichtszeitraumes	0,00
Thesaurierungsanteil AT0000675467	2022/2023 in EUR
Anteilswert am Beginn des Berichtszeitraumes	69,40
Kapitalrückzahlung am 20.12.2022 von EUR 49,73 je Anteil	
entspricht 0,716571 Anteilen	49,73
Kapitalrückzahlung am 29.12.2022 von EUR 6,8500 je Anteil	
entspricht 0,098703 Anteilen	6,85
KESt-Auszahlung am 01.02.2023 von EUR 0,0000 je Anteil	
entspricht 0,000000 Anteilen	0,00
Kapitalrückzahlung am 28.02.2023 von EUR 12,63 je Anteil	
entspricht 0,181988 Anteilen	12,63
Kapitalrückzahlung am 31.03.2023 von EUR 0,1200 je Anteil	
entspricht 0,001729 Anteilen	0,12
Anteilswert am Ende des Berichtszeitraumes	0,00

2. Fondsergebnis

2022/2023
in EUR

a. Realisiertes Fondsergebnis

Ordentliches Fondsergebnis

Erträge (ohne Kursergebnis)

Zinserträge	152.456,36	
Dividenderträge	0,00	
Erträge aus Immobilienfonds	0,00	
Sonstige Erträge	2.023,51	154.479,87

Zinsaufwendungen	-1.951,69	-1.951,69
------------------	-----------	------------------

Aufwendungen

Verwaltungsgebühren	0,00	
Kosten für den Wirtschaftsprüfer/Steuerberater	0,00	
Publizitätskosten und Aufsichtskosten	0,00	
Wertpapierdepotgebühren	-111,31	
Depotbankgebühren	0,00	
Kosten für externe Berater	0,00	
Verwaltungskostenrückvergütung aus Subfonds	0,00	
Garantiegebühren	0,00	
Fondsadministrationsgebühr	0,00	
Gebühren für Nachhaltigkeit	0,00	
Sonstige Aufwendungen	0,00	-111,31

Ordentliches Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) **152.416,87**

Realisiertes Kursergebnis ²⁾

Realisierte Gewinne aus Wertpapieren	7.359.356,45	
derivate Instrumente	1.223.338,63	
Realisierte Kursgewinne gesamt		8.582.695,08

Realisierte Verluste aus Wertpapieren	-7.765.916,37	
derivate Instrumente	-512.391,82	
Realisierte Kursverluste gesamt		-8.278.308,19

Realisiertes Kursergebnis (exkl. Ertragsausgleich) **304.386,89**

Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich) **456.803,76**

b. Nicht realisiertes Kursergebnis ²⁾

Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses		
unrealisierte Gewinne	-7.477.839,40	
unrealisierte Verluste	6.948.890,12	-528.949,28

Ergebnis des Berichtszeitraumes³⁾ **-72.145,52**

c. Ertragsausgleich

Ertragsausgleich für Erträge des Berichtszeitraumes	0,00	
Ertragsausgleich im Berichtszeitraum für Gewinnvorträge	0,00	
Ertragsausgleich		0,00

Fondsergebnis gesamt **-72.145,52**

3. Entwicklung des Fondsvermögens

	<u>2022/2023</u>	
	in EUR	
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraumes⁴⁾	73.952.444,70	
Ausschüttung am 20.12.2022 (Kapitalrückzahlung) (für Ausschüttungsanteil AT0000675459)	-51.578.733,62	
Ausschüttung am 20.12.2022 (Kapitalrückzahlung) (für Thesaurierungsanteil AT0000675467)	-1.421.828,49	
Ausschüttung am 29.12.2022 (Kapitalrückzahlung) (für Ausschüttungsanteil AT0000675459)	-7.106.470,64	
Ausschüttung am 29.12.2022 (Kapitalrückzahlung) (für Thesaurierungsanteil AT0000675467)	-195.848,08	
Ausschüttung am 01.02.2023 (für Ausschüttungsanteil AT0000675459)	0,00	
KEst-Auszahlung am 01.02.2023 (für Thesaurierungsanteil AT0000675467)	0,00	
Ausschüttung am 28.02.2023 (Kapitalrückzahlung) (für Ausschüttungsanteil AT0000675459)	-13.106.816,86	
Ausschüttung am 28.02.2023 (Kapitalrückzahlung) für Thesaurierungsanteil AT0000675467)	-361.103,84	
Ausschüttung am 31.03.2023 (Kapitalrückzahlung) (für Ausschüttungsanteil AT0000675459)	-106.066,73	
Ausschüttung am 31.03.2023 (Kapitalrückzahlung) (für Thesaurierungsanteil AT0000675467)	-3.430,92	
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen		
Ausgabe von Anteilen	0,00	
Rücknahme von Anteilen	0,00	
Ertragsausgleich	0,00	0,00
Fondsergebnis gesamt (das Fondsergebnis ist im Detail im Punkt 2 dargestellt)		-72.145,52
Fondsvermögen am Ende des Berichtszeitraumes⁵⁾		0,00

- 1) Aufgrund der im Berichtszeitraum durchgeführten Kapitalrückzahlungen beträgt der errechnete Wert am 31.03.2023 EUR 0,00 pro Anteil.
- 2) Realisierte Gewinne und realisierte Verluste sind nicht periodenabgegrenzt und stehen so wie die Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses nicht unbedingt in Beziehung zu der Wertentwicklung des Fonds im Berichtszeitraum
- 3) Das Ergebnis des Berichtszeitraumes beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von 6.913,81 EUR
- 4) Anteilsulauf zu Beginn des Berichtszeitraumes: 1.515.238,943 Ausschüttungsanteile und 28.590,961 Thesaurierungsanteile
- 5) Anteilsulauf am Ende des Berichtszeitraumes: 0 Ausschüttungsanteile und 0 Thesaurierungsanteile

Anteilswertermittlung und Wertpapierbewertung

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

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

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

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

Berechnung des Gesamtrisikos

Die Berechnung des Gesamtrisikos erfolgt nach dem Commitment Approach.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps

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

Vergütungspolitik gem. Anlage I zu Art 2 InvFG Schema B*

Gesamtsumme Vergütungen der Mitarbeiter der VWG für das abgelaufene Geschäftsjahr	7.237.497,71			
Feste Bestandteile	6.040.289,85			
Variable Bestandteile	1.197.207,86			
Zahl der Mitarbeiter/Begünstigten	35,25 (VZÄ)			
Performance fees/carried interest	derzeit n/a			
Gesamtsumme Vergütungen aufgliedert nach den Mitarbeiterkategorien für das abgelaufene Geschäftsjahr				Sonstige Risikoträger, die in dieselbe Einkommensstufe wie GL und Risikoträger fallen
	Geschäftsleiter	Risikoträger	Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	
Vergütungsangaben gem. InvFG	**	4.376.860,81	373.328,97	n/a
	Führungskräfte	Mitarbeiter, deren Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil auswirkt		
Vergütungsangaben gem. AIFMG	1.365.984,42	1.878.026,99		
Beschreibung darüber, wie die Vergütung und die sonstigen Zuwendungen berechnet wurden	Es besteht kein direkter Konnex zwischen Vergütung der Mitarbeiter der KAG und den aus dem Fonds lukrierten Verwaltungsgebühren. Die Gesamtvergütung der Mitarbeiter besteht aus einem fixen und einem variablen Anteil, für die Berechnung der variablen Vergütung können mittelbar die Kennzahlen der verwalteten Fonds einfließen.			
Ergebnis der in § 17c Abs. 1 Z 3 und 4 genannten Überprüfungen, einschließlich aller aufgetretenen Unregelmäßigkeiten	Die Vergütungsgrundsätze wurden seitens des Aufsichtsrats vollumfänglich genehmigt und für die VWG festgelegt. Im Zuge der unabhängigen Überprüfung im Oktober 2022 wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.			
wesentliche Änderungen an der angenommenen Vergütungspolitik	Im Rahmen der ab dem Geschäftsjahr 2021 gültigen Vergütungspolitik wurden im Zuge der Anpassung an die erweiterte Konzession der Gesellschaft wesentliche Änderungen vorgenommen, die insbesondere die Einstufung der Komplexität der Gesellschaft betrafen und den durch die Vergütungspolitik erfassten Personenkreis erweiterten.			

* Die Anforderungen der Z 5 und 6 des § 20 Abs 2 AIFMG sind von den vorliegenden Angaben mitumfasst.

** Da diese Kategorie weniger als 3 Personen umfasst, wurden aus Gesichtspunkten des Datenschutzes und der analogen Anwendung des §242 Abs. 4 UGB die betroffenen Personen unter dem Bereich Risikoträger erfasst.
Die quantitativen Angaben beruhen auf den Daten der VERA Meldung 2022 für das Geschäftsjahr 2021. Die vorliegenden Angaben beziehen sich auf die gesamte Verwaltungsgesellschaft. Detailliertere Informationen zur Vergütungspolitik der KAG entnehmen Sie bitte dem entsprechenden Dokument unter www.allianzinvest.at

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall

Asset Manager: PIMCO Deutschland GmbH

Das Auslagerungsunternehmen hat folgende Informationen zur Mitarbeitervergütung veröffentlicht:

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall	Betrag in €
Gesamtsumme der Vergütung der Mitarbeiter	23.738.806,00
davon feste Vergütung	5.594.319,00
davon variable Vergütung	18.144.487,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	0,00

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND						
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge

ANLEIHEN US DOLLAR

US31281BDJ61	5,5000	FG N31005	USD	0		22.743.784
US31288QE556	3,5710	FH 841056	USD	0		3.000.000
US3128MJ2S87	3,5000	FG G08784	USD	0		75.258
US3128MJYN41	3,5000	FG G08716	USD	0		196.284
US31300MLR24	3,4930	FH 849336	USD	0		3.000.000
US31326MWK51	3,3800	FH 2B6950	USD	0		189.620
US3132WJQK04	3,5000	FG Q44957	USD	0		330.000
US3132XS3V08	3,5000	FG Q50811	USD	0		529.453
US3132XY5K98	4,0000	FG Q56249	USD	0		110.952
US3132Y1HU58	3,5000	FG Q57442	USD	0		113.925
US3133ANYA62	3,0000	FR QC4305	USD	0		1.700.000
US31347A3D43	3,2850	FH 840796	USD	0		315.595
US3136BBGN69	3,1451	FNR 2020-54 WF	USD	0		1.193.422
US31378JDP93	6,5000	FN 399810	USD	0		2.220.000
US3137FQLW10	4,9387	FHR 4940 FE	USD	0		923.917
US3138EJYQ53	5,5000	FN AL2518	USD	0		10.197.840
US3138ELXR91	6,0000	FN AL4287	USD	0		1.000.000
US3138ETY911	4,5000	FN AL8835	USD	0		450.000
US3138NXH422	3,0000	FN AR1150	USD	0		399.428
US3138XSB556	4,0000	FN AW2759	USD	0		1.422.441
US31405WJA45	5,5000	FN 801357	USD	0		1.230.000
US31406MJ560	4,5000	FN 813984	USD	0		1.390.676
US3140E7NL01	3,5000	FN BA3094	USD	0		2.000.000
US3140FEEB62	3,5000	FN BD6429	USD	0		292.000
US3140FXRT15	3,0000	FN BF0497	USD	0		2.446.714
US3140H6DG12	4,0000	FN BJ4602	USD	0		183.303
US3140HNVQ20	4,5000	FN BK8722	USD	0		493.738
US3140J8LH49	4,0000	FN BM3927	USD	0		545.153
US3140JAU17	3,4250	FN BM5989	USD	0		4.000.000
US31410GN665	6,5000	FN 888813	USD	0		800.000
US31410LFB36	4,5000	FN 890362	USD	0		1.256.723
US31410WJ744	4,5000	FN 899486	USD	0		500.000
US31411EV794	6,0000	FN 906138	USD	0		1.226.471
US31411KE417	6,0000	FN 910155	USD	0		166.522
US31416QDT94	4,0000	FN AA6413	USD	0		1.000.000
US31416VQN72	5,5000	FN AB0460	USD	0		764.000
US31417SQS22	4,0000	FN AC5864	USD	0		500.000
US31418AMS41	4,0000	FN MA1268	USD	0		2.000.000
US31418DD740	3,5000	FN MA3725	USD	0		1.000.000
US31418DDJ81	3,5000	FN MA3704	USD	0		1.500.000
US31418ED649	3,0000	FN MA4624	USD	0		900.000
US31418EKR08	3,5000	FN MA4803	USD	0		800.000
US36176QEN07	4,0000	GN 772641	USD	0		50.076
US36176TN959	4,5000	G2 775616	USD	0		83.649
US36176UP416	4,0000	GN 776543	USD	0		41.304
US36176VW907	3,5000	GN 777672	USD	0		47.566
US36176XPH60	3,5000	GN 779224	USD	0		200.000
US36177JRX99	4,0000	GN 790501	USD	0		218.083
US36177NWU08	4,0000	GN 794258	USD	0		399.600
US36177RDQ11	3,5000	GN 796410	USD	0		106.387
US36178D7M79	3,5000	GN AA6300	USD	0		204.728
US36178DPC91	3,0000	GN AA5819	USD	0		1.000.000
US36178DU905	3,5000	GN AA6008	USD	0		86.914
US36178EDQ98	3,5000	GN AA6411	USD	0		203.177
US36178TKX36	4,0000	GN AB6610	USD	0		85.000
US36178TNR31	4,0000	GN AB6700	USD	0		60.000
US36179F7D16	3,5000	GN AC6292	USD	0		58.408
US36179MLA61	5,0000	G2 MA0321	USD	0		742.638
US36179NHJ00	2,5000	G2 MA1133	USD	0		6.369
US36179NJA72	3,5000	G2 MA1157	USD	0		1.530.000
US36179QFA40	3,5000	G2 MA1961	USD	0		639.861

US36179QGE52	4,5000	G2 MA1997	USD	0	34.629
US36179QJT94	4,0000	G2 MA2074	USD	0	2.335.000
US36179RBZ10	4,5000	G2 MA2756	USD	0	1.735.872
US36179RD974	4,5000	G2 MA2828	USD	0	2.936.894
US36179RKN88	3,0000	G2 MA3001	USD	0	2.380.681
US36179RLR83	4,5000	G2 MA3036	USD	0	1.181.015
US36179SW451	6,0000	G2 MA4267	USD	0	3.900.000
US36179T4E27	4,5000	G2 MA5321	USD	0	1.033.211
US36179T7J86	3,5000	G2 MA5397	USD	0	87.053
US36179TGV17	4,5000	G2 MA4712	USD	0	2.920.758
US36179THW80	3,0000	G2 MA4745	USD	0	602.904
US36179TLK96	4,5000	G2 MA4830	USD	0	2.613.426
US36179TNH40	4,5000	G2 MA4892	USD	0	2.089.548
US36179TT216	4,5000	G2 MA5069	USD	0	1.422.909
US36179TVV42	4,5000	G2 MA5128	USD	0	1.490.000
US36179UMC35	5,0000	G2 MA5755	USD	0	542.557
US36179UMM17	4,5000	G2 MA5764	USD	0	2.260.409
US36179UT933	3,5000	G2 MA5976	USD	0	1.300.000
US36179UVX70	3,5000	G2 MA6030	USD	0	800.000
US36179UXJ68	3,5000	G2 MA6081	USD	0	1.300.000
US36179VDF40	4,5000	G2 MA6402	USD	0	520.400
US36179VHK98	4,5000	G2 MA6534	USD	0	2.956.810
US36179W2T42	2,0000	G2 MA7986	USD	0	425.857
US36179W5A24	2,0000	G2 MA8041	USD	0	999.999
US36179WVW53	3,5000	G2 MA7829	USD	0	500.000
US36179WY855	2,0000	G2 MA7935	USD	0	1.374.062
US36179WY939	2,5000	G2 MA7936	USD	0	5.439.997
US3617A7ER84	4,5000	G2 AO6444	USD	0	403.673
US3617ACHV58	4,0000	GN BA0244	USD	0	684.922
US3617AER819	4,5000	G2 BA2311	USD	0	3.000.000
US3617AN3Q79	3,5000	G2 BA9807	USD	0	337.931
US3617AQHV45	3,5000	G2 BB0244	USD	0	290.770
US3617AQU569	3,5000	G2 BB0604	USD	0	289.670
US3617AQUG21	3,5000	G2 BB0583	USD	0	351.794
US3617AT4T72	3,5000	G2 BB3534	USD	0	408.279
US3617ATYC10	3,5000	G2 BB3407	USD	0	274.364
US3617AUKA72	3,5000	G2 BB3889	USD	0	323.194
US3617B0TG02	3,5000	G2 BB8651	USD	0	299.233
US3617B0YG47	4,0000	G2 BB8811	USD	0	257.579
US3617B1XT59	3,5000	G2 BB9690	USD	0	290.287
US3617B3HW29	4,0000	G2 BC0245	USD	0	251.735
US3617B53D41	4,0000	G2 BC2596	USD	0	99.226
US3617B55H37	4,0000	G2 BC2648	USD	0	113.189
US3617B5DZ44	3,5000	G2 BC1920	USD	0	460.085
US3617B6DR01	4,0000	G2 BC2812	USD	0	43.819
US3617B8LV86	3,5000	G2 BC4840	USD	0	289.748
US3617B9AK24	3,5000	G2 BC5410	USD	0	5.320.120
US3617BAX656	4,0000	G2 BC7001	USD	0	35.239
US3617BAZR79	4,0000	G2 BC7052	USD	0	58.609
US3617BBR292	4,5000	G2 BC7705	USD	0	61.927
US3617BFRS32	4,0000	G2 BD0497	USD	0	505.192
US3617BFTE28	5,0000	G2 BD0549	USD	0	1.200.000
US3617BFTQ57	5,0000	G2 BD0559	USD	0	500.000
US3617BHP442	3,5000	G2 BD2243	USD	0	900.000
US3617BKKP50	3,5000	G2 BD3902	USD	0	350.258
US3617BKNN987	3,0000	GN BD4016	USD	0	1.927.037
US3617BMC549	3,5000	G2 BD5492	USD	0	258.679
US3617BRBR60	3,5000	G2 BD9048	USD	0	3.260.466
US3617BREM47	3,5000	G2 BD9140	USD	0	644.088
US3617BTBB74	3,5000	G2 BE0034	USD	0	198.819
US3617BVSX67	4,5000	G2 BE2334	USD	0	165.442
US3617G0H452	4,5000	G2 BE5651	USD	0	553.202
US3617G0JC56	4,0000	G2 BE5659	USD	0	500.000
US3617G1A737	3,5000	G2 BE6330	USD	0	190.627
US3617G1HC57	3,5000	G2 BE6527	USD	0	241.665
US3617G7N356	4,0000	G2 BF1310	USD	0	52.760
US3617G8N412	3,5000	G2 BF2211	USD	0	436.515

US3617G9E724	4,0000	G2 BF2858	USD	0	60.115
US3617GBHY50	4,0000	G2 BF4747	USD	0	197.764
US3617GBLM66	4,0000	G2 BF4832	USD	0	123.802
US3617GBN282	4,0000	G2 BF4909	USD	0	511.400
US3617GRV323	4,0000	G2 BG6934	USD	0	236.682
US3617GTJB48	4,0000	G2 BG8358	USD	0	66.178
US3617GWBB58	4,5000	G2 BH0034	USD	0	343.806
US3617GWBC32	4,5000	G2 BH0035	USD	0	795.894
US3617H2AK10	4,5000	G2 BH4510	USD	0	50.063
US3617HDZF17	4,0000	G2 BI4342	USD	0	1.150.298
US3617HDZG99	4,0000	G2 BI4343	USD	0	1.702.278
US3617HGFQ23	4,5000	G2 BI6475	USD	0	578.000
US3617J6Q804	4,5000	G2 BK5879	USD	0	5.500.000
US3617K3KR97	2,5000	GN BN0304	USD	0	380.236
US3617KPLY45	3,5000	G2 BO7543	USD	0	1.595.578
US3617LC4N55	3,0000	GN BP6229	USD	0	624.085
US3617LR6H34	3,5000	GN BQ7172	USD	0	1.022.031
US3617LRZ993	3,0000	G2 BQ7068	USD	0	1.944.000
US3617LSCU53	3,5000	GN BQ7283	USD	0	2.767.248
US3617M7WQ70	3,0000	G2 BR8755	USD	0	4.000.000
US3617M8N851	3,0000	GN BR9415	USD	0	1.878.630
US3617MICYH44	3,0000	G2 BS2512	USD	0	1.704.155
US3617MVP07	3,0000	G2 BT6314	USD	0	4.000.000
US36180BFU08	4,0000	GN AD0179	USD	0	130.000
US36180DNF05	3,5000	G2 AD2190	USD	0	350.000
US36180DPH43	3,5000	GN AD2224	USD	0	121.619
US36180DVA461	3,5000	GN AD2435	USD	0	120.106
US36180DVD64	3,5000	GN AD2412	USD	0	181.593
US36180E4B87	3,5000	GN AD3518	USD	0	133.797
US36180E5B78	3,5000	GN AD3542	USD	0	52.241
US36180EXL46	3,5000	G2 AD3383	USD	0	100.000
US36180HHC51	4,0000	GN AD5627	USD	0	41.634
US36180HTF54	3,5000	GN AD5950	USD	0	115.352
US36180JGA60	3,5000	GN AD6493	USD	0	47.467
US36180UJF385	3,5000	GN AE1986	USD	0	54.383
US36181D6Z46	3,5000	GN AE9888	USD	0	367.292
US36181FEA57	3,5000	GN AF0129	USD	0	233.915
US36181FVJ73	3,5000	GN AF0617	USD	0	25.000
US36182V4L69	3,5000	GN AJ1727	USD	0	850.505
US36183QTK12	3,0000	GN AK6854	USD	0	1.979.779
US36183SXZ90	3,7500	G2 AK8796	USD	0	1.000.000
US36186G2Z67	4,0000	GN AN4392	USD	0	1.055.975
US36186J4Y11	6,0000	G2 AN5339	USD	0	4.004.202
US36189MCS52	3,5000	G2 AQ0081	USD	0	769.271
US36192XKA62	4,5000	G2 AR2989	USD	0	70.813
US36193FZL48	3,5000	G2 AR8847	USD	0	1.208.504
US36193QNF62	3,5000	G2 AS5790	USD	0	2.418.605
US36194GMW14	3,5000	G2 AT7573	USD	0	2.000.000
US36194N2W86	3,0000	G2 AU1689	USD	0	1.036.077
US36194SKA59	3,5000	G2 AU4789	USD	0	571.273
US36195KHV98	3,0000	G2 AV8344	USD	0	685.095
US36195LX567	3,0000	GN AV9700	USD	0	364.760
US36195RC980	3,0000	GN AW2796	USD	0	41.254
US36196JFE10	3,5000	G2 AX6465	USD	0	404.598
US36196LU900	3,0000	GN AX8708	USD	0	625.031
US36196YDX85	4,0000	GN AY8218	USD	0	141.857
US36197CW630	4,0000	G2 AZ0669	USD	0	278.950
US36197DZB71	4,0000	GN AZ1638	USD	0	700.246
US36197K5G33	3,5000	G2 AZ7147	USD	0	194.181
US36198T3V27	3,5000	G2 AI7112	USD	0	2.350.987
US36200JU243	5,5000	GN 602801	USD	0	25.000
US36200KDY01	5,5000	GN 603219	USD	0	295.000
US36200MBP77	5,5000	GN 604046	USD	0	195.000
US36200NYM72	5,5000	GN 605616	USD	0	54.863
US36201BMC71	5,5000	GN 578255	USD	0	200.000
US36201DWN82	3,5000	GN 580353	USD	0	25.000
US36201H3W15	5,5000	GN 584113	USD	0	270.000

US36201TGP66	5,5000 GN 592506	USD	0	159.801
US36201XRH34	5,5000 GN 606288	USD	0	200.000
US36201XRJ99	5,5000 GN 606289	USD	0	105.731
US36202D5R82	5,5000 G2 3556	USD	0	125.000
US36202DUU35	5,5000 G2 3295	USD	0	294.000
US36202DWV99	5,5000 G2 3360	USD	0	315.000
US36202E3R82	6,0000 G2 4408	USD	0	261.321
US36202E4A49	5,0000 G2 4417	USD	0	90.437
US36202E4J57	5,5000 G2 4425	USD	0	50.000
US36202E4P18	4,5000 G2 4430	USD	0	675.000
US36202E5A30	5,0000 G2 4441	USD	0	115.054
US36202E5G00	5,0000 G2 4447	USD	0	200.000
US36202E5U93	5,0000 G2 4459	USD	0	12.678
US36202E6S39	5,5000 G2 4481	USD	0	429.327
US36202E6T12	6,0000 G2 4482	USD	0	807.046
US36202E6U84	4,0000 G2 4483	USD	0	20.285
US36202EBE86	5,5000 G2 3637	USD	0	89.000
US36202EKM02	6,5000 G2 3900	USD	0	604.751
US36202EMA46	5,5000 G2 3953	USD	0	340.000
US36202ESA81	5,0000 G2 4113	USD	0	22.717.400
US36202ESK63	6,0000 G2 4122	USD	0	2.726.405
US36202EUF41	5,5000 G2 4182	USD	0	338.081
US36202EV891	6,0000 G2 4239	USD	0	18.152.051
US36202EV974	6,5000 G2 4240	USD	0	422.602
US36202EVC01	6,5000 G2 4211	USD	0	116.729
US36202EW394	5,5000 G2 4266	USD	0	128.000
US36202EWW72	6,0000 G2 4260	USD	0	1.056.505
US36202EWW55	6,5000 G2 4261	USD	0	1.694.633
US36202EXM64	5,5000 G2 4284	USD	0	160.589
US36202EXN48	6,0000 G2 4285	USD	0	3.524.499
US36202EYF05	6,0000 G2 4310	USD	0	1.690.407
US36202EZ512	6,0000 G2 4364	USD	0	304.273
US36202EZA09	6,0000 G2 4337	USD	0	1.258.293
US36202EZQ50	5,5000 G2 4351	USD	0	289.601
US36202F2W59	2,5000 G2 5289	USD	0	123.682
US36202FAQ90	6,0000 G2 4515	USD	0	4.226
US36202FAV85	5,0000 G2 4520	USD	0	931.304
US36202FBB13	5,5000 G2 4534	USD	0	4.226
US36202FBJ49	5,0000 G2 4541	USD	0	120.000
US36202FDX15	5,0000 G2 4618	USD	0	963.885
US36202FEV40	4,0000 G2 4648	USD	0	22.990
US36202FGE07	5,0000 G2 4697	USD	0	186.248
US36202FGT75	5,0000 G2 4710	USD	0	2.608.452
US36202FHC32	5,0000 G2 4727	USD	0	142.885
US36202FJR82	5,0000 G2 4772	USD	0	325.309
US36202FK545	4,5000 G2 4816	USD	0	6.065
US36202FKP08	5,0000 G2 4802	USD	0	3.285.262
US36202FL618	4,0000 G2 4849	USD	0	12.190.366
US36202FLQ71	5,0000 G2 4835	USD	0	289.083
US36202FM459	4,0000 G2 4879	USD	0	10.000.000
US36202FM947	5,0000 G2 4884	USD	0	1.642.183
US36202FMC76	5,0000 G2 4855	USD	0	1.343.801
US36202FPB66	4,0000 G2 4918	USD	0	16.059
US36202FPH37	5,0000 G2 4924	USD	0	1.870.251
US36202FQA74	4,0000 G2 4949	USD	0	25.356
US36202FST48	5,5000 G2 5030	USD	0	35.810
US36202FUR53	4,0000 G2 5092	USD	0	11.495
US36202FUW49	6,0000 G2 5097	USD	0	139.770
US36202FX688	4,0000 G2 5201	USD	0	16.904
US36202FXR27	6,0000 G2 5188	USD	0	227.118
US36202FY348	4,0000 G2 5230	USD	0	13.523
US36202FZL39	3,5000 G2 5247	USD	0	603.786
US36202UBV44	4,0000 GN 609452	USD	0	211.000
US36202VAQ41	5,5000 GN 610315	USD	0	100.000
US36202VV739	6,0000 G2 610938	USD	0	700.000
US36203SW780	6,5000 GN 358070	USD	0	195.000
US36204DX382	4,0000 GN 367098	USD	0	58.000

US36207KEG13	7,5000	GN 434035	USD	0	49.438
US36209FPY96	7,5000	GN 470339	USD	0	26.661
US3620A44M14	4,0000	GN 719128	USD	0	40.000
US3620A56K03	4,5000	GN 720074	USD	0	301.218
US3620A5H775	4,0000	GN 719454	USD	0	205.000
US3620A5YT01	5,5000	GN 719922	USD	0	993.568
US3620A6CA31	4,0000	GN 720165	USD	0	49.000
US3620A7JM88	4,0000	GN 721268	USD	0	50.000
US3620AAN208	4,5000	GN 724109	USD	0	1.408.660
US3620ABC464	4,0000	GN 724691	USD	0	25.000
US3620AFYS05	4,5000	GN 728921	USD	0	351.036
US3620AGJD83	4,0000	GN 729360	USD	0	175.000
US3620ALT467	4,0000	GN 733271	USD	0	75.000
US3620AMCH39	4,0000	GN 733672	USD	0	292.123
US3620AMD584	4,5000	GN 733724	USD	0	9.072.500
US3620AMFV95	4,0000	GN 733780	USD	0	271.916
US3620ANEP10	5,5000	GN 734642	USD	0	100.000
US3620AQYX54	4,0000	GN 737026	USD	0	100.000
US3620ARUP40	4,0000	GN 737790	USD	0	3.696.000
US3620ARYL99	4,0000	GN 737915	USD	0	3.510.275
US3620AY6G61	4,0000	GN 744371	USD	0	175.000
US3620AYQ250	4,0000	GN 743973	USD	0	30.000
US3620C0WG90	5,5000	GN 745047	USD	0	88.000
US3620C0XJ21	5,5000	GN 745081	USD	0	43.789
US3620C1E696	4,5000	G2 745457	USD	0	5.497.895
US3620C3B920	4,5000	GN 747164	USD	0	970.828
US3620C63E34	4,5000	GN 750597	USD	0	59.214
US36210B4R31	5,0000	GN 487832	USD	0	350.000
US36210JHG67	5,5000	GN 493531	USD	0	207.000
US36210SE791	6,0000	GN 500658	USD	0	369.107
US36211BBF04	7,5000	GN 507738	USD	0	51.772
US36211RSP54	5,5000	GN 520826	USD	0	59.547
US36211V6Q85	5,0000	GN 524779	USD	0	300.000
US36212EJD04	7,5000	GN 531360	USD	0	101.423
US36212USE28	5,5000	GN 544217	USD	0	125.969
US36212UTA96	6,5000	GN 544245	USD	0	161.877
US36212WX286	4,0000	GN 546197	USD	0	209.719
US36213RUQ81	5,5000	GN 562291	USD	0	41.125
US36225BE613	5,5000	GN 781057	USD	0	191.517
US36225BUE63	7,5000	GN 781481	USD	0	25.924.540
US36225CM945	2,6250	G2 80383	USD	0	31.975.459
US36225CMN38	2,6250	G2 80364	USD	0	1.755.000
US36225CMY92	2,6250	G2 80374	USD	0	560.000
US36225CQ748	1,7500	G2 80477	USD	0	6.185.000
US36225CTZ94	2,6250	G2 80567	USD	0	500.000
US36225CZD19	3,1250	G2 80739	USD	0	1.000.000
US36225CZF66	3,1250	G2 80741	USD	0	1.081.942
US3622A24S85	3,5000	G2 784433	USD	0	1.425.685
US3622A25E80	3,5000	G2 784445	USD	0	1.204.153
US3622A25Q11	3,5000	G2 784455	USD	0	5.000.000
US3622A2N323	4,0000	GN 784010	USD	0	279.875
US3622A2P229	4,0000	GN 784041	USD	0	569.073
US3622A2PA44	4,5000	G2 784017	USD	0	640.716
US3622A2PB27	4,5000	G2 784018	USD	0	866.065
US3622A2PD82	4,5000	G2 784020	USD	0	468.927
US3622A2SC72	3,0000	G2 784115	USD	0	615.681
US3622A2U914	4,0000	GN 784208	USD	0	684.384
US3622A2WH14	5,0000	G2 784248	USD	0	2.219.667
US3622AAAA22	3,5000	G2 784601	USD	0	10.000.000
US3622ABGQ92	3,5000	G2 785707	USD	0	1.005.404
US36230KL411	4,0000	GN 751247	USD	0	60.000
US36230KL668	4,0000	GN 751249	USD	0	525.000
US36230L4Q96	4,5000	G2 752631	USD	0	3.005.000
US36230N3A18	4,0000	GN 754393	USD	0	45.000
US36230RXE16	4,0000	GN 756977	USD	0	50.000
US36230ULU15	4,5000	G2 759339	USD	0	3.180.000
US36230UMY28	4,0000	G2 759375	USD	0	850.000

US36241KL715	5,5000 GN 782150	USD	0	100.000
US36241KQP65	5,5000 GN 782262	USD	0	75.000
US36241KQZ48	5,5000 GN 782272	USD	0	150.721
US36241KRP56	5,5000 GN 782294	USD	0	1.794.055
US36241KSB51	5,5000 GN 782314	USD	0	80.000
US36241KSV16	5,5000 GN 782332	USD	0	51.845
US36241KUS58	5,5000 GN 782393	USD	0	85.338
US36241KVS40	5,5000 GN 782425	USD	0	721.882
US36241KX454	5,0000 GN 782499	USD	0	2.000.000
US36241LC209	5,5000 GN 782789	USD	0	123.745
US36241LG267	4,5000 GN 782917	USD	0	9.300.000
US36241LGU44	5,5000 GN 782911	USD	0	1.220.560
US36241LGZ31	5,5000 GN 782916	USD	0	140.000
US36241LK541	4,0000 GN 783016	USD	0	445.675
US36241LL382	4,0000 GN 783046	USD	0	40.000
US36241LL796	5,0000 G2 783050	USD	0	1.024.404
US36241LS239	4,0000 GN 783237	USD	0	6.399.984
US36241LSM99	5,0000 G2 783224	USD	0	858.313
US36241LU870	4,0000 GN 783307	USD	0	79.918
US36241LWW26	4,0000 GN 783361	USD	0	135.000
US36290QBM69	5,5000 GN 613944	USD	0	897.730
US36290QJD88	5,5000 GN 614160	USD	0	195.000
US36290R5V16	5,5000 GN 615660	USD	0	130.922
US36290TWR66	6,5000 GN 617256	USD	0	60.213
US36290UAT34	5,5000 GN 617518	USD	0	73.320
US36290UDH68	5,5000 GN 617604	USD	0	100.333
US36290UHU34	6,5000 GN 617743	USD	0	207.015
US36290VCY83	5,5000 GN 618487	USD	0	65.000
US36290VJ218	6,5000 GN 618681	USD	0	205.820
US36291AV223	5,5000 GN 622633	USD	0	100.000
US36291FPX05	4,0000 GN 626938	USD	0	194.026
US36291FS335	3,5000 G2 627038	USD	0	1.800.000
US36291FVS46	5,5000 GN 627125	USD	0	114.440
US36291NGC92	6,5000 GN 632995	USD	0	262.087
US36291QRB22	4,0000 GN 635082	USD	0	500.000
US36291XAL38	5,5000 GN 640911	USD	0	243.000
US36291XAM11	5,5000 GN 640912	USD	0	68.000
US36291YEU73	5,5000 GN 641947	USD	0	51.581
US36291YWN39	5,5000 GN 642453	USD	0	197.267
US36292CMK70	5,5000 GN 644862	USD	0	118.501
US36292DBU54	5,5000 GN 645451	USD	0	5.700.794
US36292GPL31	5,5000 GN 648527	USD	0	213.903
US36292HSB05	5,5000 GN 649514	USD	0	98.000
US36292JQ693	5,5000 GN 650377	USD	0	50.170
US36292KPH31	5,5000 GN 651224	USD	0	155.467
US36292L2T04	5,5000 GN 652486	USD	0	60.000
US36292L4Q47	6,5000 GN 652531	USD	0	352.585
US36294NZY74	6,5000 GN 655159	USD	0	140.946
US36294SA231	6,5000 GN 658025	USD	0	202.877
US36294SG436	6,5000 GN 658219	USD	0	209.507
US36294W2K30	5,5000 GN 662378	USD	0	200.664
US36294WPS16	5,5000 GN 662033	USD	0	180.000
US36294WQS07	6,5000 GN 662065	USD	0	109.866
US36294XCV64	6,5000 GN 662584	USD	0	806.381
US36294YNJ90	5,5000 GN 663793	USD	0	200.000
US36294YNU46	5,5000 GN 663803	USD	0	100.000
US36295CAW10	4,5000 GN 666121	USD	0	500.000
US36295DPB90	4,0000 GN 667418	USD	0	144.000
US36295E5D56	5,5000 GN 668744	USD	0	55.000
US36295FGG37	6,5000 GN 668999	USD	0	199.796
US36295HM319	6,5000 GN 670978	USD	0	155.086
US36295LUA78	6,0000 GN 673877	USD	0	993.993
US36295MD714	4,5000 GN 674326	USD	0	174.379
US36295NKF32	6,5000 GN 675394	USD	0	8.036.424
US36295NNM55	6,5000 GN 675496	USD	0	1.622.600
US36295NV201	3,5000 G2 675733	USD	0	260.972
US36295P4L38	5,0000 GN 676827	USD	0	400.000

US36295PMS82	5,5000	GN 676369	USD	0	1,000.000
US36295QA422	5,5000	GN 676927	USD	0	1,765.482
US36295QFM78	4,5000	GN 677072	USD	0	780.000
US36295QFZ81	5,5000	GN 677084	USD	0	554.654
US36295QGL86	5,5000	GN 677103	USD	0	12,295.399
US36295STG11	5,5000	GN 679251	USD	0	125.138
US36295TSH85	6,5000	GN 680120	USD	0	456.120
US36295W4W49	5,5000	GN 683137	USD	0	28.358
US36296BB768	5,5000	GN 685962	USD	0	3,447.786
US36296DBD93	5,5000	GN 687736	USD	0	50.000
US36296DFZ69	5,5000	GN 687884	USD	0	240.761
US36296DND65	6,5000	GN 688088	USD	0	1,000.000
US36296E5H50	5,0000	GN 689448	USD	0	601.526
US36296FF992	5,5000	GN 689692	USD	0	265.800
US36296GR524	5,5000	GN 690908	USD	0	503.220
US36296HBH12	5,5000	GN 691340	USD	0	1,010.511
US36296HBJ77	6,0000	GN 691341	USD	0	206.125
US36296KP637	6,5000	GN 693545	USD	0	129.922
US36296LUN80	5,0000	GN 694589	USD	0	1,301.033
US36296MQB71	6,0000	GN 695350	USD	0	85.152
US36296P6S52	5,5000	GN 697581	USD	0	1,505.908
US36296PSG71	5,0000	GN 697219	USD	0	300.000
US36296Q2T53	4,5000	GN 698386	USD	0	923.250
US36296SRQ02	4,0000	GN 699895	USD	0	100.000
US36296TA457	4,0000	GN 700327	USD	0	150.000
US36296TQR76	5,5000	GN 700764	USD	0	15,126.236
US36296UWE62	5,0000	G2 701845	USD	0	1,387.796
US36296WFX92	4,0000	GN 703182	USD	0	25.000
US36296WJG24	5,5000	GN 703263	USD	0	876.337
US36296WW364	5,5000	GN 703666	USD	0	36.535
US36296XJ625	5,5000	GN 704185	USD	0	934.404
US36296XY814	4,5000	GN 704635	USD	0	1,042.714
US36296XYV09	4,5000	GN 704624	USD	0	111.415
US36297AKC61	4,5000	GN 705991	USD	0	1,000.331
US36297B4P30	5,0000	GN 707430	USD	0	808.019
US36297BXY28	5,0000	GN 707295	USD	0	250.958
US36297CEX39	4,0000	GN 707650	USD	0	100.000
US36297CRL53	4,0000	GN 707991	USD	0	220.401
US36297CVT34	5,0000	GN 708126	USD	0	300.000
US36297FRG99	4,5000	GN 710687	USD	0	2,070.728
US36297FWP34	5,0000	GN 710854	USD	0	9,867.094
US36297JBM53	4,0000	GN 712944	USD	0	55.000
US36297JPG30	5,0000	GN 713323	USD	0	44.643
US36297KJ851	4,0000	GN 714087	USD	0	1,005.934
US36297KXU05	5,0000	GN 714491	USD	0	2,953.130
US36297KXV87	4,5000	GN 714492	USD	0	2,598.124
US38373MLD01	0,0000	GNR 2004-20 IO	USD	0	56,712.301
US38375B8G05	5,1416	GNR 2013-H23 FA	USD	0	1,000.000
US38375BU834	4,8416	GNR 2013-H10 FS	USD	0	5,000.000
US38375UST87	4,3216	GNR 2014-H25 FB	USD	0	900.000
US38375UTR13	4,3216	GNR 2015-H03 FC	USD	0	1,100.000
US38376GXC60	0,0024	GNR 2009-115 IO	USD	0	29,800.000
US38376GGH74	0,0000	GNR 2010-36 IO	USD	0	7,900.000
US38376RHR03	4,5106	GNR 2015-H27 FA	USD	0	1,000.000
US38376RNF90	3,4211	GNR 2015-H33 FA	USD	0	6,000.000
US38376RNP72	4,4916	GNR 2016-H03 FB	USD	0	763.000
US38376RVV58	4,5848	GNR 2016-H14 FA	USD	0	200.000
US38380QJA13	3,3064	GNR 2020-H15 FH	USD	0	500.000
US61911CAA18	5,1300	MECA 2007-FF2 A	USD	0	986.500
ANLEIHEN US DOLLAR					
US3131XD4J15	3,5000	FR ZK9825	USD	0	309.709
US3131XDQ577	3,5000	FR ZK9476	USD	0	223.884
US31329LTQ58	4,0000	FR ZA3259	USD	0	644.135
US31329PQW67	4,0000	FR ZA5869	USD	0	405.000
US3133B6Y538	3,0000	FR QD8832	USD	0	250.000
US3133BAC583	3,0000	FR QE0992	USD	0	700.000

US3133BEMB65	3,0000 FR QE4854	USD	0		753.321
US3133BGAN89	3,0000 FR QE6313	USD	0		200.113
US3133KNXV09	3,0000 FR RA6992	USD	0	699.931	699.931

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

EURO

DTG006703	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	EUR	0		66.363.859
DTG006916	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	EUR	0	66.364.000	66.364.000
DTG006917	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 07.12.22	EUR	0	66.364.000	66.364.000

DEVISENTERMINGESCHÄFTE US DOLLAR

DTG006703	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	USD	0	69.149.017	
DTG006916	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 05.12.22	USD	0	69.374.669	69.374.669
DTG006917	Devisentermingeschäft US Dollar Euro 07.12.22	USD	0	69.390.995	69.390.995

Wien, am 21. Juni 2023

Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

Mag. Sonja König
Geschäftsführerin

Mag. Andreas Witzani
Geschäftsführer

Bestätigungsvermerk

Bericht zum Abwicklungsbericht

Prüfungsurteil

Wir haben den Abwicklungsbericht der Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH, Wien, über den von ihr abzuwickelnden

Allianz PIMCO Mortgage,

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. März 2023, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Berichtszeitraum und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Abwicklungsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. März 2023 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Berichtszeitraum in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung gemäß § 49 Abs 5 InvFG 2011 in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Diese Grundsätze erfordern die Anwendung der International Standards on Auditing (ISA). Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt "Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Abwicklungsberichts" unseres Bestätigungsvermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und wir haben unsere sonstigen beruflichen Pflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns bis zum Datum des Bestätigungsvermerks erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu diesem Datum zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen im Abwicklungsbericht, ausgenommen die Vermögensaufstellung, die Ertragsrechnung, die sonstigen in Anlage I Schema B InvFG 2011 vorgesehenen Angaben und den Bestätigungsvermerk.

Unser Prüfungsurteil zum Abwicklungsbericht erstreckt sich nicht auf diese sonstigen Informationen und wir geben dazu keine Art der Zusicherung.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abwicklungsberichts haben wir die Verantwortlichkeit, diese sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Abwicklungsbericht oder zu unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf der Grundlage der von uns zu den vor dem Datum des Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers erlangten sonstigen Informationen durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Abwicklungsbericht

Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Aufstellung des Abwicklungsberichts und dafür, dass dieser in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011 ein möglichst getreues Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Fonds vermittelt. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachten, um die Aufstellung eines Abwicklungsberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Der Aufsichtsrat ist verantwortlich für die Überwachung des Rechnungslegungsprozesses der Gesellschaft betreffend den von ihr abzuwickelnden Fonds.

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Abwicklungsberichts

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abwicklungsbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist und einen Bestätigungsvermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Abwicklungsberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus gilt:

- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Abwicklungsbericht, planen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken, führen sie durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Wir gewinnen 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 der Gesellschaft abzugeben.

- Wir beurteilen die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängende Angaben.
- Wir beurteilen die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Abwicklungsberichts einschließlich der Angaben sowie ob der Abwicklungsbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse in einer Weise wiedergibt, dass ein möglichst getreues Bild erreicht wird.

Wir tauschen uns mit dem Aufsichtsrat unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung erkennen, aus.

Auftragsverantwortlicher Wirtschaftsprüfer

Der für die Abschlussprüfung auftragsverantwortliche Wirtschaftsprüfer ist Herr Mag. Wilhelm Kovsca.

Wien, am 21. Juni 2023

KPMG Austria GmbH

Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft

Mag. Wilhelm Kovsca
Wirtschaftsprüfer

Allgemeines zur Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

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

Angaben gem. VO (EU) 2019/2088/ VO (EU) 2020/852

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

FONDSBESTIMMUNGEN

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **Allianz PIMCO Mortgage**, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG), wurden von der Finanzmarktaufsicht (FMA) genehmigt.

Der Investmentfonds ist ein Organismus für gemeinsame Veranlagung in Wertpapieren (OGAW) und wird von der Allianz Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH (nachstehend „Verwaltungsgesellschaft“ genannt) mit Sitz in Wien verwaltet.

Artikel 1 Miteigentumsanteile

Die Miteigentumsanteile werden durch Anteilscheine (Zertifikate) mit Wertpapiercharakter verkörpert, die auf Inhaber lauten.

Die Anteilscheine werden in Sammelurkunden dargestellt. Effektive Stücke können daher nicht ausgefolgt werden.

Artikel 2 Depotbank (Verwahrstelle)

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die Erste Group Bank AG, Wien.

Zahlstellen für die Anteilscheine sind die Depotbank (Verwahrstelle) oder sonstige im Prospekt genannte Zahlstellen.

Artikel 3 Veranlagungsinstrumente und –grundsätze

Für den Investmentfonds dürfen nachstehende Vermögenswerte nach Maßgabe des InvFG ausgewählt werden.

Für den Allianz PIMCO Mortgage werden überwiegend, d.h. **mindestens 51 vH** des Fondsvermögens, Anleihen und sonstige verbrieft Schuldtitle, die als US Mortgage Bonds gelten, wobei das Schwergewicht auf Ginnie Mae-Bonds liegt, in Form von direkt erworbenen Einzeltiteln, sohin nicht indirekt oder direkt über Investmentfonds oder über Derivate, erworben.

Die nachfolgenden Veranlagungsinstrumente werden unter Einhaltung des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunkts für das Fondsvermögen erworben.

Wertpapiere

Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) dürfen **bis zu 100 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente, die von Australien, Belgien, Brasilien, Chile, Dänemark, Deutschland, Estland, Finnland, Frankreich, Griechenland, Indien, Irland, Island, Israel, Italien, Japan, Kanada, Liechtenstein, Luxemburg, Mexiko, Neuseeland, Niederlande, Norwegen, Österreich, Polen, Portugal, Russland, Schweden, Schweiz, Slowakische Republik, Slowenien, Spanien, Südafrika, Südkorea, Tschechische Republik, Türkei,

Ungarn, Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland, Vereinigte Staaten von Amerika begeben oder garantiert werden, dürfen **zu mehr als 35 vH** des Fondsvermögens erworben werden, sofern die Veranlagung in zumindest sechs verschiedenen Emissionen erfolgt, wobei die Veranlagung in ein und derselben Emission **30 vH** des Fondsvermögens nicht überschreiten darf.

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

Anteile an Investmentfonds

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen **jeweils bis zu 10 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr **als 10 vH** des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 20 vH** des Fondsvermögens und zur Absicherung eingesetzt werden.

Risiko-Messmethode(n) des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

Commitment Ansatz:

Der Commitment Wert wird gemäß dem 3. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV idgF ermittelt.

Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens gehalten werden. Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

Im Rahmen von Umschichtungen des Fondsportfolios und/oder der begründeten Annahme drohender Verluste bei Wertpapieren kann der Investmentfonds den Anteil an Wertpapieren unterschreiten und einen höheren Anteil an Sichteinlagen oder kündbaren Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten aufweisen.

Vorübergehend aufgenommene Kredite

Die Verwaltungsgesellschaft darf für Rechnung des Investmentfonds vorübergehend Kredite **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens aufnehmen.

Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte dürfen **im gesetzlich zulässigen Umfang** eingesetzt werden.

Wertpapierleihe

Wertpapierleihegeschäfte dürfen **bis zu 30 vH** des Fondsvermögens eingesetzt werden.

Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

Der Wert der Anteile wird an jedem österreichischen Bankarbeitstag ausgenommen Karfreitag und Silvester ermittelt.

Ausgabe und Ausgabeaufschlag

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 3,5 vH** zur Deckung der Ausgabekosten der Verwaltungsgesellschaft aufgerundet auf den nächsten Cent.

Die Ausgabe der Anteile ist grundsätzlich nicht beschränkt, die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch vor, die Ausgabe von Anteilscheinen vorübergehend oder vollständig einzustellen.

Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Der Rücknahmepreis entspricht dem Anteilswert abgerundet auf den nächsten Cent. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an.

Auf Verlangen eines Anteilinhabers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis auszus zahlen.

Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 01. Dezember bis zum 30. November.

Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

Für den Investmentfonds können sowohl Ausschüttungsanteilscheine und/oder Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Ausschüttungsanteilscheine und/oder Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung ausgegeben werden.

Ertragnisverwendung bei Ausschüttungsanteilscheinen (Ausschütter)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge (Zinsen und Dividenden) können nach Deckung der Kosten nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ausgeschüttet werden. Eine Ausschüttung kann unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilinhaber unterbleiben. Ebenso steht die Ausschüttung von Erträgen aus der Veräußerung von Vermögenswerten des Investmentfonds einschließlich von Bezugsrechten im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft. Eine Ausschüttung aus der Fondssubstanz sowie Zwischenausschüttungen sind zulässig.

Das Fondsvermögen darf durch Ausschüttungen in keinem Fall das im Gesetz vorgesehene Mindestvolumen für eine Kündigung unterschreiten.

Die Beträge sind an die Inhaber von Ausschüttungsanteilscheinen ab 01. Februar des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 01. Februar der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 01. Februar der gemäß InvFG ermittelte Betrag auszuführen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist, es sei denn, die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise durch die depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Der für das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gemäß InvFG maßgebliche Zeitpunkt ist jeweils der 01. Februar des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts auszuführen.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer Auslandstranche)

Der Vertrieb der Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung erfolgt nicht im Inland.

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Artikel 7 Verwaltungsgebühr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Verwaltungstätigkeit eine jährliche Vergütung bis zu einer Höhe von **1 vH** des Fondsvermögens, die auf Basis des täglichen Fondsvolumens berechnet und abgegrenzt wird. Die Vergütung wird dem Fondsvermögen einmal monatlich angelastet.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhält die abwickelnde Stelle eine Vergütung von **0,5 vH** des Fondsvermögens.

Nähere Angaben und Erläuterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.

Anhang

Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

1. Börsen mit amtlichem Handel und organisierten Märkten in den Mitgliedstaaten des EWR sowie Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR, die als gleichwertig mit geregelten Märkten gelten

Jeder Mitgliedstaat hat ein aktuelles Verzeichnis der von ihm genehmigten Märkte zu führen. Dieses Verzeichnis ist den anderen Mitgliedstaaten und der Kommission zu übermitteln.

Die Kommission ist gemäß dieser Bestimmung verpflichtet, einmal jährlich ein Verzeichnis der ihr mitgeteilten geregelten Märkte zu veröffentlichen.

Infolge verringerter Zugangsschranken und der Spezialisierung in Handelssegmente ist das Verzeichnis der „geregelten Märkte“ größeren Veränderungen unterworfen. Die Kommission wird daher neben der jährlichen Veröffentlichung eines Verzeichnisses im Amtsblatt der Europäischen Union eine aktualisierte Fassung auf ihrer offiziellen Internetseite zugänglich machen.

1.1. Das aktuell gültige Verzeichnis der geregelten Märkte finden Sie unter

https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg¹²

1.2. Folgende Börsen sind unter das Verzeichnis der *Geregelten Märkte* zu subsumieren:

- | | | |
|--------|-----------|---|
| 1.2.1. | Luxemburg | Euro MTF Luxemburg |
| 1.2.2. | Schweiz | SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG ³ |

1.3. Gemäß § 67 Abs. 2 Z 2 InvFG anerkannte Märkte im EWR:

Märkte im EWR, die von den jeweils zuständigen Aufsichtsbehörden als anerkannte Märkte eingestuft werden.

2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR

- | | | |
|------|----------------------|---|
| 2.1. | Bosnien Herzegowina: | Sarajevo, Banja Luka |
| 2.2. | Montenegro: | Podgorica |
| 2.3. | Russland: | Moscow Exchange |
| 2.4. | Serbien: | Belgrad |
| 2.5. | Türkei: | Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market") |

1 Zum Öffnen des Verzeichnisses in der Spalte links unter „Entity Type“ die Einschränkung auf „Regulated market“ auswählen und auf „Search“ (bzw. auf „Show table columns“ und „Update“) klicken. Der Link kann durch die ESMA geändert werden.

2 Sobald das Vereinigte Königreich Großbritannien und Nordirland (GB) aufgrund des Ausscheidens aus der EU seinen Status als EWR-Mitgliedstaat verliert, verlieren in weiterer Folge auch die dort ansässigen Börsen / geregelten Märkte ihren Status als EWR-Börsen / geregelte Märkte. Für diesen Fall weisen wir darauf hin, dass die in GB ansässigen Börsen und geregelten Märkte

Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange

3 Aufgrund des Auslaufens der Börsenäquivalenz für die Schweiz sind die *SIX Swiss Exchange AG* und die *BX Swiss AG* bis auf Weiteres unter Punkt 2 "Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR" zu subsumieren.

Allianz PIMCO Mortgage

3. Börsen in außereuropäischen Ländern

3.1.	Australien:	Sydney, Hobart, Melbourne, Perth
3.2.	Argentinien:	Buenos Aires
3.3.	Brasilien:	Rio de Janeiro, Sao Paulo
3.4.	Chile:	Santiago
3.5.	China:	Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange
3.6.	Hongkong:	Hongkong Stock Exchange
3.7.	Indien:	Mumbai
3.8.	Indonesien:	Jakarta
3.9.	Israel:	Tel Aviv
3.10.	Japan:	Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo
3.11.	Kanada:	Toronto, Vancouver, Montreal
3.12.	Kolumbien:	Bolsa de Valores de Colombia
3.13.	Korea:	Korea Exchange (Seoul, Busan)
3.14.	Malaysia:	Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad
3.15.	Mexiko:	Mexiko City
3.16.	Neuseeland:	Wellington, Auckland
3.17.	Peru	Bolsa de Valores de Lima
3.18.	Philippinen:	Philippine Stock Exchange
3.19.	Singapur:	Singapur Stock Exchange
3.20.	Südafrika:	Johannesburg
3.21.	Taiwan:	Taipei
3.22.	Thailand:	Bangkok
3.23.	USA:	New York, NYCE American, New York Stock Exchange (NYSE), Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati, Nasdaq
3.24.	Venezuela:	Caracas
3.25.	Vereinigte Arabische Emirate:	Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)

4. Organisierte Märkte in Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten der Europäischen Union

4.1.	Japan:	Over the Counter Market
4.2.	Kanada:	Over the Counter Market
4.3.	Korea:	Over the Counter Market
4.4.	Schweiz:	Over the Counter Market der Mitglieder der International Capital Market Association (ICMA), Zürich
4.5.	USA	Over The Counter Market (unter behördlicher Beaufsichtigung wie z.B. durch SEC, FINRA)

5. Börsen mit Futures und Options Märkten

5.1.	Argentinien:	Bolsa de Comercio de Buenos Aires
5.2.	Australien:	Australian Options Market, Australian Securities Exchange (ASX)
5.3.	Brasilien:	Bolsa Brasileira de Futuros, Bolsa de Mercadorias & Futuros, Rio de Janeiro Stock Exchange, Sao Paulo Stock Exchange
5.4.	Hongkong:	Hong Kong Futures Exchange Ltd.
5.5.	Japan:	Osaka Securities Exchange, Tokyo International Financial Futures Exchange, Tokyo Stock Exchange
5.6.	Kanada:	Montreal Exchange, Toronto Futures Exchange
5.7.	Korea:	Korea Exchange (KRX)
5.8.	Mexiko:	Mercado Mexicano de Derivados
5.9.	Neuseeland:	New Zealand Futures & Options Exchange
5.10.	Philippinen:	Manila International Futures Exchange
5.11.	Singapur:	The Singapore Exchange Limited (SGX)
5.12.	Südafrika:	Johannesburg Stock Exchange (JSE), South African Futures Exchange (SAFEX)
5.13.	Türkei:	TurkDEX
5.14.	USA:	NYCE American, Chicago Board Options Exchange, Chicago Board of Trade, Chicago Mercantile Exchange, Comex, FINEX, ICE Future US Inc. New York, Nasdaq, New York Stock Exchange, Boston Options Exchange (BOX)