

Allianz Strategiefonds

Balance

Jahresbericht

30. September 2021

Allianz Global Investors GmbH

Inhalt

Allianz Strategiefonds Balance

Tätigkeitsbericht	1
Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich	4
Vermögensübersicht zum 30.09.2021.....	5
Vermögensaufstellung zum 30.09.2021.....	6
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen.....	20
Ertrags- und Aufwandsrechnung	28
Entwicklung des Sondervermögens 2020/2021.....	30
Verwendung der Erträge des Sondervermögens	31
Anhang.....	32
Anteilklassen.....	32
VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS.....	46
Weitere Informationen (nicht durch das Testat erfasst)	49
Unterverwahrung (nicht durch das Testat erfasst)	51
Ihre Partner	54

Allianz Strategiefonds Balance

Tätigkeitsbericht

Der Fonds engagiert sich mit 40 bis 60 % seines Vermögens am internationalen Aktienmarkt. Daneben investiert er am Markt für Euro-Anleihen. Der Fonds muss mindestens 70 % seines Fondsvermögens in nachhaltige Investmentfonds oder Wertpapiere mit sozialen, ökologischen, geschäftlichen Verhaltens- oder Governance-Merkmalen investieren. Anlageziel ist es, in erster Linie auf langfristige Sicht vorwiegend für den Aktienteil Kapitalwachstum und für den Rententeil marktgerechte Zinserträge zu erwirtschaften.

Im Berichtsjahr war im Schnitt etwas mehr als die Hälfte des Fondsvermögens in Aktien investiert, wobei ihr Anteil per saldo etwas anstieg. Auf der Branchenebene entfiel nach wie vor der größte Teil der Anlagen auf den Bereich Informationstechnik (IT), ihre Quote erhöhte sich spürbar. Die Engagements in den Bereichen Gesundheit und Finanzen gewannen ebenfalls an Gewicht. Dagegen ging insbesondere der Anteil von Industriewerten und Titeln aus dem Bereich Klassischer Konsum zurück. Daneben blieben hauptsächlich Unternehmen aus dem Sektor Zyklischer Konsum vertreten. Der regionale Anlageschwerpunkt lag weiterhin auf dem US-amerikanischen Aktienmarkt. Gehalten wurden des Weiteren vor allem Unternehmen aus Japan. In Europa dominierten französische und britische Titel.

Im Rahmen der Anleihenengagements dominierte unverändert die Position im Bereich öffentlich-rechtlicher Emittenten. Neben erstklassigen Staatsanleihen aus Ländern wie Deutschland und Frankreich wurden nach wie vor Papiere aus der Euro-Peripherie gehalten. Außerdem bestand ein umfangreiches Engagement in Unternehmensanleihen. Neben Bankschuldverschreibungen standen hier Papiere von Industrieunternehmen und Konsumgüterherstellern im Vordergrund. Beigemischt blieben außerdem gedeckte Papiere (Covered Bonds) internationaler Banken. Die Duration (mittlere Kapitalbindungsdauer) der verzinslichen Anlagen stieg per saldo etwas an und betrug Ende September knapp fünf Jahre. Weiterhin bestanden geringfügige Beteiligungen an Fonds, die spezielle Segmente des globalen Anleihenmarkts abdecken.

Für die Abdeckung der Mindestschwelle von 70 % für die Multi Asset Nachhaltigkeitsstrategie hat das Fondsmanagement im Rahmen der seit März 2021 möglichen Nachhaltigkeitsansätze ausschließlich Investments in Wertpapiere nach der SRI-Strategie ausgewählt, da sich sowohl der Aktien- und Rententeil an Anlagestrategien orientiert, die die SRI-Strategie

umsetzen. Im Rahmen dieser Strategie wird als Auswahlkriterium ein internes SRI-Rating, das sich aus der Analyse von Nachhaltigkeitsaspekten wie Umwelt, Soziales und Governance gemäß den Vorgaben der SRI-Strategie ergibt, angewandt und für Direktanlagen eine Mindestausschlusskriterienliste berücksichtigt.

Im Berichtszeitraum hat sich das Fondsmanagement maßgeblich sowohl für den Aktien- als auch den Rententeil an solchen Anlagestrategien orientiert, die die SRI-Strategie umsetzen. Im Rahmen der Umsetzung bzw. Anwendung der SRI-Strategie wurden die Anlagen auf Basis des resultierenden SRI Ratings ausgewählt und gewichtet. Nach ihrer Implementierung wurde die Mindestschwelle von 70 % nicht unterschritten. Das Fondsmanagement hat sich hierbei auf Anlagen mit einem besseren Rating fokussiert.

Zur Integration der Ausschlussliste wurden auf Basis der Informationen externer ESG-Daten und Research-Anbieter keine Direktanlagen in:

- Unternehmen, die schwerwiegende Verstöße gegen den United Nations Global Compact begehen (Desinvestition von Emittenten, die nach dem entsprechenden Engagement nicht zu einer Änderung bereit sind),
- Emittenten, die an der Produktion umstrittener Waffen beteiligt sind oder Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus Waffen erzielen,
- Emittenten, die mehr als 10 % ihres Umsatzes mit Kraftwerkskohleförderung erzielen, und Energieversorger, die mehr als 20 % ihres Umsatzes mit Kohle erzielen, sowie
- Emittenten, die mit mehr als 5 % ihres Umsatzes an der Herstellung oder dem Vertrieb von Tabak beteiligt sind.

getätigt.

Die effektive Aktien-/Anleihenquote im Fonds wurde über Derivate auf Börsenindizes bzw. Staatsanleihen an das Marktumfeld angepasst.

Mit seiner Anlagepolitik gewann der Fonds stark an Wert. Dabei profitierte das Portfolio in erster Linie von meist deutlichen Wertsteigerungen im Aktienteil. Besonders positiv bemerkbar machte sich der hohe Anteil von US-Titeln, da sie im internatio-

nen Vergleich am besten abschnitten. Auf der Branchenebene legten insbesondere die Engagements in stark konjunktur-reagiblen Segmenten kräftig zu, allerdings fiel bei Aktien aus dem Dienstleistungssektor der Aufwärtstrend schwächer aus. Die verzinlichen Positionen warfen dagegen angesichts der Nullzinspolitik der führenden Notenbanken weiterhin kaum positive Erträge ab; insbesondere bei längerlaufenden staatlichen Papieren hoher Bonität kam es auch zu Kursrückgängen infolge leicht steigender Renditen.

Die Wertentwicklung wurde nach der BVI-Methode berechnet und betrug im Berichtszeitraum für die Anteilklasse A (EUR) 16,69 %, für die Anteilklasse IT2 (EUR) 17,70 %, für die Anteilklasse PT2 (EUR) 17,82 % und für die Anteilklasse R (EUR) 17,27 %. Für den Vergleichsindex 50% Bloomberg Barclays Capital Euro-Aggregate: 1-10 Year Return, 50% MSCI The World Index EUR Total Return (Net) Rebased Last Business Day Of Month In EUR betrug die Wertentwicklung im gleichen Zeitraum 14,41 %.

Die Covid-19 Pandemie führte zu hohen Volatilitäten und Unsicherheiten an den internationalen Kapitalmärkten. Aufgrund dieser Situation sind allgemeine Prognosen hinsichtlich Entwicklungen der Kapitalmärkte und künftiger Auswirkungen zusätzlich erschwert. Zum gegenwärtigen Zeitpunkt der Jahresberichterstellung ist es somit nicht möglich die direkten Auswirkungen der Covid-19 Pandemie auf das Sondervermögen abschließend zu beurteilen.

Zur Quantifizierung der im Berichtsjahr realisierten Marktpreisrisiken berechnet die Gesellschaft die Schwankungsbreite (Volatilität) der Anteilswerte des Sondervermögens in diesem Zeitraum. Diese Größe wird mit der Schwankungsbreite eines globalen gemischten Aktien/Renten-Indexportfolios verglichen. Wenn das Sondervermögen eine im Vergleich zum Indexportfolio deutlich erhöhte Schwankungsbreite realisiert hat, wird das Marktpreisrisiko des Sondervermögens als „hoch“ eingestuft. Liegt die Schwankungsbreite des Sondervermögens nicht weit von der des Indexportfolios entfernt, wird das Risiko als „mittel“ klassifiziert. Im Falle einer im Vergleich zum Indexportfolio deutlich kleineren Volatilität des Sondervermögens wird das Marktpreisrisiko als „gering“ bewertet.

Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance hat im Berichtszeitraum ein mittleres Marktpreisrisiko realisiert.

Die Beurteilung, ob Schwankungen einer Fremdwährung gegenüber der Basiswährung des Sondervermögens einen Einfluss auf den Wert des Sondervermögens haben, erfolgt auf Basis des Ausmaßes, mit dem das Sondervermögen im Berichtsjahr in Vermögenswerten in Fremdwährung investiert war, unter Berücksichtigung möglicher Absicherungsgeschäfte.

Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance war im Berichtszeitraum mit einem mittleren Ausmaß in Vermögenswerten investiert, welche direkt bei Schwankungen der Fremdwährung gegenüber der Basiswährung des Sondervermögens wertmäßigen Schwankungen unterliegen.

Die Beurteilung der durch das Sondervermögen im Berichtsjahr eingegangenen Liquiditätsrisiken erfolgt unter Berücksichtigung des Anteils von Vermögenswerten, deren Veräußerbarkeit potenziell eingeschränkt sein kann oder ggf. nur unter Inkaufnahme eines Abschlags auf den Verkaufspreis möglich ist.

Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance hat im Berichtszeitraum ein geringes Liquiditätsrisiko aufgewiesen.

Zur Quantifizierung der im Berichtsjahr eingegangenen Adressenausfallrisiken betrachtet die Gesellschaft den Anteil von ausfallgefährdeten Vermögenswerten und deren Ausfallpotenzial. Wenn das Sondervermögen im Berichtsjahr mit einem deutlichen Anteil in ausfallgefährdeten Vermögenswerten mit hohem Ausfallpotenzial investiert war, wird das Adressenausfallrisiko des Sondervermögens als „hoch“ eingestuft. Lag der Anteil von ausfallgefährdeten Vermögenswerten in einem moderaten Bereich bzw. war deren Ausfallpotenzial als mittel zu bewerten, wird das Risiko als „mittel“ klassifiziert. War das Sondervermögen mit einem geringen Anteil in ausfallgefährdete Vermögenswerte investiert oder war deren Ausfallpotenzial nur als gering einzustufen, wird das Adressenausfallrisiko als „gering“ eingeschätzt.

Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance war im Berichtszeitraum mit einem geringen Anteil in ausfallgefährdete Vermögenswerte investiert.

Zur Quantifizierung der im Berichtsjahr eingegangenen Zinsänderungsrisiken berechnet die Gesellschaft die Sensitivität des Sondervermögens in Bezug auf Veränderungen des aktuellen Zinsniveaus (über den mit der Duration gewichteten Anteil der zinssensitiven Positionen). Wenn das Sondervermögen im Berichtsjahr eine deutliche Sensitivität zu Veränderungen

des aktuellen Zinsniveaus aufgezeigt hat, wird das Zinsänderungsrisiko des Sondervermögens als „hoch“ eingestuft. Lag diese Zinssensitivität des Sondervermögens in einem moderaten Bereich, wird das Risiko als „mittel“ klassifiziert. Im Falle einer geringen Zinssensitivität des Sondervermögens wird das Zinsänderungsrisiko als „gering“ bewertet.

Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance war im Berichtszeitraum mit einem mittleren Ausmaß gegenüber Zinsrisiken sensitiv.

Zur Bewertung der operationellen Risiken in den Prozessen der Gesellschaft führt die Gesellschaft in relevanten Prozessen, die auf Basis einer risikoorientierten Gesamtübersicht identifiziert werden, detaillierte Risikoüberprüfungen durch, identifiziert Schwachstellen und definiert Maßnahmen zu deren Behebung. Werden definierte Leistungen an externe Unternehmen übertragen, überwacht die Gesellschaft diese im Rahmen laufender Qualitätskontrollen und regelmäßiger Überprüfungen. Treten Ereignisse aus operationellen Risiken auf, werden diese unverzüglich nach Entdeckung korrigiert, erfasst, analysiert und Maßnahmen zur Vermeidung festgelegt. Sollte ein Ereignis aus operationellen Risiken das Sondervermögen betreffen, so werden relevante Verluste grundsätzlich durch die Gesellschaft ausgeglichen.

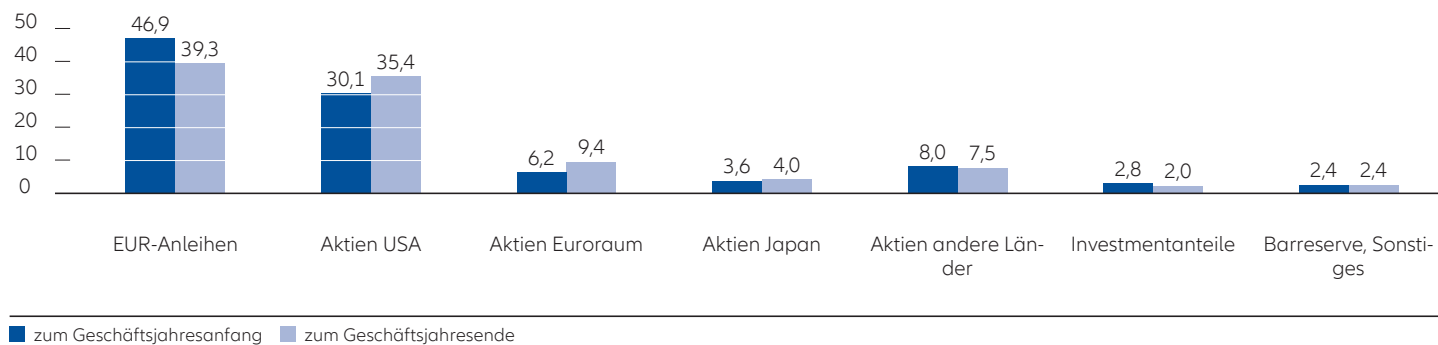
Das Sondervermögen Allianz Strategiefonds Balance war im Berichtszeitraum grundsätzlich operationellen Risiken in den Prozessen der Gesellschaft ausgesetzt, hat jedoch kein erhöhtes operationelles Risiko aufgewiesen.

Die wesentlichen Quellen des Veräußerungsergebnisses stellen sich im Berichtszeitraum wie folgt dar:

Die realisierten Gewinne resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von Aktien.

Für die realisierten Verluste ist im Wesentlichen die Veräußerung von Aktien ursächlich.

Struktur des Fondsvermögens in %



Entwicklung von Fondsvermögen und Anteilwert im 3-Jahresvergleich

		30.09.2021	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2018
Fondsvermögen in Mio. EUR					
- Anteilklasse A (EUR)	WKN: 979 725/ISIN: DE0009797258	924,3	822,0	881,9	834,0
- Anteilklasse IT2 (EUR)	WKN: A14 N9Y/ISIN: DE000A14N9Y9	6,1	3,5	2,8	0,9
- Anteilklasse PT2 (EUR)	WKN: 979 757/ISIN: DE0009797571	32,0	25,3	223,9	191,6
- Anteilklasse R (EUR)	WKN: A2D U1H/ISIN: DE000A2DU1H7	2,4	6,3	6,0	4,9
Anteilwert in EUR					
- Anteilklasse A (EUR)	WKN: 979 725/ISIN: DE0009797258	96,42	82,89	86,80	84,83
- Anteilklasse IT2 (EUR)	WKN: A14 N9Y/ISIN: DE000A14N9Y9	1.330,19	1.130,16	1.161,64	1.117,51
- Anteilklasse PT2 (EUR)	WKN: 979 757/ISIN: DE0009797571	1.643,33	1.394,82	1.432,37	1.376,60
- Anteilklasse R (EUR)	WKN: A2D U1H/ISIN: DE000A2DU1H7	118,29	101,69	106,46	103,94

Allianz Strategiefonds Balance

Vermögensübersicht zum 30.09.2021

Gliederung nach Anlagenart - Land	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ^{*)}
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	543.386.703,35	56,29
Deutschland	16.996.749,36	1,74
Frankreich	20.996.342,39	2,18
Niederlande	18.579.144,38	1,93
Italien	5.582.177,98	0,58
Irland	15.298.117,67	1,57
Dänemark	9.844.880,83	1,03
Spanien	6.422.186,02	0,67
Norwegen	3.620.341,35	0,37
Schweden	4.875.682,53	0,50
Finnland	1.988.916,05	0,21
Österreich	5.025.200,14	0,52
Schweiz	10.962.109,82	1,14
Großbritannien	19.246.763,68	1,98
USA	341.735.465,70	35,44
Kanada	9.988.393,98	1,04
Kaiman-Inseln	1.314.297,25	0,14
Singapur	3.806.044,13	0,39
Japan	38.417.297,53	3,97
Hongkong	1.096.607,69	0,11
Australien	7.589.984,87	0,78
2. Anleihen	378.653.942,12	39,25
Deutschland	49.035.714,53	5,07
Frankreich	82.578.594,87	8,60
Niederlande	19.860.834,02	2,05
Italien	59.405.938,36	6,15
Irland	5.341.504,86	0,55
Dänemark	2.434.992,00	0,25
Portugal	9.796.328,00	1,01
Spanien	42.563.467,21	4,43
Belgien	11.138.227,50	1,15
Luxemburg	4.451.163,43	0,46
Norwegen	1.311.573,32	0,13
Schweden	5.428.288,78	0,57
Finnland	4.347.112,30	0,45
Österreich	1.712.635,34	0,18
Polen	6.478.524,60	0,68
Rumänien	8.290.558,04	0,85
Großbritannien	10.032.298,79	1,02
USA	24.689.723,53	2,55
Australien	5.645.063,02	0,59
Neuseeland	1.016.793,40	0,11
Sonstige	23.094.606,22	2,40
3. Investmentanteile	19.064.395,55	1,99
Luxemburg	19.064.395,55	1,99
4. Sonstige Wertpapiere	7.288,42	0,00
Frankreich	7.288,42	0,00
5. Derivate	93.396,26	0,03
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	20.807.587,66	2,15

7. Sonstige Vermögensgegenstände	4.020.153,34	0,41
II. Verbindlichkeiten	-1.169.014,90	-0,12
III. Fondsvermögen	964.864.451,80	100,00

*) Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Gliederung nach Anlagenart - Währung	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ^{*)}
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien	543.386.703,35	56,29
AUD	7.589.984,87	0,78
CAD	9.988.393,98	1,04
CHF	7.308.645,53	0,76
DKK	9.844.880,83	1,03
EUR	76.062.138,52	7,88
GBP	21.122.125,94	2,17
HKD	2.410.904,94	0,25
JPY	38.417.297,53	3,97
NOK	3.620.341,35	0,37
SEK	4.875.682,53	0,50
SGD	3.806.044,13	0,39
USD	358.340.263,20	37,15
2. Anleihen	378.653.942,12	39,25
EUR	378.653.942,12	39,25
3. Investmentanteile	19.064.395,55	1,99
EUR	19.064.395,55	1,99
4. Sonstige Wertpapiere	7.288,42	0,00
EUR	7.288,42	0,00
5. Derivate	93.396,26	0,03
6. Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds	20.807.587,66	2,15
7. Sonstige Vermögensgegenstände	4.020.153,34	0,41
II. Verbindlichkeiten	-1.169.014,90	-0,12
III. Fondsvermögen	964.864.451,80	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								916.079.099,76	94,93
Aktien								543.386.703,35	56,29
Deutschland								16.996.749,36	1,74
DE000A1EWW00	adidas AG Namens-Aktien		STK	2.036	2.036	2.697 EUR	274,700	559.289,20	0,06
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien		STK	11.116	20.733	9.617 EUR	84,150	935.411,40	0,10
DE0005158703	Bechtle AG Inhaber-Aktien		STK	13.194	13.194	0 EUR	59,780	788.737,32	0,08
DE000A1DAHH0	Brenntag SE Namens-Aktien		STK	10.322	10.322	0 EUR	80,320	829.063,04	0,09
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co. KGaA Namens-Aktien		STK	3.254	3.254	0 EUR	71,750	233.474,50	0,02
DE0007100000	Daimler AG Namens-Aktien		STK	8.818	15.290	6.472 EUR	77,580	684.100,44	0,07
DE0008019001	Deutsche Pfandbriefbank AG Inhaber-Aktien		STK	27.014	51.806	24.792 EUR	9,786	264.359,00	0,03
DE0005552004	Deutsche Post AG Namens-Aktien		STK	64.006	64.006	0 EUR	54,640	3.497.287,84	0,36
DE0005557508	Deutsche Telekom AG Namens-Aktien		STK	57.766	57.766	0 EUR	17,526	1.012.406,92	0,10
DE000AOLD6E6	Gerresheimer AG Inhaber-Aktien		STK	5.973	5.973	0 EUR	85,500	510.691,50	0,05
DE0006231004	Infineon Technologies AG Namens-Aktien		STK	14.117	14.117	0 EUR	35,575	502.212,28	0,05
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien		STK	4.368	4.368	0 EUR	93,040	406.398,72	0,04
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE Namens-Aktien		STK	14.128	20.828	6.700 EUR	125,000	1.766.000,00	0,18
DE0006599905	Merck KGaA Inhaber-Aktien		STK	1.703	1.703	0 EUR	188,100	320.334,30	0,03
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien		STK	1.212	1.212	0 EUR	239,200	289.910,40	0,03
DE0007164600	SAP SE Inhaber-Aktien		STK	11.572	11.572	7.875 EUR	118,380	1.369.893,36	0,14
DE000A12DM80	Scout24 AG Namens-Aktien		STK	6.867	6.867	0 EUR	60,600	416.140,20	0,04
DE000SYM9999	Symrise AG Inhaber-Aktien		STK	2.351	2.351	0 EUR	113,500	266.838,50	0,03
DE0008303504	TAG Immobilien AG Inhaber-Aktien		STK	39.164	39.164	0 EUR	25,850	1.012.389,40	0,10
DE0007664039	Volkswagen AG Vorzugsaktien		STK	1.992	6.516	4.524 EUR	195,200	388.838,40	0,04
DE000A1ML7J1	Vonovia SE Namens-Aktien		STK	5.942	5.942	0 EUR	53,000	314.926,00	0,03
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien		STK	7.894	10.527	2.633 EUR	79,560	628.046,64	0,07
Frankreich								20.996.342,39	2,18
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Actions Port.		STK	5.057	5.057	9.942 EUR	139,720	706.564,04	0,07
FR0000120628	AXA S.A. Actions au Porteur		STK	143.942	67.022	1.074 EUR	24,170	3.479.078,14	0,36
FR0000131104	BNP Paribas S.A. Actions Port.		STK	11.341	0	12.862 EUR	55,660	631.240,06	0,07
FR0000125338	Capgemini SE Actions Port.		STK	1.718	1.718	7.134 EUR	183,750	315.682,50	0,03
FR0000120172	Carrefour S.A. Actions Port.		STK	16.924	16.924	0 EUR	15,840	268.076,16	0,03
FR0000121261	Cie Génle Ét Michelin SCPa Actions Nom.		STK	6.882	6.882	8.111 EUR	133,500	918.747,00	0,10
FR0000120222	CNP Assurances S.A. Actions Port.		STK	27.860	50.000	22.140 EUR	13,750	383.075,00	0,04
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur		STK	50.879	63.520	12.641 EUR	59,570	3.030.862,03	0,31
FR0000121147	Faurecia SE Actions Port.		STK	373	373.752	0,752 EUR	40,720	15.188,56	0,00
FR0000120321	L'Oréal S.A. Actions Port.		STK	7.129	7.129	0 EUR	364,250	2.596.738,25	0,27
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuit- ton SE Action Port.(C.R.)		STK	2.928	0	2.417 EUR	630,300	1.845.518,40	0,19
FR0010112524	Nexity Actions au Porteur		STK	7.300	7.300	4.089 EUR	41,420	302.366,00	0,03
FR0000130577	Publicis Groupe S.A. Actions Port.		STK	11.091	7.909	38.171 EUR	58,960	653.925,36	0,07
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port.		STK	641	2.475	1.834 EUR	487,500	312.487,50	0,03
FR0000121972	Schneider Electric SE Actions Port.		STK	23.419	1.005	313 EUR	144,020	3.372.804,38	0,35
FR0000130809	Société Générale S.A. Actions Port.		STK	23.954	52.626	28.672 EUR	27,370	655.620,98	0,07
FR0000120271	TotalEnergies SE Actions au Porteur		STK	24.729	36.393	11.664 EUR	41,600	1.028.726,40	0,11
FR0000124141	Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur		STK	10.151	10.151	0 EUR	26,520	269.204,52	0,03
FR0011981968	Worldline S.A. Actions Port.		STK	3.107	3.107	0 EUR	67,730	210.437,11	0,02
Niederlande								18.579.144,38	1,93
NL0000303709	AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)		STK	96.967	96.967	0 EUR	4,448	431.309,22	0,04
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Kon- kinkl. Aand. aan toonder		STK	115.559	40.077	6.968 EUR	29,025	3.354.099,98	0,35
NL0000334118	ASM International N.V. Reg.Shares		STK	5.318	9.542	4.224 EUR	343,300	1.825.669,40	0,19
NL0010273215	ASML Holding N.V. Aandelen op naam		STK	9.182	9.182	0 EUR	665,000	6.106.030,00	0,63
NL0006294274	Euronext N.V. Aandelen an toonder		STK	8.516	8.516	0 EUR	98,450	838.400,20	0,09
NL0011821202	ING Groep N.V. Aandelen op naam		STK	189.002	189.002	48.497 EUR	12,780	2.415.445,56	0,25
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder		STK	9.759	9.759	0 EUR	39,000	380.601,00	0,04
NL0010773842	NN Group N.V. Aandelen aan toonder		STK	11.792	11.792	35.935 EUR	45,510	536.653,92	0,06
NL0013654783	Prosus N.V. Reg.Shares		STK	14.920	14.920	0 EUR	69,200	1.032.464,00	0,11
NL0011821392	Signify N.V. Reg.Shares		STK	38.082	8.547	412 EUR	43,550	1.658.471,10	0,17
Italien								5.582.177,98	0,58
IT0001233417	A2A S.p.A. Azioni nom.		STK	669.134	669.134	0 EUR	1,803	1.206.114,04	0,13
IT0001207098	ACEA S.p.A. Azioni nom.		STK	12.368	12.368	0 EUR	18,570	229.673,76	0,02
IT0003128367	ENEL S.p.A. Azioni nom.		STK	278.731	278.731	391.639 EUR	6,754	1.882.549,17	0,20

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
IT0003027817	Iren S.p.A. Azioni nom.		STK	169.901	169.901	106.295 EUR	2,582	438.684,38	0,05
IT0005211237	Italgas S.P.A. Azioni nom.		STK	75.893	75.893	0 EUR	5,574	423.027,58	0,04
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A. Azioni nom.		STK	24.298	24.298	129.269 EUR	11,930	289.875,14	0,03
IT0004729759	Sesa S.p.A. Azioni nom.		STK	2.543	2.543	0 EUR	155,200	394.673,60	0,04
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A. Azioni nom.		STK	2.092.681	2.092.681	0 EUR	0,343	717.580,31	0,07
								15.298.117,67	1,57
Irland									
IE00B4BNMY34	Accenture PLC Reg.Shares Cl.A		STK	18.060	18.060	0 USD	323,530	5.034.640,30	0,52
IE0002424939	DCC PLC Reg.Shares		STK	9.743	9.743	0 GBP	62,620	706.673,61	0,07
IE0004927939	Kingspan Group PLC Reg.Shares		STK	5.515	402	0 EUR	85,480	471.422,20	0,05
IE00BZ12WP82	Linde PLC Reg.Shares		STK	10.992	15.345	4.353 USD	299,140	2.833.266,02	0,29
IE00BTN1Y115	Medtronic PLC Reg.Shares		STK	42.899	16.330	371 USD	126,580	4.678.950,00	0,48
IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC Reg.Shares		STK	7.973	7.973	0 USD	228,990	1.573.165,54	0,16
								9.844.880,83	1,03
Dänemark									
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B		STK	804	804	0 DKK	18.125,000	1.959.670,26	0,20
DK0010181759	Carlsberg AS Navne-Aktier B		STK	19.560	13.548	0 DKK	1.050,500	2.763.209,70	0,29
DK0010272632	GN Store Nord AS Navne-Aktier		STK	3.308	3.308	0 DKK	447,500	199.070,76	0,02
DK0060534915	Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B		STK	18.272	18.272	26.208 DKK	624,800	1.535.239,18	0,16
DK0060094928	Orsted A/S Indehaver Aktier		STK	2.137	19.851	17.714 DKK	863,200	248.064,66	0,03
DK0060252690	Pandora A/S Navne-Aktier		STK	9.049	11.204	2.155 DKK	805,200	979.835,78	0,10
DK0010219153	Rockwool International A/S Navne-Aktier B		STK	1.790	1.790	0 DKK	2.758,000	663.890,16	0,07
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier		STK	41.945	41.945	0 DKK	265,200	1.495.900,33	0,16
								6.422.186,02	0,67
Spanien									
ES0125220311	Acciona S.A. Acciones Port.		STK	2.490	2.490	0 EUR	144,400	359.556,00	0,04
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom.		STK	425.238	159.319	40.493 EUR	5,787	2.460.852,31	0,26
ES0113900J37	Banco Santander S.A. Acciones Nom.		STK	186.974	725.043	538.069 EUR	3,169	592.520,61	0,06
ES0127797019	EDP Renováveis S.A. Acciones Port.		STK	14.396	14.396	0 EUR	21,240	305.771,04	0,03
ES0144580Y14	Iberdrola S.A. Acciones Port.		STK	302.742	62.124	3.361 EUR	8,930	2.703.486,06	0,28
								3.620.341,35	0,37
Norwegen									
NO0010735343	Europris ASA Navne-Aksjer		STK	102.607	102.607	0 NOK	58,100	584.342,94	0,06
NO0005052605	Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer		STK	302.906	302.906	0 NOK	65,500	1.944.750,34	0,20
NO0003733800	Orkla ASA Navne-Aksjer		STK	138.849	107.807	76.635 NOK	80,180	1.091.248,07	0,11
								4.875.682,53	0,50
Schweden									
SE0007100581	Assa-Abloy AB Namn-Aktier B		STK	10.880	10.880	0 SEK	256,200	273.286,70	0,03
SE0011166610	Atlas Copco AB Namn-Aktier A		STK	7.085	60.521	53.436 SEK	530,600	368.567,96	0,04
SE0015658109	Epiroc AB Namn-Aktier A		STK	12.847	12.847	0 SEK	180,300	227.095,18	0,02
SE0000936478	Intrum AB Namn-Aktier		STK	8.800	8.800	0 SEK	237,800	205.165,81	0,02
SE0000825820	Lundin Energy AB Namn-Aktier		STK	49.065	49.065	0 SEK	324,400	1.560.497,66	0,16
SE0000120669	SSAB AB Namn-Aktier B (fria)		STK	205.700	205.700	0 SEK	37,710	760.503,64	0,08
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Akt. B (fria)		STK	53.296	53.296	0 SEK	99,320	518.969,46	0,05
SE0006422390	Thule Group AB (publ) Namn-Aktier		STK	22.291	22.291	0 SEK	440,000	961.596,12	0,10
								1.988.916,05	0,21
Finnland									
FI0009000202	Kesko Oyj Reg.Shares Cl.B		STK	66.055	66.055	0 EUR	30,110	1.988.916,05	0,21
								5.025.200,14	0,52
Österreich									
AT0000743059	OMV AG Inhaber-Aktien		STK	60.071	60.071	0 EUR	51,440	3.090.052,24	0,32
AT0000746409	Verbund AG Inhaber-Aktien		STK	15.308	15.308	0 EUR	91,050	1.393.793,40	0,14
AT0000831706	Wienerberger AG Inhaber-Aktien		STK	18.351	18.351	0 EUR	29,500	541.354,50	0,06
								10.962.109,82	1,14
Schweiz									
CH0044328745	Chubb Ltd. Reg.Shares		STK	2.272	2.272	0 USD	176,390	345.317,38	0,04
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien		STK	41.335	41.335	18.993 GBP	24,410	1.168.688,65	0,12
CH0114405324	Garmin Ltd. Namens-Aktien		STK	2.206	2.206	0 USD	157,780	299.911,83	0,03
CH0030170408	Geberit AG Namens-Aktien (Dispost.)		STK	1.864	3.774	1.910 CHF	695,400	1.196.442,31	0,12
CH0010645932	Givaudan SA Namens-Aktien		STK	100	100	0 CHF	4.257,000	392.929,67	0,04
CH0038863350	Nestlé S.A. Namens-Aktien		STK	13.434	10.074	23.410 CHF	113,600	1.408.623,22	0,15
CH0012005267	Novartis AG Namens-Aktien		STK	17.543	13.130	26.199 CHF	77,590	1.256.379,33	0,13
CH0024608827	Partners Group Holding AG Namens-Aktien		STK	672	1.131	459 CHF	1.471,000	912.416,47	0,09
CH0418792922	Sika AG Namens-Aktien		STK	1.601	1.601	0 CHF	298,000	440.371,05	0,05
CH0012549785	Sonova Holding AG Namens-Aktien		STK	5.112	5.112	0 CHF	360,600	1.701.483,48	0,18
CH0102993182	TE Connectivity Ltd. Namens-Aktien		STK	15.391	0	4.955 USD	138,710	1.839.546,43	0,19
								19.246.763,68	1,98
Großbritannien									
GB00B1YW4409	3i Group PLC Reg.Shares		STK	111.194	111.194	51.851 GBP	12,805	1.649.202,72	0,17
GB00B1XZS820	Anglo American PLC Reg.Shares		STK	11.504	11.504	13.905 GBP	26,255	349.843,66	0,04
GB0009895292	AstraZeneca PLC Reg.Shares		STK	1.902	1.902,31	0,31 GBP	89,560	197.304,82	0,02
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC Reg.Shares		STK	34.239	34.239	0 GBP	5,952	236.046,25	0,02
GB0002162385	Aviva PLC Reg.Shares		STK	658.221	658.221	0 GBP	3,986	3.038.940,07	0,31

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
GB0031348658	Barclays PLC Reg.Shares		STK	460.011	460.011	0 GBP	1,908	1.016.409,31	0,11
GB0000811801	Barratt Developments PLC Reg.Shares		STK	82.276	82.276	77.124 GBP	6,530	622.299,51	0,06
GB0030913577	BT Group PLC Reg.Shares		STK	683.255	683.255	0 GBP	1,631	1.290.377,34	0,13
GB0002318888	Cranswick PLC Reg.Shares		STK	5.315	10.378	5.063 GBP	36,214	222.940,04	0,02
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC Reg.Shares		STK	16.428	16.428	36.927 GBP	14,166	269.553,54	0,03
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC Reg.Shares		STK	85.010	131.390	46.380 GBP	8,115	799.045,75	0,08
GB00B019KW72	J. Sainsbury PLC Reg.Shs		STK	418.237	418.237	273.165 GBP	2,871	1.390.813,03	0,14
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC Reg.Shares		STK	1.072.244	1.072.244	0 GBP	0,467	579.621,56	0,06
GB00B7T77214	NatWest Group PLC Reg.Shares		STK	321.465	321.465	0 GBP	2,246	836.252,09	0,09
GB00BJ62K685	Pets At Home Group PLC Reg.Shares		STK	87.279	87.279	0 GBP	4,962	501.625,53	0,05
GB00BG11K365	Redrow PLC Reg.Shares		STK	109.871	109.871	0 GBP	6,684	850.553,11	0,09
GB00BDVZY77	Royal Mail PLC Reg.Shares		STK	191.966	191.966	0 GBP	4,329	962.553,78	0,10
GB00B5ZN1N88	Segro PLC Reg.Shares		STK	102.016	168.644	66.628 GBP	12,145	1.435.089,27	0,15
GB0007908733	SSE PLC Shares		STK	38.247	38.247	0 GBP	15,850	702.165,92	0,07
GB0008754136	Tate & Lyle PLC Reg.Shares		STK	119.586	119.586	60.511 GBP	7,000	969.597,50	0,10
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC Reg.Shares		STK	664.882	1.862.233	1.197.351 GBP	1,149	884.712,39	0,09
GB00B1KJ408	Whitbread PLC Reg.Shares		STK	11.209	11.209	0 GBP	34,030	441.816,49	0,05
USA								341.735.465,70	35,44
US88579Y1010	3M Co. Reg.Shares		STK	11.092	11.092	0 USD	180,880	1.728.767,36	0,18
US0028241000	Abbott Laboratories Reg.Shares		STK	10.827	10.827	30.530 USD	119,460	1.114.465,92	0,12
US00287Y1091	AbbVie Inc. Reg.Shares		STK	30.691	8.373	12.190 USD	108,840	2.878.297,74	0,30
US00507V1098	Activision Blizzard Inc. Reg.Shares		STK	29.162	15.712	2.616 USD	77,380	1.944.384,61	0,20
US00724F1012	Adobe Inc. Reg.Shares		STK	10.448	3.825	924 USD	577,700	5.200.818,23	0,54
US00846U1016	Agilent Technologies Inc. Reg.Shares		STK	29.690	27.457	1.872 USD	160,000	4.093.231,66	0,42
US02005N1000	Ally Financial Inc. Reg.Shares		STK	39.640	0	9.447 USD	51,620	1.763.144,03	0,18
US02079K1079	Alphabet Inc. Reg.Shares Cap.Stk CLC		STK	991	1.183	3.390 USD	2.690,420	2.297.364,37	0,24
US0231351067	Amazon.com Inc. Reg.Shares		STK	5.011	1.211	385 USD	3.301,120	14.253.511,11	1,48
US0258161092	American Express Co. Reg.Shares		STK	11.062	11.062	0 USD	171,540	1.635.065,68	0,17
US03027X1000	American Tower Corp. Reg.Shares		STK	5.506	2.629	6.169 USD	270,010	1.281.009,06	0,13
US0304201033	American Water Works Co. Inc. Reg.Shares		STK	22.134	25.386	3.252 USD	170,300	3.247.960,19	0,34
US0311621009	Amgen Inc. Reg.Shares		STK	17.573	6.041	161 USD	214,900	3.254.006,89	0,34
US0017441017	AMN Healthcare Services Inc. Reg.Shares		STK	21.293	21.293	0 USD	112,160	2.057.837,13	0,21
US0367521038	Anthem Inc. Reg.Shares		STK	3.639	1.154	7.101 USD	388,800	1.219.114,39	0,13
US0378331005	Apple Inc. Reg.Shares		STK	174.523	596	38.717 USD	142,830	21.478.712,76	2,24
US0382221051	Applied Materials Inc. Reg.Shares		STK	33.303	4.917	9.345 USD	128,270	3.680.820,14	0,38
US00206R1023	AT & T Inc. Reg.Shares		STK	41.116	21.904	70.760 USD	27,400	970.728,02	0,10
US0476491081	Atkore Inc. Reg.Shares		STK	10.454	10.454	9.100 USD	92,380	832.140,38	0,09
US0527691069	Autodesk Inc. Reg.Shares		STK	4.280	6.130	1.850 USD	287,990	1.062.080,22	0,11
US0530151036	Automatic Data Processing Inc. Reg.Shares		STK	13.915	5.212	121 USD	199,580	2.392.965,15	0,25
US05352A1007	Avantor Inc. Reg.Shares		STK	10.055	10.055	0 USD	40,820	353.664,30	0,04
US09062X1037	Biogen Inc. Reg.Shares		STK	1.881	514	6.139 USD	285,560	462.830,86	0,05
US09260D1072	Blackstone Inc. Reg.Shares		STK	7.131	15.172	8.041 USD	118,920	730.703,99	0,08
US09857L1089	Booking Holdings Inc. Reg.Shares		STK	383	383	0 USD	2.377,820	784.718,50	0,08
US1101221083	Bristol-Myers Squibb Co. Reg.Shares		STK	22.997	5.182	19.711 USD	60,620	1.201.221,96	0,12
US11135F1012	Broadcom Inc. Reg.Shares		STK	928	928	4.261 USD	489,480	391.398,42	0,04
US14448C1045	Carrier Global Corp. Reg.Shares		STK	12.980	12.980	0 USD	52,850	591.093,02	0,06
US12514G1085	CDW Corp. Reg.Shares		STK	15.213	15.213	3.843 USD	185,390	2.430.173,68	0,25
US15135B1017	Centene Corp. Reg.Shares		STK	9.056	9.056	0 USD	63,260	493.630,23	0,05
US1252691001	CF Industries Holdings Inc. Reg.Shares		STK	22.021	22.021	0 USD	56,520	1.072.445,75	0,11
US1696561059	Chipotle Mexican Grill Inc. Reg.Shares		STK	579	579	875 USD	1.846,540	921.241,36	0,10
US1255231003	Cigna Corp. Reg.Shares		STK	9.210	7.059	0 USD	203,930	1.618.366,55	0,17
US1720621010	Cincinnati Financial Corp. Reg.Shares		STK	6.952	6.952	0 USD	116,350	696.967,13	0,07
US17275R1023	Cisco Systems Inc. Reg.Shares		STK	113.991	45.356	6.821 USD	55,480	5.449.330,64	0,56
US1941621039	Colgate-Palmolive Co. Reg.Shares		STK	8.820	8.820	0 USD	77,080	585.796,04	0,06
US20030N1019	Comcast Corp. Reg.Shares CL.A		STK	53.244	31.785	28.089 USD	55,930	2.565.970,38	0,27
US2003401070	Comerica Inc. Reg.Shares		STK	18.105	32.404	14.299 USD	82,520	1.287.341,86	0,13
US2166484020	Cooper Companies Inc. Reg.Shares		STK	2.880	2.159	1.632 USD	422,300	1.047.972,08	0,11
US2193501051	Corning Inc. Reg.Shares		STK	8.086	8.086	0 USD	37,130	258.699,05	0,03
US22160K1051	Costco Wholesale Corp. Reg.Shares		STK	4.230	4.799	8.162 USD	451,790	1.646.694,84	0,17
US22788C1053	CrowdStrike Holdings Inc Reg.Shares CL.A		STK	4.167	4.167	0 USD	239,570	860.185,42	0,09
US2283681060	Crown Holdings Inc. Reg.Shares		STK	2.811	2.811	0 USD	100,980	244.586,43	0,03
US2310211063	Cummins Inc. Reg.Shares		STK	11.322	12.729	1.407 USD	230,670	2.250.351,76	0,23
US1266501006	CVS Health Corp. Reg.Shares		STK	24.262	24.262	34.894 USD	86,790	1.814.397,47	0,19
US23331A1097	D.R. Horton Inc. Reg.Shares		STK	33.146	19.366	192 USD	86,480	2.469.920,37	0,26
US2358511028	Danaher Corp. Reg.Shares		STK	11.821	4.368	104 USD	306,610	3.123.033,74	0,32
US2372661015	Darling Ingredients Inc. Reg.Shares		STK	11.666	11.666	0 USD	72,840	732.197,18	0,08

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
US2441991054	Deere & Co. Reg.Shares		STK	7.680	7.680	0 USD	350,870	2.321.900,48	0,24
US24703L2025	Dell Technologies Inc. Reg.Shares C		STK	29.063	34.869	5.806 USD	105,380	2.638.971,99	0,27
US2547091080	Discover Financial Services Reg.Shares		STK	20.667	20.667	0 USD	126,980	2.261.251,70	0,23
US2605571031	Dow Inc. Reg.Shares		STK	14.723	14.723	0 USD	58,820	746.203,83	0,08
US2644115055	Duke Realty Corp. Reg.Shares		STK	25.867	52.353	26.486 USD	48,620	1.083.670,28	0,11
US2786421030	eBay Inc. Reg.Shares		STK	16.924	16.924	0 USD	69,970	1.020.354,38	0,11
US28176E1082	Edwards Lifesciences Corp. Reg.Shares		STK	35.716	35.716	0 USD	113,520	3.493.585,21	0,36
US2855121099	Electronic Arts Inc. Reg.Shares		STK	9.877	9.877	0 USD	137,940	1.173.954,92	0,12
US5324571083	Eli Lilly and Company Reg.Shares		STK	20.467	5.649	4.321 USD	230,360	4.062.537,69	0,42
US29444U7000	Equinix Inc. Reg.Shares		STK	2.289	836	685 USD	801,580	1.580.988,86	0,16
US29977A1051	Evercore Inc. Reg.Shs A		STK	14.233	14.233	0 USD	136,420	1.673.056,62	0,17
US3021301094	Expeditors Intl of Wash. Inc. Reg.Shares		STK	25.848	44.770	18.922 USD	121,060	2.696.272,35	0,28
US30225T1025	Extra Space Storage Inc. Reg.Shs of Benef. Int.		STK	4.570	4.570	0 USD	172,010	677.338,93	0,07
US31847R1023	First American Financial Corp. Reg.Shares		STK	38.253	35.812	6.637 USD	67,640	2.229.488,54	0,23
US35137L2043	Fox Corp. Reg.Shares B		STK	17.456	17.456	0 USD	37,250	560.282,62	0,06
US3666511072	Gartner Inc. Reg.Shares		STK	1.288	1.288	0 USD	307,850	341.657,66	0,04
US3703341046	General Mills Inc. Reg.Shares		STK	13.687	4.160	31.035 USD	60,770	716.693,80	0,07
US37045V1008	General Motors Co. Reg.Shares		STK	33.545	3.801	4.529 USD	52,930	1.529.909,83	0,16
US3755581036	Gilead Sciences Inc. Reg.Shares		STK	20.628	20.628	0 USD	70,940	1.260.911,05	0,13
US4050241003	Haemonetics Corp. Reg.Shares		STK	12.884	12.884	0 USD	70,460	782.221,05	0,08
US40412C1018	HCA Healthcare Inc. Reg.Shares		STK	13.016	15.498	2.482 USD	252,210	2.828.628,98	0,29
US4314751029	Hill-Rom Holdings Inc. Reg.Shares		STK	16.626	16.626	11.338 USD	150,020	2.149.181,44	0,22
US4364401012	Hologic Inc. Reg.Shares		STK	7.478	7.478	0 USD	73,990	476.754,31	0,05
US40434L1052	HP Inc. Reg.Shares		STK	107.588	107.588	0 USD	27,310	2.531.755,01	0,26
US4435731009	HubSpot Inc. Reg.Shares		STK	2.209	2.209	0 USD	681,240	1.296.677,58	0,13
US4448591028	Humana Inc. Reg.Shares		STK	1.364	1.364	0 USD	395,350	464.656,76	0,05
US45168D1046	IDEXX Laboratories Inc. Reg.Shares		STK	5.414	6.623	1.209 USD	629,550	2.936.869,33	0,30
US4581401001	Intel Corp. Reg.Shares		STK	56.388	5.409	26.395 USD	53,490	2.598.935,09	0,27
US4592001014	Intl Business Machines Corp. Reg.Shares		STK	4.048	0	11.274 USD	139,180	485.460,03	0,05
US4612021034	Intuit Inc. Reg.Shares		STK	10.775	11.769	994 USD	546,930	5.077.911,98	0,53
US47233W1099	Jefferies Financial Group Inc. Reg.Shares		STK	57.371	57.371	0 USD	37,710	1.864.168,20	0,19
US4781601046	Johnson & Johnson Reg.Shares		STK	50.327	10.415	557 USD	164,020	7.112.691,86	0,74
US46625H1005	JPMorgan Chase & Co. Reg.Shares		STK	24.606	3.993	23.283 USD	165,950	3.518.474,60	0,36
US48666K1097	KB Home Reg.Shares		STK	9.157	9.157	0 USD	40,210	317.265,93	0,03
US49338L1035	Keysight Technologies Inc. Reg.Shares		STK	2.169	2.169	0 USD	166,890	311.907,64	0,03
US49456B1017	Kinder Morgan Inc. Reg.Shares P		STK	129.295	129.295	0 USD	16,920	1.885.029,86	0,20
US50540R4092	Laboratory Corp.of Amer. Hldgs Reg.Shares		STK	6.321	8.483	4.073 USD	286,910	1.562.671,24	0,16
US5128071082	Lam Research Corp. Reg.Shares		STK	2.282	2.282	0 USD	567,510	1.115.900,06	0,12
US5486611073	Lowe's Companies Inc. Reg.Shares		STK	17.186	23.790	6.604 USD	207,100	3.066.839,52	0,32
US50212V1008	LPL Financial Holdings Inc. Reg.Shares		STK	8.212	8.212	0 USD	159,220	1.126.633,61	0,12
US57636Q1040	Mastercard Inc. Reg.Shares A		STK	18.535	7.257	157 USD	353,190	5.640.753,65	0,58
US57686G1058	Matson Inc. Reg.Shares		STK	13.625	13.625	0 USD	81,190	953.180,60	0,10
US58933Y1055	Merck & Co. Inc. Reg.Shares		STK	71.716	42.052	414 USD	75,090	4.640.174,43	0,48
US59156R1086	MetLife Inc. Reg.Shares		STK	19.661	27.654	7.993 USD	62,580	1.060.174,38	0,11
US5926881054	Mettler-Toledo Intl Inc. Reg.Shares		STK	1.997	1.132	0 USD	1.408,440	2.423.553,21	0,25
US5951121038	Micron Technology Inc. Reg.Shares		STK	12.012	422	2.983 USD	71,640	741.492,98	0,08
US5949181045	Microsoft Corp. Reg.Shares		STK	90.659	5.646	6.093 USD	284,000	22.185.305,24	2,31
US60770K1079	Moderna Inc. Reg.Shares		STK	8.800	8.800	0 USD	378,900	2.873.051,57	0,30
US6092071058	Mondelez International Inc. Reg.Shares CLA		STK	44.134	44.134	42.862 USD	59,050	2.245.584,16	0,23
US6174464486	Morgan Stanley Reg.Shares		STK	35.927	42.628	47.151 USD	99,550	3.081.756,80	0,32
US55354G1004	MSCI Inc. Reg.Shares A		STK	1.512	1.584	4.172 USD	610,700	795.638,62	0,08
US6311031081	Nasdaq Inc. Reg.Shares		STK	1.733	15.870	14.137 USD	193,990	289.677,02	0,03
US64110L1061	Netflix Inc. Reg.Shares		STK	9.363	5.927	751 USD	599,060	4.833.052,24	0,50
US6516391066	Newmont Corp. Reg.Shares		STK	47.128	47.128	0 USD	53,710	2.181.073,53	0,23
US6541061031	NIKE Inc. Reg.Shares Cl.B		STK	11.459	13.518	2.059 USD	146,020	1.441.767,42	0,15
US67066G1040	NVIDIA Corp. Reg.Shares		STK	35.984	31.966	3.659 USD	205,170	6.361.498,67	0,66
US68389X1054	Oracle Corp. Reg.Shares		STK	66.947	66.947	0 USD	91,250	5.263.809,19	0,55
US67103H1077	O'Reilly Automotive Inc.[New] Reg.Shares		STK	1.086	0	914 USD	626,000	585.787,77	0,06
US68902V1070	Otis Worldwide Corp. Reg.Shares		STK	9.767	9.767	0 USD	83,320	701.207,57	0,07
US6907321029	Owens & Minor Inc. Reg.Shares		STK	9.795	9.795	0 USD	31,130	262.736,07	0,03
US70450Y1038	PayPal Holdings Inc. Reg.Shares		STK	23.064	18.270	2.375 USD	259,000	5.147.194,00	0,53
US7170811035	Pfizer Inc. Reg.Shares		STK	19.566	0	58.109 USD	43,530	733.883,06	0,08
US72352L1061	Pinterest Inc. Reg.Shares		STK	20.075	20.075	0 USD	50,370	871.291,84	0,09
US73278L1052	Pool Corp. Reg.Shares		STK	1.380	3.305	3.858 USD	446,830	531.321,70	0,06
US7433121008	Progress Software Corp. Reg.Shares		STK	17.969	31.413	27.441 USD	48,760	754.959,67	0,08
US7433151039	Progressive Corp. Reg.Shares		STK	27.965	51.456	23.491 USD	91,140	2.196.139,85	0,23

Die Fußnotenerklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
US74340W1036	ProLogis Inc. Reg.Shares		STK	9.076	12.317	3.241 USD	126,440	988.815,17	0,10
US7458671010	Pulte Group Inc. Reg.Shares		STK	26.652	0	4.830 USD	47,920	1.100.481,53	0,11
US7475251036	QUALCOMM Inc. Reg.Shares		STK	21.197	30.565	9.368 USD	129,280	2.361.249,55	0,24
US75886F1075	Regeneron Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares		STK	2.521	2.521	0 USD	606,700	1.317.901,60	0,14
US76009N1000	Rent-A-Center Inc. Reg.Shares		STK	23.048	23.048	22.145 USD	58,180	1.155.428,58	0,12
US78409V1044	S&P Global Inc. Reg.Shares		STK	2.569	9.226	9.802 USD	426,620	944.368,43	0,10
US79466L3024	salesforce.com Inc. Reg.Shares		STK	653	653,624	15.739,624 USD	270,500	152.200,68	0,02
US8168511090	Sempra Reg.Shares		STK	2.450	13.776	11.326 USD	127,460	269.076,73	0,03
US81762P1021	ServiceNow Inc. Reg.Shares		STK	2.159	2.159	0 USD	618,020	1.149.717,96	0,12
US8243481061	Sherwin-Williams Co. Reg.Shares		STK	2.670	2.670	0 USD	282,260	649.376,76	0,07
US83304A1060	Snap Inc. Reg.Shares		STK	16.929	16.929	0 USD	71,760	1.046.766,65	0,11
US83570H1086	Sonos Inc. Reg.Shares		STK	17.354	17.354	0 USD	32,870	491.513,49	0,05
US85208M1027	Sprouts Farmers Market Inc. Reg.Shares		STK	20.937	107.837	86.900 USD	23,570	425.216,57	0,04
US8522341036	Square Inc. Reg.Shs CL.A		STK	8.866	8.866	0 USD	236,040	1.803.223,16	0,19
US8552441094	Starbucks Corp. Reg.Shares		STK	7.636	0	7.432 USD	112,170	738.038,10	0,08
US8581191009	Steel Dynamics Inc. Reg.Shares		STK	21.343	0	29.161 USD	59,550	1.095.149,41	0,11
US8636671013	Stryker Corp. Reg.Shares		STK	1.216	1.216	0 USD	267,890	280.689,54	0,03
US78486Q1013	SVB Financial Group Reg.Shares		STK	1.405	1.405	0 USD	655,990	794.163,07	0,08
US8716071076	Synopsys Inc. Reg.Shares		STK	1.191	1.191	6.781 USD	302,620	310.560,01	0,03
US8740541094	Take-Two Interactive Softw.Inc Reg.Shares		STK	9.912	9.912	0 USD	151,600	1.294.781,96	0,13
US87612E1064	Target Corp. Reg.Shares		STK	14.820	10.319	15.127 USD	235,850	3.011.759,08	0,31
US87901J1051	TEGNA Inc. Reg.Shares		STK	32.610	32.610	0 USD	21,010	590.354,66	0,06
US88160R1014	Tesla Inc. Reg.Shares		STK	3.028	3.028	0 USD	781,310	2.038.521,98	0,21
US88162G1031	Tetra Tech Inc. Reg.Shares		STK	7.998	7.998	14.016 USD	149,600	1.030.977,38	0,11
US8825081040	Texas Instruments Inc. Reg.Shares		STK	21.447	11.749	206 USD	193,070	3.567.939,59	0,37
US0200021014	The Allstate Corp. Reg.Shares		STK	6.864	6.864	0 USD	129,330	764.914,15	0,08
US1912161007	The Coca-Cola Co. Reg.Shares		STK	52.623	52.623	29.468 USD	52,960	2.401.373,56	0,25
US5184391044	The Estée Lauder Compan. Inc. Reg.Shares CL.A		STK	2.446	2.446	0 USD	306,400	645.775,19	0,07
US38141G1040	The Goldman Sachs Group Inc. Reg.Shares		STK	7.609	7.609	0 USD	384,890	2.523.482,84	0,26
US4165151048	The Hartford Finl SvcsGrp Inc. Reg.Shares		STK	48.016	29.253	0 USD	71,680	2.965.651,53	0,31
US4278661081	The Hershey Co. Reg.Shares		STK	10.432	16.907	6.475 USD	171,900	1.545.181,85	0,16
US4370761029	The Home Depot Inc. Reg.Shares		STK	8.168	2.984	10.170 USD	336,930	2.371.327,59	0,25
US61945C1036	The Mosaic Co. Reg.Shares		STK	13.758	13.758	0 USD	36,490	432.578,88	0,04
US7427181091	The Procter & Gamble Co. Reg.Shares		STK	4.095	6.946	34.615 USD	142,020	501.117,49	0,05
US2546871060	The Walt Disney Co. Reg.Shares		STK	9.694	0	11.688 USD	172,680	1.442.385,01	0,15
US9694571004	The Williams Cos.Inc. Reg.Shares		STK	12.786	40.784	27.998 USD	26,270	289.421,58	0,03
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc. Reg.Shares		STK	11.004	3.142	885 USD	579,600	5.495.599,84	0,57
US90184L1026	Twitter Inc. Reg.Shares		STK	25.935	25.935	0 USD	60,070	1.342.394,08	0,14
US9024941034	Tyson Foods Inc. Reg.Shares CL.A		STK	29.417	7.143	2.662 USD	80,490	2.040.217,42	0,21
US9116841084	U.S. Cellular Corp. (USC) Reg.Shares		STK	16.112	16.112	0 USD	32,200	447.034,94	0,05
US9113121068	United Parcel Service Inc. Reg.Shares CL.B		STK	2.393	2.393	0 USD	184,740	380.925,27	0,04
US9113631090	United Rentals Inc. Reg.Shares		STK	2.604	2.604	0 USD	362,090	812.444,41	0,08
US91324P1021	UnitedHealth Group Inc. Reg.Shares		STK	12.133	3.153	6.394 USD	400,410	4.186.096,70	0,43
US91913Y1001	Valero Energy Corp. Reg.Shares		STK	3.807	3.807	0 USD	70,310	230.640,79	0,02
US92343V1044	Verizon Communications Inc. Reg.Shares		STK	107.246	34.133	1.021 USD	54,380	5.025.235,86	0,52
US92826C8394	VISA Inc. Reg.Shares CL.A		STK	5.326	3.259	14.850 USD	226,680	1.040.280,63	0,11
US94106L1098	Waste Management Inc. (Del.) Reg.Shares		STK	9.323	9.323	6.402 USD	151,600	1.217.842,23	0,13
US9621661043	Weyerhaeuser Co. Reg.Shares		STK	68.385	96.486	28.101 USD	36,580	2.155.463,62	0,22
US9699041011	Williams-Sonoma Inc. Reg.Shares		STK	4.747	4.747	0 USD	191,660	783.947,28	0,08
US9814751064	World Fuel Services Corp. Reg.Shares		STK	27.991	27.991	23.518 USD	33,500	807.977,68	0,08
US9858171054	Yelp Inc. Reg.Shares		STK	38.659	38.659	0 USD	37,980	1.265.149,13	0,13
US98585X1046	Yeti Holdings Inc. Reg.Shares		STK	3.929	3.929	0 USD	87,780	297.176,01	0,03
US98978V1035	Zoetis Inc. Reg.Shares CL.A		STK	5.169	5.169	0 USD	194,990	868.470,39	0,09
Kanada								9.988.393,98	1,04
CA11777Q2099	B2Gold Corp. Reg.Shares		STK	253.761	287.780	130.906 CAD	4,220	725.670,14	0,08
CA0636711016	Bank of Montreal Reg.Shares		STK	23.027	23.027	11.374 CAD	128,350	2.002.788,81	0,21
CA1469001053	Cascades Inc. Reg.Shares		STK	26.505	26.505	0 CAD	15,790	283.603,68	0,03
CA2918434077	Empire Co. Ltd. Reg.Shares CL.A		STK	32.184	32.184	0 CAD	38,200	833.115,67	0,09
CA3748252069	Gibson Energy Inc. Reg.Shares		STK	23.859	90.610	66.751 CAD	23,150	374.287,36	0,04
CA4488112083	Hydro One Ltd. Reg.Shares		STK	59.836	59.836	25.074 CAD	30,190	1.224.130,13	0,13
CA4969024047	Kinross Gold Corp. Reg.Shares		STK	111.815	111.815	0 CAD	6,680	506.149,08	0,05
CA56501R1064	Manulife Financial Corp. Reg.Shares		STK	133.686	45.916	22.446 CAD	24,750	2.242.141,70	0,23
CA67077M1086	Nutrien Ltd Reg.Shares		STK	5.983	0	8.024 CAD	82,850	335.902,66	0,03
CA8911605092	The Toronto-Dominion Bank Reg.Shares		STK	11.616	11.616	0 CAD	84,930	668.528,07	0,07
CA8934631091	TransAlta Renewables Inc. Reg.Shares		STK	60.942	60.942	0 CAD	19,180	792.076,68	0,08
Kaiman-Inseln								1.314.297,25	0,14

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
KYG8187G1055	SITC International Hldg.Co.Ltd Reg.Shs Reg.S		STK	425.000	425.000	0HKD	27,950	1.314.297,25	0,14
Singapur								3.806.044,13	0,39
SG1L01001701	DBS Group Holdings Ltd. Reg.Shares		STK	181.100	181.100	0SGD	30,370	3.482.008,80	0,36
SG1M31001969	United Overseas Bank Ltd. Reg.Shares		STK	19.800	19.800	0SGD	25,850	324.035,33	0,03
Japan								38.417.297,53	3,97
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co. Ltd. Reg.Shares		STK	80.300	130.800	50.500 JPY	2.709,000	1.675.285,97	0,17
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd. Reg.Shares		STK	62.400	44.200	0 JPY	3.739,000	1.796.819,51	0,19
JP3386450005	Eneos Holdings Inc. Reg.Shares		STK	524.300	792.800	268.500 JPY	455,900	1.840.830,71	0,19
JP3818000006	Fujitsu Ltd. Reg.Shares		STK	4.900	4.900	0 JPY	20.310,000	766.426,31	0,08
JP3822000000	H.U. Group Holdings Inc. Reg.Shares		STK	36.000	36.000	0 JPY	3.035,000	841.444,73	0,09
JP3768600003	Haseko Corp. Reg.Shares		STK	71.500	0	27.300 JPY	1.501,000	826.515,75	0,09
JP3788600009	Hitachi Ltd. Reg.Shares		STK	69.300	81.100	11.800 JPY	6.640,000	3.543.771,53	0,37
JP3854600008	Honda Motor Co. Ltd. Reg.Shares		STK	26.100	8.900	28.500 JPY	3.455,000	694.469,15	0,07
JP3137200006	Isuzu Motors Ltd. Reg.Shares		STK	22.800	73.900	51.100 JPY	1.473,000	258.643,75	0,03
JP3143600009	ITOCHU Corp. Reg.Shares		STK	23.800	8.200	60.000 JPY	3.277,000	600.644,91	0,06
JP3496400007	KDDI Corp. Reg.Shares		STK	72.700	63.800	49.900 JPY	3.691,000	2.066.535,44	0,21
JP3262900008	Kintetsu World Express Inc. Reg.Shares		STK	13.800	13.800	0 JPY	2.847,000	302.573,55	0,03
JP3877600001	Marubeni Corp. Reg.Shares		STK	303.100	233.600	162.900 JPY	933,200	2.178.337,00	0,23
JP3898400001	Mitsubishi Corp. Reg.Shares		STK	54.000	54.000	67.400 JPY	3.536,000	1.470.518,24	0,15
JP3893600001	Mitsui & Co. Ltd. Reg.Shares		STK	38.300	24.300	113.000 JPY	2.464,000	726.781,52	0,08
JP3912700006	Musashi Seimitsu Indust.Co.Ltd Reg.Shares		STK	13.000	13.000	0 JPY	1.959,000	196.129,17	0,02
JP3733000008	NEC Corp. Reg.Shares		STK	5.900	5.900	29.900 JPY	6.070,000	275.806,89	0,03
JP3756600007	Nintendo Co. Ltd. Reg.Shares		STK	3.200	5.600	2.400 JPY	54.310,000	1.338.425,44	0,14
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp. Reg.Shares		STK	127.200	100.000	0 JPY	3.085,000	3.022.085,04	0,31
JP3753000003	Nippon Yusen K.K. (NYK Line) Reg.Shares		STK	39.000	39.000	0 JPY	8.450,000	2.537.965,52	0,26
JP3762900003	Nomura Real Estate Hldgs Inc. Reg.Shares		STK	39.800	24.500	0 JPY	2.918,000	894.402,00	0,09
JP3420600003	Sekisui House Ltd. Reg.Shares		STK	114.000	45.900	900 JPY	2.351,500	2.064.496,90	0,21
JP3358800005	Shimizu Corp. Reg.Shares		STK	137.300	40.400	0 JPY	843,000	891.379,23	0,09
JP3396350005	Sky Perfect JSAT Holdings Inc. Reg.Shares		STK	129.000	129.000	0 JPY	429,000	426.198,00	0,04
JP3436100006	SoftBank Group Corp. Reg.Shares		STK	6.100	6.100	0 JPY	6.480,000	304.417,24	0,03
JP3435000009	Sony Group Corp. Reg.Shares		STK	25.300	13.100	0 JPY	12.455,000	2.426.770,20	0,25
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ. Group Reg.Shares		STK	61.100	61.100	0 JPY	3.944,000	1.855.848,49	0,19
JP3404200002	Sumitomo Rubber Ind. Ltd. Reg.Shares		STK	75.700	121.300	45.600 JPY	1.424,000	830.176,18	0,09
JP3633400001	Toyota Motor Corp. Reg.Shares		STK	114.500	91.600	16.700 JPY	2.000,000	1.763.599,16	0,18
Hongkong								1.096.607,69	0,11
HK0388045442	Hongkong Exch. + Clear. Ltd. Reg.Shs		STK	15.000	27.000	12.000HKD	479,800	796.295,68	0,08
HK0669013440	Techtronic Industries Co. Ltd. Reg.Shares		STK	17.500	67.000	49.500HKD	155,100	300.312,01	0,03
Australien								7.589.984,87	0,78
AU000000ANN9	Ansell Ltd. Reg.Shares		STK	23.101	23.101	0AUD	34,200	490.762,62	0,05
AU000000ANZ3	Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. Reg.Shares		STK	105.967	105.967	0AUD	28,150	1.852.949,68	0,19
AU000000JBH7	JB HI-FI Ltd. Reg.Shares		STK	16.666	16.666	0AUD	45,520	471.246,59	0,05
AU000000MIN4	Mineral Resources Ltd. Reg.Shares		STK	63.223	63.223	0AUD	44,810	1.759.805,34	0,18
AU000000NAB4	National Australia Bank Ltd. Reg.Shares		STK	174.418	174.418	0AUD	27,830	3.015.220,64	0,31
Verzinsliche Wertpapiere								372.692.396,41	38,64
EUR-Anleihen								372.692.396,41	38,64
XS1234370127	0,9500 % 3M Co. MTN S.F 15/23		EUR	900.000	0	0 %	102,214	919.927,62	0,10
XS2025466413	0,6250 % Abertis Infrastruc- turas S.A. MTN 19/25		EUR	1.700.000	1.700.000	0 %	101,969	1.733.465,52	0,18
XS1218821756	1,0000 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 15/25		EUR	800.000	0	0 %	104,228	833.820,64	0,09
XS1856791873	0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. MTN 18/23		EUR	1.400.000	0	0 %	101,551	1.421.716,38	0,15
XS2102283061	0,6000 % ABN AMRO Bank N.V. Non-Pref. MTN 20/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	101,755	1.017.551,00	0,11
XS1982037696	0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. Preferred MTN 19/26		EUR	700.000	700.000	0 %	102,579	718.050,76	0,07
FR0013302197	1,0000 % Aéroports de Paris S.A. Obl. 17/27		EUR	1.700.000	0	0 %	105,605	1.795.277,52	0,19
XS1135334800	1,0000 % Apple Inc. Notes 14/22		EUR	900.000	0	0 %	101,613	914.514,75	0,09
XS1292384960	1,3750 % Apple Inc. Notes 15/24		EUR	800.000	0	0 %	104,029	832.232,40	0,09
FR00140005T0	0,1250 % Arkema S.A. MTN 20/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	100,829	1.512.430,35	0,16
FR0013510179	2,8750 % Auchan Holding S.A. MTN 20/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	110,434	1.104.339,50	0,11
XS1014018045	2,5000 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. MT Cov.Bds 14/24		EUR	1.600.000	0	1.500.000 %	106,567	1.705.070,72	0,18
FR0011694033	2,9500 % Autoroutes du Sud de la France MTN 14/24		EUR	500.000	0	0 %	106,707	533.536,20	0,06
ES0413900129	3,8750 % Banco Santander S.A. Cédulas Hipotec. 06/26		EUR	3.000.000	0	0 %	118,084	3.542.511,30	0,37

Die Fußnotenerklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
XS1330948818	1,3750 % Banco Santander S.A. MTN 15/22		EUR	900.000	0	0	102,113	919.015,56	0,10
XS1079726334	2,3750 % Bank of America Corp. MTN 14/24		EUR	2.900.000	0	0	106,943	3.101.345,26	0,32
XS1458405898	0,7500 % Bank of America Corp. MTN 16/23		EUR	2.400.000	0	0	101,964	2.447.130,00	0,25
DE000A1R0XG3	2,0000 % BASF SE MTN 12/22		EUR	300.000	0	0	102,914	308.741,10	0,03
XS1017833242	2,5000 % BASF SE MTN 14/24		EUR	1.000.000	0	0	106,098	1.060.981,00	0,11
XS1823502577	1,5000 % BASF SE MTN 18/30		EUR	800.000	800.000	0	111,336	890.685,52	0,09
XS1948611840	1,5000 % BMW Finance N.V. MTN 19/29		EUR	300.000	0	0	109,646	328.938,33	0,03
XS0895249620	2,8750 % BNP Paribas S.A. MTN 13/23		EUR	1.300.000	0	0	106,472	1.384.132,62	0,14
XS1394103789	0,7500 % BNP Paribas S.A. MTN 16/22		EUR	1.200.000	0	0	101,372	1.216.468,44	0,13
XS1369250755	1,6250 % BNP Paribas S.A. MTN 16/26		EUR	1.700.000	0	0	107,522	1.827.869,92	0,19
XS1793252419	1,2500 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 18/25		EUR	2.400.000	2.400.000	0	104,308	2.503.383,84	0,26
FR0013444759	0,1250 % BNP Paribas S.A. Non-Preferred MTN 19/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0	99,721	1.495.809,45	0,16
XS2012047127	0,3750 % BNZ Inter. Fund. Ltd. (Ldn Br.) MTN 19/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,679	1.016.793,40	0,11
FR0011689579	3,0000 % BPCE S.A. MTN 14/24		EUR	1.500.000	0	0	109,147	1.637.204,85	0,17
FR0013312493	0,8750 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 18/24		EUR	1.900.000	0	0	102,455	1.946.637,21	0,20
FR0013412343	1,0000 % BPCE S.A. Non-Preferred MTN 19/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,387	1.033.865,90	0,11
XS0997775837	3,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 13/23		EUR	2.400.000	0	0	107,259	2.574.206,88	0,27
XS1717355561	1,6250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 17/27		EUR	1.300.000	0	0	106,092	1.379.193,66	0,14
FR0013425162	1,8750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 19/29		EUR	500.000	500.000	0	108,271	541.354,55	0,06
FR0014001168	0,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Non-Pref. MTN 21/28		EUR	1.000.000	1.000.000	0	98,346	983.455,60	0,10
FR0014002557	0,0100 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel Preferred MTN 21/26		EUR	700.000	700.000	0	99,774	698.417,37	0,07
DE0001135176	5,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 00/31		EUR	4.000.000	0	500.000	155,189	6.207.559,60	0,64
DE0001102309	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23		EUR	100.000	0	230.000	103,087	103.087,00	0,01
DE0001102325	2,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 13/23		EUR	100.000	0	1.000.000	105,194	105.194,00	0,01
DE0001102333	1,7500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24		EUR	200.000	0	1.300.000	105,961	211.922,00	0,02
DE0001102358	1,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 14/24		EUR	400.000	0	0	105,903	423.612,00	0,04
DE0001102374	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 15/25		EUR	900.000	0	0	104,103	936.927,00	0,10
DE0001102390	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 16/26		EUR	900.000	0	0	105,036	945.324,00	0,10
DE0001102416	0,2500 % Bundesrep.Deutschland Anl. 17/27		EUR	300.000	0	2.000.000	104,381	313.143,00	0,03
DE0001102440	0,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 18/28		EUR	4.150.000	0	3.450.000	106,362	4.414.023,00	0,46
DE0001102499	0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl. 20/30		EUR	4.000.000	0	500.000	102,945	4.117.799,60	0,43
FR0013235165	0,1250 % Cais. d'Amort.de la Dette Soc. MTN 17/22		EUR	2.000.000	0	1.100.000	100,799	2.015.975,20	0,21
ES0440609248	2,6250 % Caixabank S.A. Cédulas Hipotec. 14/24		EUR	800.000	0	0	107,378	859.025,68	0,09
XS2055758804	0,6250 % Caixabank S.A. Non-Preferred MTN 19/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,865	1.018.651,60	0,11
ES0313307201	0,8750 % Caixabank S.A. Preferred Bonos 19/24		EUR	1.500.000	1.500.000	0	102,628	1.539.423,90	0,16
XS1677902162	0,5000 % Carlsberg Breweries A/S MTN 17/23		EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,339	1.013.391,40	0,11
XS2133071774	0,6250 % Carlsberg Breweries A/S MTN 20/30		EUR	500.000	500.000	0	101,183	505.917,20	0,05
FR0012447696	0,7500 % Cie de Financement Foncier MT Obl. Fonc. 15/25		EUR	900.000	0	0	103,611	932.500,44	0,10
FR0013358843	0,8750 % Cie de Financement Foncier MT Obl. Fonc. 18/28		EUR	700.000	0	0	106,521	745.645,53	0,08
XS1457608013	0,7500 % Citigroup Inc. MTN 16/23		EUR	3.000.000	1.600.000	0	101,839	3.055.167,30	0,32
XS2022084367	1,6250 % CNH Industrial Finance Euro.SA MTN 19/29		EUR	1.000.000	0	0	106,452	1.064.516,10	0,11
XS0926785808	2,3750 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC Notes 13/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0	108,464	1.084.640,00	0,11
DE000CZ45VM4	0,8750 % Commerzbank AG MTN Anl. S.948 20/27		EUR	2.000.000	2.000.000	0	101,626	2.032.522,60	0,21
XS1876069185	1,5000 % Compass Group Fin. Netherl. BV MTN 18/28		EUR	1.600.000	0	0	108,817	1.741.070,40	0,18
XS1079320203	1,8750 % Compass Group PLC MTN 14/23		EUR	300.000	0	0	102,950	308.849,07	0,03
FR0013348802	0,8750 % Crédit Agricole Home Loan SFH MT Obl.Fin.Hab 18/28		EUR	1.200.000	0	0	106,547	1.278.558,00	0,13

Die Fußnotenerklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
XS1069521083	2,3750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 14/24		EUR	1.500.000	0	0 %	107,089	1.606.334,85	0,17
XS1028421383	3,1250 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) MTN 14/26		EUR	1.500.000	500.000	0 %	114,242	1.713.634,95	0,18
FR0013421815	1,0000 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) Preferred MTN 19/29		EUR	800.000	0	0 %	105,478	843.827,76	0,09
FR0011182542	4,1250 % Crédit Mutuel HomeLoan SFH SA MT Obl.Fin.Hab.12/24		EUR	500.000	0	0 %	110,551	552.755,00	0,06
DE000A2DADM7	0,8500 % Daimler Intl Finance B.V. MTN 17/25		EUR	600.000	0	0 %	103,291	619.747,68	0,06
DE000A2RYD83	0,6250 % Daimler Intl Finance B.V. MTN 19/23		EUR	500.000	0	0 %	101,411	507.053,95	0,05
FR0013216918	0,7090 % Danone S.A. MTN 16/24		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	102,800	1.542.001,65	0,16
XS1424730973	0,7500 % Danske Bank AS MTN 16/23		EUR	900.000	0	0 %	101,743	915.683,40	0,09
DE000DB7XJP9	1,1250 % Deutsche Bank AG MTN 15/25		EUR	2.000.000	0	0 %	103,373	2.067.460,20	0,21
XS1255436187	2,5000 % DH Europe Finance S.a.r.l. Notes 15/25		EUR	500.000	0	0 %	108,935	544.673,25	0,06
XS1637162592	1,2000 % DH Europe Finance S.a.r.l. Notes 17/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	105,480	1.054.796,30	0,11
XS1396253236	0,2500 % DNB Boligkredit A.S. Mortg. Cov. MTN 16/23		EUR	100.000	0	200.000 %	101,125	101.124,73	0,01
DE000A2BPI86	0,6250 % DZ HYP AG MTN Hyp.- Pfe. R.385 17/27 [WL]		EUR	1.900.000	0	0 %	104,694	1.989.181,82	0,21
XS2177580250	0,7500 % E.ON SE MTN 20/28		EUR	200.000	0	1.300.000 %	103,346	206.691,02	0,02
XS1721051495	1,5000 % EDP Finance B.V. MTN 17/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	107,414	1.074.144,70	0,11
XS1846632104	1,6250 % EDP Finance B.V. MTN 18/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	106,818	1.602.270,15	0,17
XS2053052895	0,3750 % EDP Finance B.V. MTN 19/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	101,169	1.011.694,80	0,10
XS0881369770	2,1250 % Eika Boligkredit A.S. MT Cov. Nts 13/23		EUR	100.000	0	400.000 %	103,483	103.482,52	0,01
FR0010961540	4,0000 % Electricité de France (E.D.F.) MTN 10/25		EUR	900.000	0	0 %	116,705	1.050.343,83	0,11
FR0013365285	0,8750 % Engie S.A. MTN 18/25		EUR	500.000	0	0 %	103,602	518.011,85	0,05
FR0013444775	0,0000 % Engie S.A. MTN 19/27		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	99,438	994.378,70	0,10
XS1493328477	1,1250 % ENI S.p.A. MTN 16/28		EUR	500.000	0	0 %	105,438	527.190,40	0,05
AT0000A2CCT6	0,1000 % Erste Group Bank AG MT Hyp.-Pfe. 20/30		EUR	1.500.000	0	0 %	100,449	1.506.740,40	0,16
XS1239586594	2,1250 % ESB Finance DAC MTN 15/27		EUR	1.400.000	0	0 %	111,060	1.554.846,86	0,16
XS2297177664	0,2500 % Essity AB MTN 21/31		EUR	500.000	500.000	0 %	96,675	483.375,30	0,05
EU000A1G0BC0	1,8750 % Europ.Fin.Stab.Faci- lity (EFSF) MTN 13/23		EUR	1.850.000	0	1.000.000 %	104,065	1.925.196,40	0,20
EU000A1G0BN7	2,1250 % Europ.Fin.Stab.Faci- lity (EFSF) MTN 14/24		EUR	3.400.000	0	400.000 %	106,376	3.616.797,26	0,37
EU000A1G0DE2	0,2000 % Europ.Fin.Stab.Faci- lity (EFSF) MTN 15/25		EUR	900.000	0	0 %	102,342	921.082,41	0,10
EU000A1G0DH5	0,4000 % Europ.Fin.Stab.Faci- lity (EFSF) MTN 16/26		EUR	3.700.000	0	0 %	103,617	3.833.833,44	0,40
EU000A1G0D70	0,9500 % Europ.Fin.Stab.Faci- lity (EFSF) MTN 18/28		EUR	2.100.000	0	0 %	107,496	2.257.407,39	0,23
XS0290050524	4,1250 % European Invest- ment Bank MTN 07/24		EUR	1.000.000	0	1.000.000 %	112,066	1.120.657,70	0,12
XS0427291751	4,5000 % European Invest- ment Bank MTN 09/25		EUR	300.000	0	0 %	120,157	360.469,92	0,04
XS0505157965	4,0000 % European Invest- ment Bank MTN 10/30		EUR	4.000.000	800.000	0 %	135,365	5.414.595,20	0,56
XS0755873253	3,5000 % European Invest- ment Bank MTN 12/27		EUR	3.000.000	0	2.200.000 %	121,486	3.644.566,50	0,38
DE000A185QA5	0,3750 % Evonik Industries AG MTN 16/24		EUR	2.400.000	0	0 %	101,385	2.433.233,52	0,25
DE000A289NX4	0,6250 % Evonik Industries AG MTN 20/25		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	102,428	1.536.423,30	0,16
XS1956028168	0,8750 % Fortum Oyj MTN 19/23		EUR	2.000.000	2.000.000	0 %	101,509	2.030.181,60	0,21
XS2178769076	1,0000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 20/26		EUR	1.500.000	0	0 %	103,846	1.557.693,60	0,16
XS2178769159	1,5000 % Fresenius Medical Care KGaA MTN 20/30		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	106,034	1.060.344,90	0,11
XS1529515584	1,5000 % HeidelbergCement AG MTN 16/25		EUR	500.000	0	0 %	104,837	524.185,85	0,05
XS1401174633	1,0000 % Heineken N.V. MTN 16/26		EUR	2.000.000	0	0 %	104,659	2.093.181,60	0,22
XS1672151492	1,7500 % Holcim Finance (Lu- xembg) S.A. MTN 17/29		EUR	800.000	800.000	0 %	109,077	872.612,72	0,09
XS1527758145	1,0000 % Iberdrola Finanzas S.A. MTN 16/24		EUR	1.900.000	0	0 %	102,906	1.955.210,58	0,20

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
XS1057055060	2,5000 % Iberdrola Internati- onal B.V. MTN 14/22		EUR	1.100.000	0	0 %	103,127	1.134.392,82	0,12
BE0002613918	0,7500 % ING Belgium SA/NV MT Mortg.Cov. Bds 18/26		EUR	1.900.000	0	0 %	104,883	1.992.777,00	0,21
XS2081018629	1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 19/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	103,260	1.032.598,50	0,11
XS2179037697	2,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. Pref. MTN 20/25		EUR	1.000.000	0	0 %	107,272	1.072.716,10	0,11
XS1843459782	1,8000 % Intl Flavors & Fragran- ces Inc. Notes 18/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	107,362	1.073.622,70	0,11
XS1174469137	1,5000 % JPMorgan Chase & Co. MTN 15/25		EUR	1.100.000	0	0 %	105,385	1.159.234,01	0,12
BE0000349580	0,1000 % Königreich Belgien Bons d'Etat 20/30		EUR	1.000.000	0	0 %	101,367	1.013.669,00	0,11
BE0000347568	0,9000 % Königreich Belgien Obl. Lin. 19/29		EUR	1.200.000	0	0 %	108,352	1.300.224,00	0,13
BE0000291972	5,5000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.31 98/28		EUR	2.600.000	0	0 %	138,680	3.605.680,00	0,37
BE0000334434	0,8000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.74 15/25		EUR	1.900.000	0	0 %	105,232	1.999.408,00	0,21
BE0000337460	1,0000 % Königreich Belgien Obl. Lin. S.77 16/26		EUR	200.000	0	0 %	107,095	214.190,00	0,02
NL0010418810	1,7500 % Königreich Niederlande Anl. 13/23		EUR	200.000	0	0 %	104,482	208.964,00	0,02
NL0011819040	0,5000 % Königreich Niederlande Anl. 16/26		EUR	500.000	0	0 %	105,082	525.410,00	0,05
NL0012818504	0,7500 % Königreich Niederlande Anl. 18/28		EUR	100.000	0	0 %	107,641	107.641,00	0,01
NL0013332430	0,2500 % Königreich Niederlande Anl. 19/29		EUR	100.000	0	1.400.000 %	103,981	103.981,00	0,01
ES00000123X3	4,4000 % Königreich Spanien Bonos 13/23		EUR	300.000	0	0 %	110,379	331.137,00	0,03
ES00000124W3	3,8000 % Königreich Spanien Bonos 14/24		EUR	1.000.000	0	0 %	111,174	1.111.740,00	0,12
ES00000126B2	2,7500 % Königreich Spanien Bonos 14/24		EUR	700.000	0	4.000.000 %	110,036	770.252,00	0,08
ES0000012A97	0,4500 % Königreich Spanien Bonos 17/22		EUR	5.200.000	0	0 %	101,184	5.261.568,00	0,55
ES0000012B88	1,4000 % Königreich Spanien Bonos 18/28		EUR	3.500.000	0	0 %	109,685	3.838.975,00	0,40
ES00000122E5	4,6500 % Königreich Span- ien Obligaciones 10/25		EUR	2.000.000	0	0 %	119,569	2.391.380,00	0,25
ES00000127Z9	1,9500 % Königreich Span- ien Obligaciones 16/26		EUR	3.000.000	1.000.000	6.000.000 %	110,362	3.310.860,00	0,34
ES0000012A89	1,4500 % Königreich Span- ien Obligaciones 17/27		EUR	3.000.000	500.000	2.500.000 %	109,477	3.284.310,00	0,34
ES0000012G26	0,8000 % Königreich Span- ien Obligaciones 20/27		EUR	2.000.000	500.000	0 %	105,338	2.106.759,80	0,22
ES0000012F76	0,5000 % Königreich Span- ien Obligaciones 20/30		EUR	4.800.000	4.500.000	0 %	102,397	4.915.056,00	0,51
ES0000012G34	1,2500 % Königreich Span- ien Obligaciones 20/30		EUR	2.500.000	2.500.000	0 %	108,633	2.715.820,75	0,28
DE000A0PM5F0	4,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 07/23		EUR	550.000	0	950.000 %	106,671	586.691,82	0,06
DE000A168Y55	0,3750 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 16/26		EUR	1.550.000	0	0 %	103,554	1.605.082,97	0,17
DE000A2DAR24	0,1250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 17/24		EUR	800.000	0	2.000.000 %	101,632	813.055,68	0,08
DE000A2LQSH4	0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau MTN 18/28		EUR	5.100.000	0	0 %	106,636	5.438.443,65	0,56
FR0013090578	0,5000 % La Banq. Postale Home Loan SFH MT Obl.FinHab 16/23		EUR	250.000	0	1.000.000 %	101,287	253.217,83	0,03
FR0013286838	1,0000 % La Banque Postale Non-Pref. MTN 17/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	103,280	1.032.800,10	0,11
DE000RLP0728	0,7500 % Land Rheinland- Pfalz Landesch. 16/26		EUR	900.000	0	0 %	104,693	942.236,10	0,10
DE000A2GSCL6	0,5000 % Land Sachsen-Anhalt MTN Landesch. 17/27		EUR	2.200.000	0	0 %	104,128	2.290.808,74	0,24
XS1167204699	1,2500 % Lloyds Bank PLC MTN 15/25		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	104,653	1.569.797,40	0,16
XS2090859252	0,8750 % Mediobanca - Bca Cred. Fin. SpA Preferred MTN 19/26		EUR	1.000.000	0	0 %	102,396	1.023.956,50	0,11
XS0873665706	2,3750 % Metropolitan Life Glo- bal Fdg I MTN 13/23		EUR	500.000	0	0 %	103,574	517.870,30	0,05
XS1511787589	1,3750 % Morgan Stanley MTN S.G 16/26		EUR	2.000.000	0	0 %	106,295	2.125.891,20	0,22
DE000MHB17J8	0,5000 % Münchener Hypotheken- bank MTN Hyp. -Pfe.S.1718 16/26		EUR	850.000	0	0 %	103,554	880.205,60	0,09
XS1548533329	0,6250 % Municipality Finance PLC MTN 17/26		EUR	500.000	0	1.600.000 %	104,599	522.992,50	0,05
XS1191309720	0,8750 % National Australia Bank Ltd. Mort.Cov.MT Bds 15/27		EUR	900.000	0	0 %	105,374	948.369,69	0,10
XS1308693867	0,7500 % Nationwide Building So- ciety MT Mortg.Cov.Bds 15/22		EUR	100.000	0	400.000 %	101,323	101.323,23	0,01
XS1170307414	1,3750 % Naturgy Finance B.V. MTN 15/25		EUR	400.000	0	0 %	104,831	419.325,80	0,04
XS1382368113	2,5000 % NatWest Group PLC MTN 16/23		EUR	300.000	0	0 %	104,014	312.042,18	0,03
XS1319652902	0,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 15/23		EUR	900.000	0	0 %	101,618	914.565,06	0,09

Die Fußnotenerklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
XS1368470156	1,0000 % Nordea Bank Abp MTN 16/23		EUR	1.500.000	1.000.000	0	102,042	1.530.624,45	0,16
XS1408317433	1,0000 % Orange S.A. MTN 16/25		EUR	1.000.000	500.000	0	103,938	1.039.379,20	0,11
FR0013396512	1,1250 % Orange S.A. MTN 19/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,513	1.035.131,00	0,11
FR0013444676	0,0000 % Orange S.A. MTN 19/26		EUR	1.300.000	1.300.000	0	99,949	1.299.333,49	0,13
XS1405769487	0,8750 % PPG Industries Inc. Notes 16/25		EUR	1.400.000	0	0	103,606	1.450.481,62	0,15
XS1423826798	1,7500 % REN Finance B.V. MTN S.3 16/23		EUR	1.300.000	0	0	103,212	1.341.754,31	0,14
FR0010466938	4,2500 % Rep. Frankreich OAT 07/23		EUR	1.150.000	0	3.150.000	110,261	1.268.001,50	0,13
FR0010916924	3,5000 % Rep. Frankreich OAT 10/26		EUR	500.000	0	2.500.000	118,295	591.475,00	0,06
FR0011962398	1,7500 % Rep. Frankreich OAT 14/24		EUR	1.800.000	0	0	107,482	1.934.676,00	0,20
FR0011883966	2,5000 % Rep. Frankreich OAT 14/30		EUR	4.800.000	2.500.000	500.000	122,190	5.865.119,52	0,61
FR0012938116	1,0000 % Rep. Frankreich OAT 15/25		EUR	300.000	0	1.000.000	106,341	319.023,00	0,03
FR0013250560	1,0000 % Rep. Frankreich OAT 16/27		EUR	5.900.000	0	4.500.000	107,710	6.354.890,00	0,66
FR0013286192	0,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/28		EUR	1.500.000	1.500.000	0	106,699	1.600.485,00	0,17
FR0013341682	0,7500 % Rep. Frankreich OAT 17/28		EUR	3.750.000	0	0	106,818	4.005.675,00	0,42
FR0013407236	0,5000 % Rep. Frankreich OAT 18/29		EUR	6.600.000	0	0	104,866	6.921.155,34	0,72
FI4000278551	0,5000 % Republik Finnland Bonds 17/27		EUR	250.000	0	0	105,326	263.313,75	0,03
IE00B4TV0D44	5,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 09/25		EUR	500.000	2.050.000	1.550.000	120,693	603.465,00	0,06
IE00B4S3JD47	3,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 13/23		EUR	100.000	0	0	106,735	106.735,00	0,01
IE00B6X95T99	3,4000 % Republik Irland Treasury Bonds 14/24		EUR	400.000	0	0	109,952	439.808,00	0,05
IE00BV8C9418	1,0000 % Republik Irland Treasury Bonds 16/26		EUR	200.000	0	1.000.000	106,747	213.494,00	0,02
IE00BDHDP444	0,9000 % Republik Irland Treasury Bonds 18/28		EUR	1.000.000	0	0	107,600	1.076.000,00	0,11
IE00BFZRQ242	1,3500 % Republik Irland Treasury Bonds 18/31		EUR	1.200.000	1.200.000	0	112,263	1.347.156,00	0,14
IT0004356843	4,7500 % Republik Italien B.T.P. 08/23		EUR	5.000.000	0	0	109,564	5.478.200,00	0,57
IT0004513641	5,0000 % Republik Italien B.T.P. 09/25		EUR	100.000	0	0	117,715	117.715,00	0,01
IT0004953417	4,5000 % Republik Italien B.T.P. 13/24		EUR	1.500.000	0	0	111,645	1.674.675,00	0,17
IT0004889033	4,7500 % Republik Italien B.T.P. 13/28		EUR	3.800.000	0	0	129,435	4.918.529,62	0,51
IT0005001547	3,7500 % Republik Italien B.T.P. 14/24		EUR	2.900.000	1.000.000	0	111,634	3.237.386,00	0,34
IT0005090318	1,5000 % Republik Italien B.T.P. 15/25		EUR	4.200.000	1.200.000	0	105,985	4.451.370,00	0,46
IT0005127086	2,0000 % Republik Italien B.T.P. 15/25		EUR	5.000.000	0	0	108,485	5.424.250,00	0,56
IT0005215246	0,6500 % Republik Italien B.T.P. 16/23		EUR	5.000.000	0	700.000	102,176	5.108.800,00	0,53
IT0005170839	1,6000 % Republik Italien B.T.P. 16/26		EUR	3.000.000	3.000.000	0	107,203	3.216.089,70	0,33
IT0005210650	1,2500 % Republik Italien B.T.P. 16/26		EUR	1.200.000	0	3.000.000	105,721	1.268.651,88	0,13
IT0005274805	2,0500 % Republik Italien B.T.P. 17/27		EUR	3.000.000	3.500.000	1.500.000	110,375	3.311.249,70	0,34
IT0005325946	0,9500 % Republik Italien B.T.P. 18/23		EUR	3.500.000	0	1.000.000	101,995	3.569.825,00	0,37
IT0005323032	2,0000 % Republik Italien B.T.P. 18/28		EUR	2.500.000	500.000	0	110,453	2.761.324,75	0,29
IT0005340929	2,8000 % Republik Italien B.T.P. 18/28		EUR	4.400.000	1.000.000	600.000	116,551	5.128.243,56	0,53
IT0005422891	0,9000 % Republik Italien B.T.P. 20/31		EUR	5.500.000	5.500.000	0	101,197	5.565.834,45	0,58
AT0000A1VGK0	0,5000 % Republik Österreich Bundesanl. 17/27		EUR	100.000	0	0	105,171	105.171,45	0,01
AT0000A2CQD2	0,0000 % Republik Österreich MTN 20/30		EUR	100.000	500.000	400.000	100,723	100.723,49	0,01
XS1508566392	1,0000 % Republik Polen MTN 16/28		EUR	3.000.000	3.000.000	0	107,826	3.234.768,00	0,34
XS1958534528	1,0000 % Republik Polen MTN 19/29		EUR	3.000.000	3.000.000	0	108,125	3.243.756,60	0,34
PTOTEAOE0021	4,9500 % Republik Portugal Obr. 08/23		EUR	2.000.000	2.000.000	0	111,772	2.235.440,00	0,23
PTOTEQOE0015	5,6500 % Republik Portugal Obr. 13/24		EUR	100.000	0	1.800.000	115,060	115.060,00	0,01
PTOTEROE0014	3,8750 % Republik Portugal Obr. 14/30		EUR	1.300.000	0	0	131,708	1.712.204,00	0,18
PTOTEKOE0011	2,8750 % Republik Portugal Obr. 15/25		EUR	1.700.000	0	0	113,848	1.935.416,00	0,20
PTOTETOE0012	2,8750 % Republik Portugal Obr. 16/26		EUR	2.200.000	0	0	115,904	2.549.888,00	0,26
PTOTEUOE0019	4,1250 % Republik Portugal Obr. 17/27		EUR	1.000.000	0	0	124,832	1.248.320,00	0,13
XS1420357318	2,8750 % Republik Rumänien MTN 16/28 Reg.S		EUR	1.400.000	1.400.000	0	111,303	1.558.240,04	0,16
XS1599193403	2,3750 % Republik Rumänien MTN 17/27 Reg.S		EUR	1.000.000	1.000.000	0	108,930	1.089.303,50	0,11
XS2178857954	3,6240 % Republik Rumänien MTN 20/30 Reg.S		EUR	5.000.000	5.000.000	0	112,860	5.643.014,50	0,58
FR0013201639	0,5000 % Sanofi S.A. MTN 16/27		EUR	400.000	0	0	103,059	412.236,16	0,04
XS2050945984	0,1250 % Santander Consumer Bank AS MTN 19/24		EUR	1.000.000	1.000.000	0	100,571	1.005.707,40	0,10
XS1748479919	0,5000 % Santander UK PLC MT Cov. Bds 18/25		EUR	1.400.000	0	0	102,518	1.435.250,60	0,15
DE000A13SL26	1,1250 % SAP SE MTN 14/23		EUR	1.100.000	0	0	101,820	1.120.020,22	0,12
DE000A13SL34	1,7500 % SAP SE MTN 14/27		EUR	900.000	0	0	109,454	985.082,67	0,10
FR0013368602	2,1250 % Société Générale S.A. Non-Preferred MTN 18/28		EUR	1.800.000	0	0	109,807	1.976.522,40	0,20
FR0013486701	0,1250 % Société Générale S.A. Preferred MTN 20/26		EUR	1.500.000	1.500.000	0	100,408	1.506.120,15	0,16
FR0011859495	2,0000 % Société Générale SFH S.A. MT Obl.Fin.Hob. 14/24		EUR	900.000	0	0	106,203	955.831,05	0,10
BE6315847804	0,5000 % Solvay S.A. Notes 19/29		EUR	1.000.000	0	0	101,228	1.012.279,50	0,10
XS1377237869	0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit AS MT Mortg.Cov.Bds 16/23		EUR	100.000	0	400.000	101,259	101.258,67	0,01
XS2156787173	1,7500 % SSE PLC MTN 20/30		EUR	1.800.000	1.000.000	0	108,169	1.947.041,82	0,20

Die Fußnotenklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
FR0012949923	1,7500 % Suez S.A. MTN 15/25		EUR	500.000	0	0 %	106,906	534.530,55	0,06
XS1333139746	1,1250 % Svenska Handels- banken AB MTN 15/22		EUR	1.900.000	0	0 %	101,941	1.936.886,41	0,20
XS1756296965	1,4470 % Telefonica Emisiones S.A.U. MTN 18/27		EUR	900.000	0	0 %	106,478	958.304,52	0,10
XS0746010908	3,6250 % Telia Company AB MTN 12/24		EUR	2.000.000	2.000.000	0 %	109,282	2.185.640,40	0,23
XS0826189028	3,0000 % Telia Company AB MTN 12/27		EUR	700.000	700.000	0 %	117,484	822.386,67	0,09
XS1861206636	2,0000 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN 18/28		EUR	1.900.000	0	0 %	110,356	2.096.760,96	0,22
XS1314318301	1,1250 % The Procter & Gam- ble Co. Bonds 15/23		EUR	1.900.000	0	0 %	103,266	1.962.057,80	0,20
XS1109744778	1,8750 % Transurban Finance Co. Pty Ltd MTN 14/24		EUR	300.000	0	0 %	105,346	316.038,51	0,03
XS1401196958	1,1250 % Unibail-Rodamco- Westfield SE MTN 16/27		EUR	900.000	0	0 %	105,434	948.902,04	0,10
IT0005090813	0,7500 % UniCredit S.p.A. Mortg.Cov. MTN 15/25		EUR	500.000	0	0 %	103,466	517.332,20	0,05
XS1241577490	1,0000 % Unilever Fin. Nether- lands B.V. MTN 15/23		EUR	900.000	0	0 %	102,357	921.215,70	0,10
FR0013128584	0,6250 % Union Natle Interp. Em.Com.Ind. MTN 16/26		EUR	2.600.000	0	0 %	104,191	2.708.963,92	0,28
XS1323463726	1,6250 % United Parcel Service Inc. Notes 15/25		EUR	400.000	0	0 %	106,858	427.430,00	0,04
FR0013220399	1,1250 % Vivendi SE Bonds 16/23		EUR	2.000.000	2.000.000	0 %	102,679	2.053.575,00	0,21
XS1652855815	1,5000 % Vodafone Group PLC MTN 17/27		EUR	700.000	700.000	0 %	107,544	752.809,19	0,08
XS1893631330	1,3750 % VOLKSW. FINANCIAL SERVICES AG MTN 18/23		EUR	900.000	0	0 %	103,039	927.351,45	0,10
DE000A182VT2	1,5000 % Vonovia Finance B.V. MTN 16/26		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	106,495	1.064.953,30	0,11
DE000A2RWZZ6	1,8000 % Vonovia Finance B.V. MTN 19/25		EUR	1.000.000	1.000.000	0 %	106,396	1.063.955,70	0,11
XS1615085781	0,5000 % Westpac Banking Corp. Mortg. Cov. MTN 17/24		EUR	1.800.000	0	0 %	102,258	1.840.641,30	0,19
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								5.961.545,71	0,61
Verzinsliche Wertpapiere								5.961.545,71	0,61
EUR-Anleihen								5.961.545,71	0,61
XS1288342659	1,3750 % American Honda Fi- nance Corp. MTN S.A 15/22		EUR	500.000	0	0 %	101,995	509.976,25	0,05
XS1197775692	1,5000 % Aptiv PLC Notes 15/25		EUR	500.000	0	0 %	104,579	522.895,85	0,05
XS1226748439	1,0000 % Bristol-Myers Squibb Co. Notes 15/25		EUR	800.000	0	0 %	104,200	833.599,84	0,09
XS1223830677	1,0000 % General Mills Inc. Notes 15/23		EUR	800.000	0	0 %	101,761	814.090,64	0,08
XS0951216166	3,1250 % Oracle Corp. Notes 13/25		EUR	400.000	0	0 %	112,098	448.390,88	0,05
XS1141969912	1,8750 % Sky PLC MTN 14/23		EUR	1.500.000	1.500.000	0 %	104,656	1.569.839,25	0,16
XS2160857798	1,0000 % Telstra Corp. Ltd. MTN 20/30		EUR	800.000	0	0 %	104,368	834.942,80	0,09
XS0995643003	3,0000 % WPP Finance 2013 MTN 13/23		EUR	400.000	0	0 %	106,953	427.810,20	0,04
Nichtnotierte Wertpapiere								7.288,42	0,00
Aktien								0,00	0,00
Irland								0,00	0,00
IE00B06H8J93	Irish Bank Resolution i.L. Reg.Shares		STK	503.363	0	0 EUR	0,000	0,00	0,00
Andere Wertpapiere								7.288,42	0,00
Frankreich								7.288,42	0,00
FR0014005GA0	Veolia Environnement S.A. Anrechte		STK	10.151	10.151	0 EUR	0,718	7.288,42	0,00
Wertpapier-Investmentanteile								19.064.395,55	1,99
Gruppeneigene Wertpapier-Investmentanteile								19.064.395,55	1,99
Luxemburg								19.064.395,55	1,99
LU1958620871	AGIF-Allianz Emer.Mkts Sov. Bd Act. N. WT H2 Acc.		ANT	0,004	0	6.626,08 EUR	1.039,600	4,16	0,00
LU0988443767	AGIF-Allianz EO Infl-Linked Bd Inhaber Anteile WT		ANT	15.247	0	0 EUR	1.250,370	19.064.391,39	1,99
Summe Wertpapiervermögen ³⁾							EUR	941.112.329,44	97,53
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/ Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte								362.371,26	0,05
DJ Euro Stoxx 50 Future (STXE) Dez. 21	XEUR	EUR Anzahl	-70					49.087,50	0,01
E-Mini S&P 500 Index Fu- ture (ES) Dez. 21	XCME	USD Anzahl	-80					341.734,52	0,04
FTSE 100 Index Future (FFI) Dez. 21	IFEU	GBP Anzahl	-17					-15.602,02	0,00
SPI 200 Index Future (YAP) Dez. 21	XSFE	AUD Anzahl	-13					20.390,10	0,00

Die Fußnotenerklärungen befinden sich am Ende der Tabelle.

Vermögensaufstellung zum 30.09.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Bestand 30.09.2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
	Topix-Tokyo Stock Price Index Future (JTI) Dez. 21	XOSE	JPY Anzahl	-13				-33.238,84	0,00
Summe Aktienindex-Derivate							EUR	362.371,26	0,05
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte									
	Forderungen/ Verbindlichkeiten							-268.975,00	-0,02
	EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 21	XEUR	EUR	14.800.000				-120.650,00	-0,01
	EURO Schatz Future (FGBS) Dez. 21	XEUR	EUR	10.500.000				-7.875,00	0,00
	EURO-BTP Future (FBTP) Dez. 21	XEUR	EUR	1.800.000				-31.550,00	0,00
	Long Term EURO OAT Future (FOAT) Dez.21	XEUR	EUR	4.100.000				-103.730,00	-0,01
	SHORT EURO-BTP Future (FBTS) Dez. 21	XEUR	EUR	4.700.000				-5.170,00	0,00
Summe Zins-Derivate							EUR	-268.975,00	-0,02
Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds									
Bankguthaben									
EUR-Guthaben bei der Verwahrstelle									
	State Street Bank International GmbH		EUR	6.161.978,89		%	100,000	6.161.978,89	0,64
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	State Street Bank International GmbH		DKK	99.624,39		%	100,000	13.397,22	0,00
	State Street Bank International GmbH		NOK	2.306.266,02		%	100,000	226.060,19	0,02
	State Street Bank International GmbH		PLN	890,67		%	100,000	192,43	0,00
	State Street Bank International GmbH		SEK	2.664.001,26		%	100,000	261.183,00	0,03
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	State Street Bank International GmbH		AUD	1.099.783,21		%	100,000	683.158,81	0,07
	State Street Bank International GmbH		CAD	1.304.885,44		%	100,000	884.248,45	0,09
	State Street Bank International GmbH		CHF	659.174,00		%	100,000	608.430,87	0,06
	State Street Bank International GmbH		GBP	513.172,96		%	100,000	594.397,36	0,06
	State Street Bank International GmbH		HKD	2.813.884,46		%	100,000	311.335,84	0,03
	State Street Bank International GmbH		JPY	185.449.713,00		%	100,000	1.428.205,06	0,15
	State Street Bank International GmbH		SGD	179.340,48		%	100,000	113.538,97	0,01
	State Street Bank International GmbH		USD	11.050.131,06		%	100,000	9.521.460,57	0,99
Summe Bankguthaben							EUR	20.807.587,66	2,15
Summe der Bankguthaben, Geldmarktpapiere, Geldmarkt- und geldmarktnahe Fonds ³⁰⁾							EUR	20.807.587,66	2,15
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Zinsansprüche		EUR	2.720.803,75				2.720.803,75	0,28
	Dividendenansprüche		EUR	841.141,11				841.141,11	0,09
	Forderungen aus Anteilschneingeschäften		EUR	27.082,36				27.082,36	0,00
	Forderungen aus Quellensteuerrückstellungen		EUR	431.126,12				431.126,12	0,04
Summe Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	4.020.153,34	0,41
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften		EUR	-40.476,97				-40.476,97	0,00
	Kostenabgrenzung		EUR	-1.128.537,93				-1.128.537,93	-0,12
Summe Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-1.169.014,90	-0,12
Fondsvermögen							EUR	964.864.451,80	100,00
Summe der umlaufenden Anteile aller Anteilklassen							STK	9.630.846	

³⁾ Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

³⁰⁾ Im Bankguthaben können Cash Initial Margin enthalten sein.

Gattungsbezeichnung	gesamt
Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Dritten als Marginsicherheiten für Termingeschäfte dienen:	EUR 22.471.061,76

Allianz Strategiefonds Balance A (EUR)

ISIN	DE0009797258
Fondsvermögen	924.322.891,98
Umlaufende Anteile	9.586.588,183
Anteilwert	96,42

Allianz Strategiefonds Balance IT2 (EUR)

ISIN	DE000A14N9Y9
Fondsvermögen	6.117.353,84
Umlaufende Anteile	4.598,847
Anteilwert	1.330,19

Allianz Strategiefonds Balance PT2 (EUR)

ISIN	DE0009797571
Fondsvermögen	32.039.293,48
Umlaufende Anteile	19.496,581
Anteilwert	1.643,33

Allianz Strategiefonds Balance R (EUR)

ISIN	DE000A2DU1H7
Fondsvermögen	2.384.912,50
Umlaufende Anteile	20.162,125
Anteilwert	118,29

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Aktien Nord- und Südamerika und Internationale Obligationen: Kurse per 29.09.2021 oder letztbekannte

Alle anderen Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.09.2021 oder letztbekannte

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.09.2021

Großbritannien, Pfund	(GBP)	1 Euro = GBP	0,86335
Dänemark, Kronen	(DKK)	1 Euro = DKK	7,43620
Norwegen, Kronen	(NOK)	1 Euro = NOK	10,20200
Schweden, Kronen	(SEK)	1 Euro = SEK	10,19975
Schweiz, Franken	(CHF)	1 Euro = CHF	1,08340
Polen, Zloty	(PLN)	1 Euro = PLN	4,62855
USA, Dollar	(USD)	1 Euro = USD	1,16055
Kanada, Dollar	(CAD)	1 Euro = CAD	1,47570
Singapur, Dollar	(SGD)	1 Euro = SGD	1,57955
Japan, Yen	(JPY)	1 Euro = JPY	129,84810
Hongkong, Dollar	(HKD)	1 Euro = HKD	9,03810
Australien, Dollar	(AUD)	1 Euro = AUD	1,60985

Marktschlüssel**Terminbörsen**

IFEU	=	London - ICE Futures Europe
XCME	=	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
XEUR	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
XOSE	=	Osaka - Osaka Exchange - Futures and Options
XSFE	=	Sydney - Sydney/N.S.W. - ASX Trade24

Kapitalmaßnahmen

Alle Umsätze, die aus Kapitalmaßnahmen hervorgehen (technische Umsätze), werden als Zu- oder Abgang ausgewiesen.

Stimmrechtsausübung

Stimmrechte aus den im Fonds enthaltenen Aktien haben wir, soweit es im Interesse unserer Anleger geboten erschien, entweder selbst wahrgenommen oder durch Beauftragte nach unseren Weisungen ausüben lassen.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzueinordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Australien				
AU000000ASX7	ASX Ltd. Reg.Shares	STK	0	16.309
AU000000AZJ1	Aurizon Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	369.898
AU000000AST5	AusNet Services Ltd. Reg.Shares	STK	190.534	190.534
AU000000FMG4	Fortescue Metals Group Ltd. Reg.Shares	STK	33.747	190.323
AU000000GMG2	Goodman Group Reg.Stapled Secs	STK	0	139.493
AU000000IEL5	IDP Education Ltd. Reg.Shares	STK	0	58.221
AU000000MQG1	Macquarie Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	11.643
AU000000NCM7	Newcrest Mining Ltd. Reg.Shares	STK	69.073	107.245
AU000000STO6	Santos Ltd. Reg.Shares	STK	103.698	103.698
AU000000SDF8	Steadfast Group Ltd Reg.Shares	STK	0	81.781
AU000000WES1	Wesfarmers Ltd. Reg.Shares	STK	44.514	44.514
AU000000WPL2	Woodside Petroleum Ltd. Reg.Shares	STK	56.920	56.920
AU000000WOW2	Woolworths Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	18.676
Belgien				
BE0974264930	AGEAS SA/NV Actions Nominatives	STK	0	32.046
BE0003810273	Proximus S.A. Actions au Porteur	STK	13.211	13.211
BE0003739530	UCB S.A. Actions Nom.	STK	0	11.509
Bermuda				
BMG169621056	Bunge Ltd. Reg.Shares	STK	0	28.354
BMG3198U1027	Essent Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	23.799
BMG524401079	Kerry Properties Ltd. Reg.Shares	STK	0	50.500
BMG7496G1033	RenaissanceRe Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.264
Deutschland				
DE0006766504	Aurubis AG Inhaber-Aktien	STK	6.648	6.648
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE Inhaber-Aktien	STK	7.779	7.779
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG Inhaber-Aktien	STK	0	5.431
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien	STK	1.500	19.244
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Stammaktien	STK	53.497	53.497
DE0008402215	Hannover Rück SE Namens-Aktien	STK	0	7.699
DE0006047004	HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien	STK	20.130	20.130
DE000A161408	HelloFresh SE Inhaber-Aktien	STK	0	28.262
DE0006070006	HOCHTIEF AG Inhaber-Aktien	STK	0	3.053
DE0006969603	PUMA SE Inhaber-Aktien	STK	0	13.764
DE0007165631	Sartorius AG Vorzugsaktien	STK	2.289	2.289
DE0007236101	Siemens AG Namens-Aktien	STK	8.163	8.163
DE000A2YN900	TeamViewer AG Inhaber-Aktien	STK	5.150	5.150
Finnland				
FI0009007884	Elisa Oyj Reg.Shares Cl.A	STK	0	19.367
FI0009000665	Metsä Board Oyj Reg.Shares Cl.B	STK	51.437	51.437
FI0009013296	Neste Oyj Reg.Shs	STK	36.728	36.728
Frankreich				
FR0004125920	Amundi S.A. Actions au Porteur	STK	0	9.274
FR0000051732	Atos SE Actions au Porteur	STK	0	9.456
FR0000120503	Bouygues S.A. Actions Port.	STK	0	34.496
FR0000045072	Crédit Agricole S.A. Actions Port.	STK	0	63.783
FR0000130452	Eiffage S.A. Actions Port.	STK	0	7.566
FR0010208488	Engie S.A. Actions Port.	STK	78.381	78.381
FR0010221234	Eutelsat Communications Actions Port.	STK	22.775	22.775
FR0000121964	Klépierre S.A. Actions Port.	STK	0	26.965
FR0000133308	Orange S.A. Actions Port.	STK	10.103	144.358
FR0000131906	Renault S.A. Actions Port.	STK	6.252	6.252
FR0000120578	Sanofi S.A. Actions Port.	STK	2.001	17.968
FR0000051807	Téléperformance SE Actions Port.	STK	2.671	5.454
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares	STK	19.284	19.284
FR0000125486	VINCI S.A. Actions Port.	STK	0	25.802
Großbritannien				
GB00B02J6398	Admiral Group PLC Reg.Shares	STK	9.128	9.128
GB0022569080	Amdocs Ltd. Reg.Shares	STK	0	20.653

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
GB0002634946	BAE Systems PLC Reg.Shares	STK	0	139.883
GB0002875804	British American Tobacco PLC Reg.Shares	STK	0	68.509
JE00B5TT1872	Centamin PLC Reg.Shares	STK	0	118.817
GB00B15FWH70	Cineworld Group PLC Reg.Shares	STK	0	796.544
GB0001826634	Diploma PLC Reg.Shares	STK	0	12.478
GB00B1CKQ739	Dunelm Group PLC Reg.Shares	STK	0	25.456
GB00B19N1V48	Experian PLC Reg.Shares	STK	1.692	48.894
JE00BJVNS543	Ferguson PLC Reg.Shares	STK	0	20.734
GB00B1XH2C03	Ferrexpo PLC Reg.Shares	STK	0	128.516
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC Reg.Shares	STK	42.700	42.700
JE00BYPZJM29	Janus Henderson Group PLC Reg.Shares	STK	45.426	45.426
GB00BYX91H57	JD Sports Fashion PLC Reg.Shares	STK	0	147.180
GB0005603997	Legal & General Group PLC Reg.Shares	STK	123.986	123.986
GB00BKFB1C65	M&G PLC Reg.Shares	STK	0	369.852
GB0006825383	Persimmon PLC Reg.Shares	STK	7.348	7.348
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC Reg.Shares	STK	42.054	42.054
GB0007188757	Rio Tinto PLC Reg.Shares	STK	0	13.925
GB0004082847	Standard Chartered PLC Reg.Shares	STK	0	68.631
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC Reg.Shares	STK	459.680	598.806
GB0006043169	Wm. Morrison Supermarkets PLC Reg.Shares	STK	0	399.130
Hongkong				
HK0267001375	CITIC Ltd. Reg.Shares	STK	0	307.000
HK0014000126	Hysan Development Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	93.000
HK0019000162	Swire Pacific Ltd. Reg.Shares Cl.A	STK	0	57.500
HK0004000045	The Wharf (Holdings) Ltd. Reg.Shares	STK	0	47.000
Irland				
IE00B8KQN827	Eaton Corporation PLC Reg.Shares	STK	0	17.482
IE00BY7QL619	Johnson Controls Internat. PLC Reg.Shares	STK	0	40.071
IE00BFY8C754	Steris PLC Reg.Shares	STK	0	11.511
Israel				
IL0011691438	Cognyte Software Ltd. Reg.Shares	STK	11.828	11.828
IL0010841281	Delek Group Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.977
IL0011233553	Energix-Renewable Energies Ltd Reg.Shares	STK	0	59.873
IL0005930388	First Internat.Bank of Israel Reg.Shares	STK	0	8.831
IL0006954379	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. Reg.Shares	STK	0	27.550
IL0011284465	Plus500 Ltd. Reg.Shares	STK	0	29.280
Italien				
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom.	STK	0	63.887
IT0003492391	Diasorin S.p.A. Azioni nom.	STK	3.566	3.566
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom.	STK	245.429	245.429
IT0003153415	Snam S.p.A. Azioni nom.	STK	61.443	61.443
IT0004810054	Unipol Gruppo S.p.A. Azioni nom.	STK	0	66.378
Japan				
JP3942400007	Astellas Pharma Inc. Reg.Shares	STK	25.600	25.600
JP3835250006	BayCurrent Consulting Inc. Reg.Shares	STK	0	5.900
JP3830000000	Brother Industries Ltd. Reg.Shares	STK	48.800	48.800
JP3218900003	Capcom Co. Ltd. Reg.Shares	STK	64.400	64.400
JP3475200006	Daiichikosho Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	10.400
JP3481800005	Daikin Industries Ltd. Reg.Shares	STK	10.700	10.700
JP3551200003	Electric Power Dev. Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.200
JP3805010000	Fukuoka Financial Group Reg.Shares	STK	0	28.500
JP3827200001	Furukawa Electric Co. Ltd. Reg.Shares	STK	23.700	23.700
JP3183200009	Japan Exchange Group Inc. Reg.Shares	STK	57.600	57.600
JP3389470000	Japan Investm.Adviser Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	33.900
JP3040890000	Japan Prime Realty Inv. Corp. Reg.Shares	STK	163	163
JP3210200006	Kajima Corp. Reg.Shares	STK	153.300	153.300
JP3263000006	Kinden Corp. Reg.Shares	STK	0	27.100
JP3300600008	Konica Minolta Inc. Reg.Shares	STK	114.700	114.700
JP3271600003	Kureha Corp. Reg.Shares	STK	0	5.200
JP3117700009	Mebuki Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	220.500	220.500
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp Reg.Shares	STK	0	203.600
JP3914400001	Murata Manufacturing Co. Ltd. Reg.Shares	STK	6.000	6.000
JP3754200008	Nihon Unisys Ltd. Reg.Shares	STK	0	16.800
JP3700200003	Nippon Light Metal Holdings Co Reg.Shares	STK	0	11.500
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc. Reg.Shares	STK	0	44.100

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
JP3678000005	Nisshinbo Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	29.400
JP3675600005	Nissin Foods Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	12.700
JP3190000004	Obayashi Corp. Reg.Shares	STK	0	122.200
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	36.900	36.900
JP3188200004	Otsuka Corp. Reg.Shares	STK	0	9.600
JP3981400009	Rengo Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	41.500
JP3500610005	Resona Holdings Inc. Reg.Shares	STK	51.100	208.500
JP3977400005	Rinnai Corp. Reg.Shares	STK	7.200	7.200
JP3344400001	Sanwa Holdings Corp. Reg.Shares	STK	0	53.000
JP3162770006	SG Holdings Co. Ltd. Reg.Shares	STK	33.800	33.800
JP3663900003	Sojitz Corp. Reg.Shares	STK	0	210.800
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	277.800
JP3404600003	Sumitomo Corp. Reg.Shares	STK	0	139.000
JP3407400005	Sumitomo Electric Ind. Ltd. Reg.Shares	STK	62.800	62.800
JP3409800004	Sumitomo Forestry Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	35.000
JP3449020001	Taiheiyō Cement Corp. Reg.Shares	STK	32.300	32.300
JP3443600006	Taisei Corp. Reg.Shares	STK	30.800	30.800
JP3544000007	Teijin Ltd. Reg.Shares	STK	43.700	43.700
JP3569200003	Tokyu Fudosan Holdings Corp. Reg.Shares	STK	57.800	109.200
JP3635000007	Toyota Tsusho Corp. Reg.Shares	STK	0	45.100
JP3158800007	Ube Industries Ltd. Reg.Shares	STK	14.100	14.100
JP3157200001	Uchida Yoko Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	4.200
JP3659000008	West Japan Railway Co. Reg.Shares	STK	0	8.200
JP3505970008	W-SCOPE Corp. Reg.Shares	STK	0	67.500
JP3939000000	Yamada Holdings Co. Ltd. Ltd. Reg.Shares	STK	0	101.300
Kaiman-Inseln				
KYG011251066	Afya Ltd. Reg.Shs CLA	STK	0	12.339
KYG217651051	CK Hutchison Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	93.000
KYG810431042	Shimao Group Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	145.000
KYG9593A1040	Wharf Real Estate Inv. Co. Ltd Reg.Shares	STK	0	47.000
Kanada				
CA0115321089	Alamos Gold Inc. (new) Reg.Shares	STK	0	22.474
CA0213611001	AltaGas Ltd. Reg.Shares	STK	23.627	23.627
CA0585861085	Ballard Power Systems Inc. Reg.Shares	STK	0	44.697
CA0717341071	Bausch Health Companies Inc. Reg.Shares	STK	0	23.849
CA05534B7604	BCE Inc. Reg.Shares new	STK	0	24.217
CA09950M3003	Boralex Inc. Reg.Shares CL.A	STK	7.743	14.189
CA1366812024	Canadian Tire Corp. Ltd. Reg.Shares CL.A	STK	0	8.715
CA12532H1047	CGI Inc. Reg.Shs CL.A (Sub.Vtg)	STK	0	15.948
CA1254911003	CI Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	47.029
CA19239C1068	Cogeco Communications Inc. Reg.Shares (Sub. Vtg.)	STK	0	6.052
CA2849025093	Eldorado Gold Corp. Ltd. Reg.Shares	STK	0	31.126
CA29250N1050	Enbridge Inc. Reg.Shares	STK	0	41.641
CA3518581051	Franco-Nevada Corp. Reg.Shares	STK	1.315	6.832
CA37252B1022	Genworth MI Canada Inc. Reg.Shares	STK	0	5.832
CA9611485090	George Weston Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.783
CA45075E1043	IA Financial Corporation Inc. Reg.Shares	STK	25.609	25.609
CA45823T1066	Intact Financial Corp. Reg.Shares	STK	11.264	11.264
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd. Reg.Shares	STK	0	7.202
CA5394811015	Loblaws Companies Ltd. Reg.Shares	STK	0	22.293
CA5592224011	Magna International Inc. Reg.Shares	STK	889	27.728
CA6837151068	Open Text Corp. Reg.Shares	STK	0	9.185
CA7392391016	Power Corporation of Canada Reg.Shares(Sub.Vtg)	STK	0	24.544
CA7481932084	Quebecor Inc. Reg.Shares CL.B (Sub.Vtg)	STK	0	15.198
CA75601Y1007	Real Matters Inc. Reg.Shares	STK	13.030	13.030
CA7677441056	Ritchie Brothers Auction. Inc. Reg.Shares	STK	0	7.772
CA82509L1076	Shopify Inc. Reg.Shares A (Sub Voting) (CAD)	STK	1.965	1.965
CA82509L1076	Shopify Inc. Reg.Shares A (Sub Voting) (USD)	STK	717	717
CA8667961053	Sun Life Financial Inc. Reg.Shares	STK	36.652	36.652
CA87807B1076	TC Energy Corp. Reg.Shares	STK	0	22.406
CA87241L1094	TFI International Inc. Reg.Shares	STK	0	9.645
Marshall-Inseln				
MHY2106R1100	Dorian LPG Ltd. Reg.Shares	STK	0	23.852
Niederlande				
NL0000687663	AerCap Holdings N.V. Aandelen op naam	STK	0	25.512

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
NL0012817175	Alfen N.V. Reg.Shares	STK	4.177	4.177
NL0011872643	ASR Nederland N.V. Aandelen op naam	STK	0	15.808
NL0000009082	Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder	STK	85.241	85.241
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V. Aandelen aan toonder	STK	9.628	9.628
NL00150001Q9	Stellantis N.V Aandelen op naam	STK	92.864,82	92.864,82
Norwegen				
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer	STK	0	32.199
Österreich				
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG Inhaber-Aktien	STK	7.330	16.601
Portugal				
PTBCP0AM0015	Banco Com. Português SA (BCP) Acç.Nom. + Port.Reg.	STK	0	2.475.521
PTEDP0AM0009	EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom.	STK	102.340	102.340
Puerto Rico				
PR7331747001	Popular Inc. Reg.Shares New	STK	0	22.636
Schweden				
SE0000379190	Castellum AB Namn-Aktier	STK	0	22.768
SE0009922164	Essity AB Namn-Aktier B	STK	0	24.480
SE0000455057	Fastighets AB Balder Namn-Aktier B	STK	0	14.384
SE0015811963	Investor AB Namn-Aktier B (fria)	STK	150.112	150.112
SE0000108847	L E Lundbergföretagen AB Namn-Aktier B (fria)	STK	0	14.203
SE0010100958	Latour Investment AB Namn-Aktier B	STK	0	24.875
SE0000113250	Skanska AB Namn-Aktier B (fria)	STK	0	34.565
SE0014960373	Sweco AB Namn-Aktier B	STK	16.539	16.539
Schweiz				
CH0012214059	Holcim Ltd. Namens-Aktien	STK	5.978	5.978
CH0371153492	Landis+Gyr Group AG Namens-Aktien	STK	0	5.189
CH0018294154	PSP Swiss Property AG Namens-Aktien	STK	0	9.111
CH0435377954	SIG Combibloc Group AG Namens-Aktien	STK	0	62.440
CH0014852781	Swiss Life Holding AG Namens-Aktien	STK	0	3.487
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien	STK	0	5.637
Singapur				
SG1BA1000003	AEM Holdings Ltd. Reg.Shares	STK	0	138.900
SG1AF6000009	Keppel DC REIT Reg.Units	STK	317.200	317.200
SG2D54973185	Sheng Siong Group Ltd Reg.Shares	STK	163.300	163.300
SG1J26887955	Singapore Exchange Ltd. Reg.Shares	STK	0	78.800
SG1U76934819	Yangzijiang Shipbuilding Hldgs Reg.Shares	STK	0	512.200
Spanien				
ES0167050915	ACS, Act.de Constry Serv. SA Acciones Port.	STK	39.138	75.253
ES0124244E34	Mapfre S.A. Acciones Nom.	STK	193.491	193.491
ES0173516115	Repsol S.A. Acciones Port.	STK	2.565	76.962
USA				
US00912X3026	Air Lease Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	20.037
US02079K3059	Alphabet Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	278	3.273
US0255371017	American Electric Power Co.Inc Reg.Shares	STK	0	17.871
US0259321042	American Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	0	13.810
US03073E1055	AmerisourceBergen Corp. Reg.Shares	STK	0	7.528
US0311001004	AMETEK Inc. Reg.Shares	STK	12.170	21.175
US0316521006	Amkor Technology Inc. Reg.Shares	STK	48.403	48.403
US0394831020	Archer Daniels Midland Co. Reg.Shares	STK	0	13.149
US0427351004	Arrow Electronics Inc. Reg.Shares	STK	0	12.736
US3635761097	Arthur J. Gallagher & Co. Reg.Shares	STK	13.140	13.140
US04316A1088	Artisan Partners Ass.Manag.Inc Reg.Shares A	STK	0	22.512
US05351X1019	Avaya Holdings Corp. Reg.Shares	STK	0	38.260
US0605051046	Bank of America Corp. Reg.Shares	STK	0	126.642
US0718131099	Baxter International Inc. Reg.Shares	STK	0	17.396
US0758871091	Becton, Dickinson & Co. Reg.Shares	STK	0	7.186
US0846707026	Berkshire Hathaway Inc. Reg.Shares B New	STK	0	3.893
US0865161014	Best Buy Co. Inc. Reg.Shares	STK	0	22.256
US0893021032	Big Lots Inc. Reg.Shares	STK	18.494	18.494
US0995021062	Booz Allen Hamilton Hldg Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	11.394
US1011371077	Boston Scientific Corp. Reg.Shares	STK	0	18.571
US12008R1077	Builders Firstsource Inc. Reg.Shares	STK	0	36.882
US05605H1005	BWX Technologies Inc. Reg.Shares	STK	0	2.430
US1273871087	Cadence Design Systems Inc. Reg.Shares	STK	7.589	19.567
US14040H1059	Capital One Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	13.530

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US14149Y1082	Cardinal Health Inc. Reg.Shares	STK	0	18.475
US1248051021	CBIZ Inc. Reg.Shares	STK	0	5.643
US16411R2085	Cheniere Energy Inc. Reg.Shares	STK	16.470	16.470
US1667641005	Chevron Corp. Reg.Shares	STK	2.032	11.450
US1727551004	Cirrus Logic Inc. Reg.Shares	STK	0	14.745
US1729674242	Citigroup Inc. Reg.Shares	STK	40.823	54.591
US18539C1053	Clearway Energy Inc. Reg.Shares A	STK	20.002	20.002
US1261171003	CNA Financial Corp. Reg.Shares	STK	0	8.164
US12621E1038	CNO Financial Group Inc. Reg.Shares	STK	32.372	32.372
US19247A1007	Cohen & Steers Inc. Reg.Shares	STK	0	8.411
US2058871029	ConAgra Brands Inc. Reg.Shares	STK	0	16.752
US2091151041	Consolidated Edison Inc. Reg.Shares	STK	0	8.824
US2172041061	Copart Inc. Reg.Shares	STK	0	5.929
US2358252052	Dana Inc. Reg.Shares	STK	26.114	26.114
US2435371073	Deckers Outdoor Corp. Reg.Shares	STK	858	858
US2561631068	DocuSign Inc. Reg.Shares	STK	0	12.004
US2566771059	Dollar General Corp. (New) Reg.Shares	STK	0	8.729
US2575592033	Domtar Corp. Reg.Shares New	STK	15.816	29.926
US2333311072	DTE Energy Co. Reg.Shares	STK	0	11.882
US26441C2044	Duke Energy Corp. Reg.Shares New	STK	0	18.782
US23355L1061	DXC Technology Co. Reg.Shares	STK	15.651	15.651
US2681501092	Dynatrace Inc. Reg.Shares	STK	0	14.363
US2910111044	Emerson Electric Co. Reg.Shares	STK	9.579	9.579
US29358P1012	Ensign Group Inc. Reg.Shares	STK	10.050	10.050
US29364G1031	Entergy Corp. Reg.Shares	STK	0	17.636
US29786A1060	Etsy Inc. Reg.Shares	STK	8.969	8.969
US2987361092	Euronet Worldwide Inc. Reg.Shares	STK	0	7.101
US30041R1086	Everquote Inc. Reg.Shs Cl.A	STK	0	5.377
US30040W1080	Eversource Energy Reg.Shares	STK	17.213	17.213
US30161N1019	Exelon Corp. Reg.Shares	STK	5.308	56.199
US30231G1022	Exxon Mobil Corp. Reg.Shares	STK	0	25.756
US30303M1027	Facebook Inc. Reg.Shares Cl.A	STK	0	25.490
US31428X1063	Fedex Corp. Reg.Shares	STK	5.526	5.526
US31946M1036	First Citizens BancShares Inc. Reg.Shares Class A	STK	0	1.431
US3205171057	First Horizon Corp. Reg.Shares	STK	0	81.356
US33616C1009	First Rep.Bank San Fr.(New) Reg.Shares	STK	7.117	7.117
US3377381088	Fiserv Inc. Reg.Shares	STK	0	4.127
US34959E1091	Fortinet Inc. Reg.Shares	STK	1.653	1.653
US34964C1062	Fortune Brands Home & Sec.Inc. Reg.Shares	STK	18.545	18.545
US37940X1028	Global Payments Inc. Reg.Shares	STK	0	7.118
US3893751061	Gray Television Inc. Reg.Shares	STK	0	22.017
US4062161017	Halliburton Co. Reg.Shares	STK	43.448	43.448
US42824C1099	Hewlett Packard Enterprise Co. Reg.Shares	STK	0	136.500
US4385161066	Honeywell International Inc. Reg.Shares	STK	0	8.573
US44107P1049	Host Hotels & Resorts Inc. Reg.Shares	STK	0	28.109
US45866F1049	Intercontinental Exchange Inc. Reg.Shares	STK	0	11.816
US8326964058	J.M. Smucker Co. Reg.Shares	STK	0	5.809
US4663131039	Jabil Inc. Reg.Shares	STK	0	31.204
US5253271028	Leidos Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	8.519
US5303071071	Liberty Broadband Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	6.375
US5303073051	Liberty Broadband Corp. Reg.Shares Cl.C	STK	0	6.090
US56418H1005	ManpowerGroup Inc. Reg.Shares	STK	0	5.543
US5645631046	Mantech International Corp. Reg.Shares Cl.A	STK	0	9.462
US57060D1081	MarketAxess Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	2.847
US5779331041	Maximus Inc. Reg.Shares	STK	3.455	3.455
US5805891091	MC Grath Rent Corp. Reg.Shares	STK	0	4.442
US5801351017	McDonald's Corp. Reg.Shares	STK	0	2.998
US59001A1025	Meritage Homes Corp. Reg.Shares	STK	0	9.858
US5915202007	Methode Electronics Inc. Reg.Shares	STK	8.548	8.548
US5528481030	MGIC Investment Corp. Reg.Shares	STK	134.647	186.128
US61174X1090	Monster Beverage Corp. (NEW) Reg.Shares	STK	13.249	13.249
US6153691059	Moody's Corp. Reg.Shares	STK	13.226	13.226
US62944T1051	NVR Inc. Reg.Shares	STK	0	190
US6795801009	Old Dominion Freight Line Inc. Reg.Shares	STK	7.941	7.941
US68268W1036	OneMain Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	39.891
US68622V1061	Organon & Co. Reg.Shares	STK	7.171,6	7.171,6

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
US6882392011	Oshkosh Corp. Reg.Shares	STK	0	14.786
US69047Q1022	Ovintiv Inc Reg.Shares	STK	0	77.544
US7005171050	Park Hotels & Resorts Inc. Reg.Shares	STK	0	28.786
US70202L1026	Parsons Corp. Reg.Shares	STK	0	12.065
US7134481081	PepsiCo Inc. Reg.Shares	STK	0	18.147
US6934751057	PNC Financial Services Group Reg.Shares	STK	0	10.251
US69351T1060	PPL Corp. Reg.Shares	STK	0	16.645
US7443201022	Prudential Financial Inc. Reg.Shares	STK	5.368	21.093
US74762E1029	Quanta Services Inc. Reg.Shares	STK	7.229	7.229
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc. Reg.Shares	STK	1.521	16.197
US7595091023	Reliance Steel & Alumin. Co. Reg.Shares	STK	0	11.621
US7607591002	Republic Services Inc. Reg.Shares	STK	0	5.522
US7766961061	Roper Technologies Inc. Reg.Shares	STK	2.365	2.365
US78410G1040	SBA Communications Corp. Reg.Shares CLA	STK	5.248	5.248
US78463M1071	SPS Commerce Inc. Reg.Shares	STK	0	9.046
US78467J1007	SS&C Technologies Holdings Reg.Shares	STK	0	10.924
US87165B1035	Synchrony Financial Reg.Shares	STK	14.800	14.800
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc. Reg.Shares	STK	5.112	5.112
US8803451033	Tennant Co. Reg.Shares	STK	0	4.000
US00130H1059	The AES Corp. Reg.Shares	STK	0	50.395
US5010441013	The Kroger Co. Reg.Shares	STK	0	38.272
US8923561067	Tractor Supply Co. Reg.Shares	STK	8.412	8.412
US8926721064	Tradeweb Markets Inc. Reg.Shs CLA	STK	0	9.831
US89400J1079	TransUnion Reg.Shares	STK	16.019	16.019
US8962391004	Trimble Inc. Reg.Shares	STK	4.349	4.349
US90385V1070	Ultra Clean Holdings Inc. Reg.Shares	STK	0	13.181
US9047081040	UniFirst Corp. Reg.Shares	STK	0	3.843
US9224751084	Veeva System Inc. Reg.Shares A	STK	6.545	6.545
US92343X1000	Verint Systems Inc. Reg.Shares	STK	0	11.828
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	5.838	5.838
US92556V1061	Viatrix Inc. Reg.Shares	STK	9.637,836	9.637,836
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc. Reg.Shares	STK	4.013	23.212
US9311421039	Walmart Inc. Reg.Shares	STK	0	18.273
US9427491025	Watts Water Technologies Inc. Reg.Shares CLA	STK	0	5.252
US9553061055	West Pharmaceutic.Services Inc Reg.Shares	STK	3.897	3.897
US98421M1062	Xerox Holdings Corp. Reg.Shares	STK	29.404	29.404
US48123V1026	j2 Global Inc. Reg.Shares	STK	0	5.878
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR-Anleihen				
XS1050846507	2,3750 % Airbus Finance B.V. MTN 14/24	EUR	1.000.000	1.800.000
XS0809847667	2,6250 % Akzo Nobel N.V. MTN 12/22	EUR	0	500.000
XS1369278251	1,2500 % Amgen Inc. Notes 16/22	EUR	0	1.800.000
BE6285454482	1,5000 % Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. MTN 16/25	EUR	0	500.000
BE6265141083	1,9500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. MTN 14/21	EUR	0	1.400.000
BE6276039425	0,8000 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. MTN 15/23	EUR	0	1.100.000
XS1143486865	0,8750 % AstraZeneca PLC MTN 14/21	EUR	0	900.000
XS1144086110	1,4500 % AT & T Inc. Notes 14/22	EUR	0	1.300.000
XS0731129234	3,6250 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. MT Cov.Bds 12/22	EUR	0	2.200.000
XS1290850707	1,6250 % Bank of America Corp. MTN 15/22	EUR	0	2.000.000
XS1888229249	1,2500 % Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN Anl. 18/25	EUR	1.500.000	1.500.000
XS1527753187	0,5000 % BNP Paribas S.A. MTN 16/22	EUR	0	1.050.000
XS1851278777	1,5940 % BP Capital Markets PLC MTN 18/28	EUR	0	1.400.000
XS1548802914	0,3750 % Baque Fédérative du Cr. Mutuel MTN 17/22	EUR	0	1.000.000
FR0013088424	0,5000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. MT Obl.Fonc. 16/22	EUR	0	2.100.000
XS0502286908	4,8750 % CEZ AS MTN 10/25	EUR	0	400.000
DE000DL19TA6	1,5000 % Deutsche Bank AG MTN 17/22	EUR	0	2.000.000
DE000DL19UR8	1,8750 % Deutsche Bank AG MTN 19/22	EUR	0	700.000
XS0525787874	4,2500 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. MTN 10/22	EUR	0	1.000.000
XS1379591271	1,2500 % DVB Bank SE MTN IHS 16/21	EUR	0	900.000
XS2091216205	0,0000 % E.ON SE MTN 19/22	EUR	2.000.000	2.000.000
FR0012602753	0,5000 % Engie S.A. MTN 15/22	EUR	0	1.900.000
EU000A1G0AD0	3,5000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 11/22	EUR	0	200.000
XS0544644957	3,0000 % European Investment Bank MTN 10/22	EUR	0	1.000.000
XS0825855751	2,2500 % Fortum Oyj MTN 12/22	EUR	2.000.000	2.000.000
XS1169353254	0,8000 % GE Capital Europ.Fund.Unltd.Co MTN 15/22	EUR	0	1.300.000
XS1197351577	1,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. MTN 15/22	EUR	1.000.000	1.700.000

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
FR0012648244	0,8750 % Kering S.A. MTN 15/22	EUR	0	1.200.000
ES0000012801	0,4000 % Königreich Spanien Obligaciones 17/22	EUR	0	400.000
DE000A1K0UG6	2,5000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Anl. 12/22	EUR	0	200.000
XS1517181167	0,7500 % Lloyds Banking Group PLC MTN 16/21	EUR	0	904.000
XS1237271421	1,8750 % McDonald's Corp. MTN 15/27	EUR	0	1.900.000
XS1028941976	1,1250 % Merck & Co. Inc. Notes 14/21	EUR	0	1.400.000
XS1346872580	1,6250 % Mondelez International Inc. Notes 16/23	EUR	1.000.000	1.000.000
XS0813400305	2,7500 % National Australia Bank Ltd. MTN 12/22	EUR	0	2.100.000
XS1167352613	0,8750 % National Australia Bank Ltd. MTN 15/22	EUR	0	1.700.000
XS0826531120	1,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. MTN 12/22	EUR	0	400.000
XS1222431097	0,2500 % NIBC Bank N.V. Mortg. Cov. MTN 15/22	EUR	1.400.000	1.900.000
XS1138366445	1,0000 % ÖBB-Infrastruktur AG MTN 14/24	EUR	0	811.000
XS1716243719	0,6250 % Philip Morris Internat. Inc. Notes 17/24	EUR	800.000	2.600.000
FR0013329315	1,0000 % Renault S.A. MTN 18/24	EUR	0	1.900.000
FR0011196856	3,0000 % Rep. Frankreich OAT 12/22	EUR	1.200.000	1.600.000
FR0012993103	1,5000 % Rep. Frankreich OAT 15/31	EUR	1.500.000	1.500.000
FR0013219177	0,0000 % Rep. Frankreich OAT 16/22	EUR	0	1.400.000
IT0005135840	1,4500 % Republik Italien B.T.P. 15/22	EUR	0	1.000.000
IT0005366007	1,0000 % Republik Italien B.T.P. 19/22	EUR	0	800.000
FR0012969020	0,8750 % Sanofi S.A. MTN 15/21	EUR	0	900.000
XS1550951641	0,8750 % Santander Consumer Finance SA MTN 17/22	EUR	0	700.000
XS1109741246	1,5000 % Sky PLC MTN 14/21	EUR	0	1.400.000
XS1500337644	0,1250 % Société Générale S.A. MTN 16/21	EUR	0	900.000
XS0999667263	3,1250 % Telekom Finanzmanagement GmbH MTN 13/21	EUR	0	1.400.000
XS1197832915	0,7500 % The Coca-Cola Co. Notes 15/23	EUR	0	1.100.000
XS1032978345	2,5000 % The Goldman Sachs Group Inc. MTN S.F 14/21	EUR	0	300.000
XS1171489393	0,7500 % Toyota Motor Credit Corp. MTN 15/22	EUR	0	1.500.000
XS1178970106	0,5000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. MTN 15/22	EUR	0	850.000
XS1288903278	1,5000 % Wells Fargo & Co. MTN 15/22	EUR	0	1.300.000
XS1310934382	2,0000 % Wells Fargo & Co. MTN 15/26	EUR	0	1.000.000
XS1506396974	0,2500 % Westpac Banking Corp. MTN 16/22	EUR	0	900.000
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
Schweiz				
CH0012032048	Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine	STK	356	9.255
Andere Wertpapiere				
Spanien				
ES06445809L2	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	240.618	240.618
ES06445809M0	Iberdrola S.A. Anrechte	STK	295.358	295.358
ES06735169H8	Repsol S.A. Anrechte	STK	74.397	74.397
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
Großbritannien				
GB00B1722W11	Jet2 PLC Reg.Shares	STK	0	57.747
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR-Anleihen				
XS1405774990	0,6250 % ASML Holding N.V. Notes 16/22	EUR	0	700.000
XS1531060025	0,5000 % Knorr-Bremse AG MTN 16/21	EUR	0	550.000
XS1203856072	1,2500 % Yorkshire Building Society MTN 15/22	EUR	0	500.000
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
Dänemark				
DK0010268606	Vestas Wind Systems AS Navne-Aktier	STK	8.389	8.389
Frankreich				
FR0000121501	Peugeot S.A. Actions Port.(C.R.)	STK	0	40.710
Großbritannien				
GB00B43G0577	Harbour Energy PLC Reg.Shares	STK	0	663.818
Japan				
JP3323050009	Sawai Pharmaceutical Co. Ltd. Reg.Shares	STK	0	6.000
Kanada				
CA4480551031	Husky Energy Inc. Reg.Shares	STK	0	87.908
CA7866881013	Sagen MI Canada Inc. Reg.Shares	STK	5.832	5.832
Schweden				
SE0012455673	Boliden AB Namn-Aktier (Post Split)	STK	0	37.948
SE0011166933	Epiroc AB Namn-Aktier A	STK	12.847	12.847
SE0015658125	Epiroc AB Reg.Redemption Shares A	STK	12.847	12.847

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
SE0000107419	Investor AB Namn-Aktier B (fria)	STK	37.528	37.528
SE0014684528	Kinnevik AB Namn-Aktier B	STK	16.821	16.821
SE0008321293	NIBE Industrier AB Namn-Aktier B	STK	0	38.117
SE0000489098	Sweco AB Namn-Aktier B	STK	0	5.513
Schweiz				
CH0001503199	BELIMO Holding AG Namens-Aktien	STK	0	59
Spanien				
ES0144583236	Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.01/21	STK	3.437,4	3.437,4
ES0144583244	Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.07/21	STK	7.383	7.383
ES0173516198	Repsol S.A. Acciones Port. Em.12/20	STK	2.565	2.565
USA				
US0153511094	Alexion Pharmaceuticals Inc. Reg.Shares	STK	1.791	1.791
US40425J1016	HMS Holdings Corp. Reg.Shares	STK	21.429	21.429
US7153471005	Perspecta Inc. Reg.Shares	STK	0	28.288
US83088V1026	Slack Technologies Inc. Reg.Shs Cl.A	STK	36.141	36.141
Verzinsliche Wertpapiere				
EUR-Anleihen				
XS1250034276	2,1500 % Thermo Fisher Scientific Inc. Notes 15/22	EUR	0	500.000
Andere Wertpapiere				
Italien				
IT0005436909	Snam S.p.A. Anrechte	STK	61.241	61.241
Niederlande				
NL0015000A04	Euronext N.V. Anrechte	STK	6.084	6.084
<hr/>				
	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Währung		Volumen in 1.000
Derivate				
	(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)			
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
	Gekaufte Kontrakte:	EUR		135.974
	(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, TOPIX Index (Price) (JPY))			
	Verkaufte Kontrakte:	EUR		21.688
	(Basiswert(e): EURO STOXX 50 Index (Price) (EUR), FTSE 100 Index, S&P 500 Index, S&P/ASX 200 Index, TOPIX Index (Price) (JPY))			
Zinsterminkontrakte				
	Gekaufte Kontrakte:	EUR		63.154
	(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM) Juni 21, EURO Bobl Future (FGBM) Sep. 21, EURO Schatz Future (FGBS) Juni 21, EURO Schatz Future (FGBS) Sep. 21, EURO-BTP Future (FBTP) Juni 21, EURO-BTP Future (FBTP) Sep. 21, Long Term EURO OAT Future (FOAT) Juni 21, Long Term EURO OAT Future (FOAT) Sep.21, SHORT EURO-BTP Future (FBTS) Juni 21, SHORT EURO-BTP Future (FBTS) Sep. 21)			
	Verkaufte Kontrakte:	EUR		94.886
	(Basiswert(e): EURO Bobl Future (FGBM) Dez. 20, EURO Bobl Future (FGBM) Juni 21, EURO Bobl Future (FGBM) März 21, EURO Schatz Future (FGBS) Dez. 20, EURO Schatz Future (FGBS) Juni 21, EURO Schatz Future (FGBS) März 21, EURO-BTP Future (FBTP) Dez. 20, EURO-BTP Future (FBTP) Juni 21, EURO-BTP Future (FBTP) März 21, Long Term EURO OAT Future (FOAT) Dez. 20, Long Term EURO OAT Future (FOAT) Juni 21, Long Term EURO OAT Future (FOAT) März 21, SHORT EURO-BTP Future (FBTS) Dez. 20, SHORT EURO-BTP Future (FBTS) Juni 21, SHORT EURO-BTP Future (FBTS) März 21)			
Wertpapierdarlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):				
	(Basiswert(e): 0,4000 % Europ.Fin.Stab.Facility (EFSF) MTN 16/26, 1,9500 % Königreich Spanien Obligaciones 16/26)			
	unbefristet	EUR		10.516

Ertrags- und Aufwandsrechnung

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance A (EUR)

für den Zeitraum vom 01.10.2020 - 30.09.2021

(einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		197.336,05
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	9.971.032,39	
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	561.753,64	
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	5.159.149,07	
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-57.890,37	
a) Negative Einlagezinsen	-57.890,37	
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		0,00
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		8.984,42
a) Erträge aus Wertpapier-Darlehen	8.984,42	
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-29.600,28
a) inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-29.600,28	
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer		-1.667.404,42
a) aus Dividenden ausländischer Aussteller	-1.667.404,42	
10. Sonstige Erträge		470.262,70
Summe der Erträge	14.613.623,20	
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-106,78
2. Verwaltungsvergütung		-12.569.303,94
a) Pauschalvergütung ¹⁾	-12.569.303,94	
3. Verwahrstellenvergütung		0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		0,00
5. Sonstige Aufwendungen		-18.697,09
Summe der Aufwendungen	-12.588.107,81	
III. Ordentlicher Nettoertrag	2.025.515,39	
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	91.645.439,93	
2. Realisierte Verluste	-24.797.763,02	
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	66.847.676,91	
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	68.873.192,30	
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	38.880.756,75	
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	25.765.660,86	
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	64.646.417,61	
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	133.519.609,91	

¹⁾ Gemäß den Vertragsbedingungen ist für das Sondervermögen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Pauschalvergütung („All-In-Fee“) in der Höhe von 1,45 % p.a. (im Geschäftsjahr 1,45 % p.a.) vereinbart. Hieraus bestritt die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Kosten für das Portfoliomanagement sowie unter anderem die Aufwendungen für die Verwahrstelle (im Geschäftsjahr 0,008 % p.a.) und für Sonstige Dritte (z.B. Druck- und Veröffentlichungskosten, Abschlussprüfung, etc.).

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance IT2 (EUR)

für den Zeitraum vom 01.10.2020 - 30.09.2021

(einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.301,70
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		65.716,12
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		3.699,76
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		33.983,85
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-380,98
a) Negative Einlagezinsen		-380,98
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		0,00
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		58,85
a) Erträge aus Wertpapier-Darlehen	58,85	
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-195,21
a) inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge		-195,21
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer		-10.984,86
a) aus Dividenden ausländischer Aussteller	-10.984,86	
10. Sonstige Erträge		3.098,25
Summe der Erträge	96.297,48	
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-0,69
2. Verwaltungsvergütung		-33.477,35
a) Pauschalvergütung ¹⁾	-33.477,35	
3. Verwahrstellenvergütung		0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		0,00
5. Sonstige Aufwendungen		-123,17
Summe der Aufwendungen	-33.601,21	
III. Ordentlicher Nettoertrag	62.696,27	
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		603.701,16
2. Realisierte Verluste		-163.236,74
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	440.464,42	
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	503.160,69	
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		192.942,79
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		110.639,02
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	303.581,81	
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	806.742,50	

¹⁾ Gemäß den Vertragsbedingungen ist für das Sondervermögen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Pauschalvergütung („All-In-Fee“) in der Höhe von 0,69 % p.a. (im Geschäftsjahr 0,59 % p.a.) vereinbart. Hieraus bestritt die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Kosten für das Portfoliomanagement sowie unter anderem die Aufwendungen für die Verwahrstelle (im Geschäftsjahr 0,008 % p.a.) und für Sonstige Dritte (z.B. Druck- und Veröffentlichungskosten, Abschlussprüfung, etc.).

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance PT2 (EUR)

für den Zeitraum vom 01.10.2020 - 30.09.2021

(einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		6.815,17
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		344.030,48
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		19.367,70
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		177.899,01
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-1.993,91
a) Negative Einlagezinsen	-1.993,91	
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		0,00
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		307,89
a) Erträge aus Wertpapier-Darlehen	307,89	
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-1.022,24
a) inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge	-1.022,24	
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer		-57.502,42
a) aus Dividenden ausländischer Aussteller	-57.502,42	
10. Sonstige Erträge		16.220,17
Summe der Erträge		504.121,85
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-3,67
2. Verwaltungsvergütung		-145.459,06
a) Pauschalvergütung ¹⁾	-145.459,06	
3. Verwahrstellenvergütung		0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		0,00
5. Sonstige Aufwendungen		-644,54
Summe der Aufwendungen		-146.107,27
III. Ordentlicher Nettoertrag		358.014,58
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		3.160.157,15
2. Realisierte Verluste		-854.430,51
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		2.305.726,64
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.663.741,22
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		1.277.245,75
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		807.204,68
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.084.450,43
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.748.191,65

¹⁾ Gemäß den Vertragsbedingungen ist für das Sondervermögen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Pauschalvergütung („All-In-Fee“) in der Höhe von 0,69 % p.a. (im Geschäftsjahr 0,49 % p.a.) vereinbart. Hieraus bestritt die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Kosten für das Portfoliomanagement sowie unter anderem die Aufwendungen für die Verwahrstelle (im Geschäftsjahr 0,008 % p.a.) und für Sonstige Dritte (z.B. Druck- und Veröffentlichungskosten, Abschlussprüfung, etc.).

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance R (EUR)

für den Zeitraum vom 01.10.2020 - 30.09.2021

(einschließlich Ertragsausgleich)

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		508,17
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		25.679,62
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		1.447,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		13.285,98
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		-149,07
a) Negative Einlagezinsen		-149,07
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen		0,00
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften		23,18
a) Erträge aus Wertpapier-Darlehen	23,18	
9a. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-76,20
a) inländische Körperschaftsteuer auf inländische Dividendenerträge		-76,20
9b. Abzug ausländischer Quellensteuer		-4.293,78
a) aus Dividenden ausländischer Aussteller	-4.293,78	
10. Sonstige Erträge		1.212,26
Summe der Erträge		37.637,16
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-0,27
2. Verwaltungsvergütung		-21.263,59
a) Pauschalvergütung ¹⁾		-21.263,59
3. Verwahrstellenvergütung		0,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		0,00
5. Sonstige Aufwendungen		-48,07
Summe der Aufwendungen		-21.311,93
III. Ordentlicher Nettoertrag		16.325,23
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		235.827,53
2. Realisierte Verluste		-63.807,03
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		172.020,50
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		188.345,73
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		170.930,62
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		93.770,85
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		264.701,47
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		453.047,20

¹⁾ Gemäß den Vertragsbedingungen ist für das Sondervermögen eine an die Kapitalverwaltungsgesellschaft abzuführende Pauschalvergütung („All-In-Fee“) in der Höhe von 1,45 % p.a. (im Geschäftsjahr 0,95 % p.a.) vereinbart. Hieraus bestritt die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Kosten für das Portfoliomanagement sowie unter anderem die Aufwendungen für die Verwahrstelle (im Geschäftsjahr 0,008 % p.a.) und für Sonstige Dritte (z.B. Druck- und Veröffentlichungskosten, Abschlussprüfung, etc.).

Entwicklung des Sondervermögens 2020/2021

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance A (EUR)

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		822.037.393,00
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		-2.669.866,87
2. Zwischenausschüttung(en)		0,00
3. Mittelzufluss (netto)		-29.368.928,70
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	32.912.832,12	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	32.912.832,12	
davon aus Verschmelzung	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-62.281.760,82	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		804.684,64
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		133.519.609,91
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	38.880.756,75	
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	25.765.660,86	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		924.322.891,98

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance IT2 (EUR)

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		3.457.448,77
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttung(en)		0,00
3. Mittelzufluss (netto)		1.965.001,75
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.965.001,75	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	1.965.001,75	
davon aus Verschmelzung	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-111.839,18
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		806.742,50
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	192.942,79	
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	110.639,02	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		6.117.353,84

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance PT2 (EUR)

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		25.349.127,74
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttung(en)		0,00
3. Mittelzufluss (netto)		2.028.849,99
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	2.747.579,60	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	2.747.579,60	
davon aus Verschmelzung	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-718.729,61	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-86.875,90
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.748.191,65
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	1.277.245,75	
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	807.204,68	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		32.039.293,48

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance R (EUR)

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		6.323.424,77
1. Ausschüttung bzw. Steuerabschlag für das Vorjahr		-20.548,09
2. Zwischenausschüttung(en)		0,00
3. Mittelzufluss (netto)		-4.388.042,68
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	56.433,62	
davon aus Anteilschein-Verkäufen	56.433,62	
davon aus Verschmelzung	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-4.444.476,30	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		17.031,30
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		453.047,20
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	170.930,62	
davon Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	93.770,85	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		2.384.912,50

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance A (EUR)

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt EUR	je Anteil EUR ^{*)}
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	90.859.176,38	9,48
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	68.873.192,30	7,18
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	19.058.384,67	1,99
2. Vortrag auf neue Rechnung	138.648.433,79	14,46
III. Gesamtausschüttung		
	2.025.550,22	0,21
III. Gesamtausschüttung		
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung	2.025.550,22	0,21

Umlaufende Anteile per 30.09.2021: Stück 9.586.588

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance R (EUR)

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt EUR	je Anteil EUR ^{*)}
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	38.129,71	1,89
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	188.345,73	9,34
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	210.150,17	10,42
III. Gesamtausschüttung		
	16.325,27	0,81
III. Gesamtausschüttung		
1. Zwischenausschüttung	0,00	0,00
2. Endausschüttung	16.325,27	0,81

Umlaufende Anteile per 30.09.2021: Stück 20.162

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance IT2 (EUR)

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt EUR	je Anteil EUR ^{*)}
I. Für die Wiederanlage verfügbar		
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	503.160,69	109,41
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag	0,00	0,00
II. Wiederanlage		
	503.160,69	109,41

Umlaufende Anteile per 30.09.2021: Stück 4.599

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Anteilklasse: Allianz Strategiefonds Balance PT2 (EUR)

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt EUR	je Anteil EUR ^{*)}
I. Für die Wiederanlage verfügbar		
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	2.663.741,22	136,63
2. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,00
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag	0,00	0,00
II. Wiederanlage		
	2.663.741,22	136,63

Umlaufende Anteile per 30.09.2021: Stück 19.497

*) Rundungsbedingte Differenzen bei den je Anteil-Werten sind möglich.

Anhang

Anteilklassen

Für das Sondervermögen können Anteilklassen im Sinne von § 16 Abs. 2 der „Allgemeinen Anlagebedingungen“ gebildet werden, die sich hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, des Rücknahmeabschlags, der Währung des Anteilwertes einschließlich des Einsatzes von Währungssicherungsgeschäften, der Pauschalvergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden können. Die Bildung von Anteilklassen ist jederzeit zulässig und liegt im Ermessen der Gesellschaft.

Im Berichtszeitraum war(en) die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführte(n) Anteilklasse(n) aufgelegt.

Anteil- klasse	Wäh- rung	Pauschal- vergütung in % p.a.		Ausgabeauf- schlag in %		Rücknahme- abschlag in %	Mindestanlage- summe	Ertragsver- wendung
		maximal	aktuell	maximal	aktuell			
A	EUR	1,45	1,45	5,00	4,00	--	--	ausschüttend
IT2	EUR	0,69	0,59	5,00	0,00	--	50.000.000 EUR	thesaurierend
PT2	EUR	0,69	0,49	5,00	0,00	--	3.000.000 EUR	thesaurierend
R	EUR	1,45	0,95	--	--	--	--	ausschüttend

Angaben gemäß § 7 Nr. 9 KARBV und § 37 Abs. 1 und 2 DerivateV

Das Exposure, das durch Derivate erzielt wird	-
Die Vertragspartner der derivativen Geschäfte	IFEU, XCME, XEUR, XOSE, XSFE ¹⁾
Gesamtbetrag der i.Z.m. Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten:	-
davon:	
Bankguthaben	-
Schuldverschreibungen	-
Aktien	-

¹⁾ Vertragspartner bei börsengehandelten derivativen Geschäften ist grundsätzlich die jeweilige Börse.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko (gemäß § 37 DerivateV)

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial (gemäß §§ 10 und 11 DerivateV) wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.

Die Überwachung des Sondervermögens erfolgt nach § 7 Abs. 1 DerivateV auf Basis des relativen VaR-Ansatzes. Der potenzielle Risikobetrag für das Marktrisiko wird relativ zu einem derivatefreien Vergleichsvermögen limitiert.

Angaben nach dem qualifizierten Ansatz:

kleinster potenzieller Risikobetrag	3,04 %
größter potenzieller Risikobetrag	8,34 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	5,55 %

Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde:

Delta-Normal-Methode

Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden:

angenommene Haltedauer: 10 Tage
 einseitiges Prognoseintervall mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 %
 effektiver historischer Beobachtungszeitraum von 250 Tagen

Genutzte Hebelwirkung aus der Verwendung von Derivaten im Zeitraum 01.10.2020 bis 30.09.2021 107,40 %

Die erwartete Hebelwirkung der Derivate wird als erwartete Summe der Nominalwerte der Derivate ohne Berücksichtigung von Aufrechnungseffekten berechnet. Die tatsächliche Summe der Nominalwerte der Derivate kann die erwartete Summe der Nominalwerte der Derivate zeitweise übersteigen oder sich in der Zukunft ändern.

Derivate können von der Gesellschaft mit unterschiedlichen Zielsetzungen eingesetzt werden, einschließlich Absicherung oder spekulative Ziele. Die Berechnung der Summe der Nominalwerte der Derivate unterscheidet nicht zwischen den unterschiedlichen Zielsetzungen des Derivateeinsatzes. Aus diesem Grund liefert die erwartete Summe der Nominalwerte der Derivate keine Indikation über den Risikogehalt des Sondervermögens.

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens	auf Basis aktueller Assetallocation: Aktienteil: MSCI THE WORLD INDEX EUR TOTAL RETURN (NET) IN EUR, Rententeil: BLOOMBERG BARCLAYS EURO AGGREGATE 1-10 YEAR EUR UNHEDGED RETURN IN EUR
---	---

Das Exposure, das durch Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäfte erzielt wird	-
Die Vertragspartner der Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäfte	-
Gesamtbetrag der i.Z.m. Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften von Dritten gewährten Sicherheiten:	-
davon:	
Bankguthaben	-
Schuldverschreibungen	-
Aktien	-

Die Erträge, die sich aus den Wertpapier-Darlehen und Pensionsgeschäften für den gesamten Berichtszeitraum ergeben, einschließlich der angefallenen direkten und indirekten Kosten und Gebühren

Allianz Strategiefonds Balance -A-	6.289,13 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	41,15 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	215,55 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -R-	16,27 EUR

Emittenten oder Garanten, deren Sicherheiten mehr als 20% des Wertes des Fonds ausgemacht haben: -

Sonstige Angaben

Anteilwert	
Allianz Strategiefonds Balance -A-	96,42 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	1.330,19 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	1.643,33 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -R-	118,29 EUR
Umlaufende Anteile	
Allianz Strategiefonds Balance -A-	9.586.588,183 STK
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	4.598,847 STK
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	19.496,581 STK
Allianz Strategiefonds Balance -R-	20.162,125 STK

Angaben zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG).

Aktien, Bezugsrechte, Börsennotierte Fonds (ETFs), Genussscheine, Rentenpapiere und börsengehandelte Derivate werden, sofern vorhanden, grundsätzlich mit handelbaren Börsenkursen bewertet.

Rentenpapiere, für die keine handelbaren Börsenkurse vorliegen, werden mit validierten Kursstellungen von Brokern oder unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen im Rahmen von regelmäßig überprüften Modellen bewertet.

Genussscheine, für die keine handelbaren Börsenkurse vorliegen, werden mit dem Mittelwert von Bid- und Ask-Kurs bewertet.

Nicht börsengehandelte Derivate und Bezugsrechte werden unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen im Rahmen von regelmäßig überprüften Modellen bewertet.

Investmentfondsanteile werden mit dem von der Investmentgesellschaft veröffentlichten Rücknahmepreis bewertet.

Bankguthaben und Sonstige Vermögensgegenstände werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbeitrag bewertet.

Nicht notierte Aktien und Beteiligungen werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Die angewandten Verfahren zur Bewertung des Sondervermögens decken die aus der Covid-Pandemie herrührenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Anpassungen waren zum Zeitpunkt der Aufstellung des Jahresberichts nicht erforderlich.

Die in diesem Jahresbericht ausgewiesenen Anlagen werden i.H.v. 97,56% des Fondsvermögens mit handelbaren Börsenkursen oder Marktpreisen und 0,00% zu abgeleiteten Verkehrswerten bzw. validierten Kursstellungen von Brokern bewertet. Die verbleibenden 2,44% des Fondsvermögens bestehen aus Sonstigen Vermögensgegenständen, Sonstigen Verbindlichkeiten sowie Barvermögen.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote (TER)*)	
Allianz Strategiefonds Balance -A-	1,44 %
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	0,58 %
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	0,48 %
Allianz Strategiefonds Balance -R-	0,95 %
Die Total Expense Ratio (TER) gibt an, wie stark das Fondsvermögen mit Kosten belastet wird. Berücksichtigt wird die Pauschalvergütung sowie gegebenenfalls darüber hinaus anfallende Kosten mit Ausnahme der im Fonds angefallenen Transaktionskosten, Zinsen aus Kreditaufnahme und etwaiger erfolgsabhängiger Vergütungen. Der Aufwandsausgleich für die angefallenen Kosten wird nicht berücksichtigt. Weiterhin werden Kosten, die eventuell auf Zielfondsebene anfallen, nicht berücksichtigt. Die Summe der im angegebenen Zeitraum berücksichtigten Kosten wird zum durchschnittlichen Fondsvermögen ins Verhältnis gesetzt. Der sich daraus ergebende Prozentsatz ist die TER. Die Berechnungsweise entspricht der gemäß der CESR Guideline 10-674 in Verbindung mit der EU-Verordnung 583/2010 empfohlenen Methode.	
Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes	-
Allianz Strategiefonds Balance -A-	-
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	-
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	-
Allianz Strategiefonds Balance -R-	-
An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	-
Allianz Strategiefonds Balance -A-	12.569.303,94 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	33.477,35 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	145.459,06 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -R-	21.263,59 EUR
Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen der aus dem jeweiligen Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte zu leistenden Vergütungen und Aufwandsersatzungen zu.	
Allianz Strategiefonds Balance -A-	-
Die Gesellschaft hat im Berichtszeitraum mehr als 10% der vereinnahmten Pauschalvergütung des Sondervermögens an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen gezahlt.	
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	-
Die Gesellschaft hat im Berichtszeitraum keinen wesentlichen Teil der vereinnahmten Pauschalvergütung des Sondervermögens an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen gezahlt.	
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	-
Die Gesellschaft hat im Berichtszeitraum weniger als 10% der vereinnahmten Pauschalvergütung des Sondervermögens an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen gezahlt.	
Allianz Strategiefonds Balance -R-	-
Die Gesellschaft hat im Berichtszeitraum weniger als 10% der vereinnahmten Pauschalvergütung des Sondervermögens an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen gezahlt.	
Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge, die dem Sondervermögen für den Erwerb und die Rücknahme von Investmentanteilen berechnet wurden	
-	
Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile	
AGIF-Allianz EO Infl-Linked Bd Inhaber Anteile WT	0,18 % p.a.
AGIF-Allianz Emer.Mkts Sov. Bd Act. N. WT H2 Acc.	0,38 % p.a.

*) Durch Kalkulation mit dem durchschnittlichen NAV können geringfügige Rundungsdifferenzen zur Pauschalvergütung entstanden sein.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

Sonstige Erträge			
Allianz Strategiefonds Balance -A- EUR	Quellensteuerrückvergütung	EUR	327.793,72
Allianz Strategiefonds Balance -IT2- EUR	Quellensteuerrückvergütung	EUR	2.160,21
Allianz Strategiefonds Balance -PT2- EUR	Quellensteuerrückvergütung	EUR	11.309,49
Allianz Strategiefonds Balance -R- EUR	Quellensteuerrückvergütung	EUR	844,91
Sonstige Aufwendungen			
Allianz Strategiefonds Balance -A- EUR	Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	EUR	-8.594,79
	Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	EUR	-7.407,01
Allianz Strategiefonds Balance -IT2- EUR	Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	EUR	-56,79
	Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	EUR	-48,68
Allianz Strategiefonds Balance -PT2- EUR	Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	EUR	-297,37
	Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	EUR	-254,83
Allianz Strategiefonds Balance -R- EUR	Erfolgsbeteiligungen Rechtsansprüche durch Dritte	EUR	-22,14
	Gebühren für Quellensteuerrückerstattung	EUR	-19,02

Transaktionskosten im Geschäftsjahr (inkl. Transaktionskosten im Zusammenhang mit Wertpapiergeschäften (nicht in der E+A-Rechnung enthalten)) gesamt

Allianz Strategiefonds Balance -A-	224.814,00 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -IT2-	1.232,60 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -PT2-	7.387,79 EUR
Allianz Strategiefonds Balance -R-	1.121,04 EUR

Weitere zum Verständnis des Berichts erforderliche Angaben**Erläuterung der Nettoveränderung**

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Berichtszeitraum die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließt, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließt und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Berichtszeitraumes mit den Summenpositionen zum Anfang des Berichtszeitraumes die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Auf Grund der Buchungssystematik bei Fonds mit Anteilklassen, wonach täglich die Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste zum Vortag auf Gesamtfondsebene berechnet und entsprechend dem Verhältnis der Anteilklassen zueinander verteilt wird, kann es bei Überwiegen der täglich negativen Veränderungen über die täglich positiven Veränderungen über den Berichtszeitraum innerhalb der Anteilklasse zum Ausweis von negativen nicht realisierten Gewinnen bzw. im umgekehrten Fall zu positiven nicht realisierten Verlusten kommen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung (alle Werte in EUR) der Allianz Global Investors GmbH für das Geschäftsjahr vom 01.01.2020 bis zum 31.12.2020

Die folgende Aufstellung zeigt die Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr tatsächlich gezahlten Vergütungszahlen für Mitarbeiter der Allianz Global Investors GmbH gegliedert in fixe und variable Bestandteile sowie nach Geschäftsleitern, Risikoträgern, Beschäftigten mit Kontrollfunktionen und Mitarbeitern, die eine Gesamtvergütung erhalten, auf Grund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Geschäftsleiter und Risikoträger.

AllianzGI GmbH, Vergütung 2020

alle Werte in EUR

tatsächlich gezahlte Vergütung (cash-flow 2020)

Anzahl Mitarbeiter 1.675

		davon Risk Taker	davon Geschäftsleiter	davon andere Risk Taker	davon mit Kontrollfunktion	davon mit gleichem Einkommen
Fixe Vergütung	164.233.442	7.695.609	1.758.427	1.435.262	449.851	4.052.069
Variable Vergütung	103.587.135	17.405.428	3.452.759	5.203.209	206.037	8.543.423
Gesamtvergütung	267.820.577	25.101.037	5.211.186	6.638.471	655.888	12.595.492

Die Angaben zur Mitarbeitervergütung enthalten keine Vergütungen, die von ausgelagerten Managern an deren Mitarbeiter gezahlt werden.

Festlegung der Vergütung

AllianzGI 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 Gesellschaft zuständig. Für die Geschäftsführung selbst liegt die Entscheidung über die Festlegung der Vergütung beim Gesellschafter.

Die Gesellschaft 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 Geschäftsführung die Vergütungspolitik der Gesellschaft unter den Anforderungen der OGAW und AIFM-Richtlinie. Diese Vergütungspolitik gilt sowohl für die in Deutschland ansässige Gesellschaft 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 des Unternehmens 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.

Die aufgeschobenen Anteile steigen entsprechend der Höhe der variablen Vergütung. Die Hälfte des aufgeschobenen Betrags ist an die Leistung des Unternehmens gebunden, die andere Hälfte wird in von AllianzGI verwaltete Fonds investiert. Die letztendlich zur Auszahlung kommenden Beträge sind vom Geschäftserfolg des Unternehmens 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 Zeitraum von einem Jahr sowie von drei Jahren.

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 Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen (welche anhand aktueller Organisation Diagramme und Stellenprofile identifiziert, sowie anhand einer Einschätzung hinsichtlich des Einflusses auf das Risikoprofil beurteilt wurden) sowie alle Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, aufgrund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Mitglieder der Geschäftsleitung 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 das Unternehmen 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.

Angaben für Institutionelle Anleger gemäß § 101 Abs. 2 Nummer 5 KAGB i. V. m. § 134 c Absatz 4 AktG

In Erfüllung der Anforderung, der zum 1.1.2020 in Kraft getretenen Umsetzung der zweiten Aktionärsrechterichtlinie, berichten wir gem. § 134 c Abs. 4 AktG Folgendes:

1. Über die wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken

Hinsichtlich der mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens, verweisen wir auf die Darstellung im Tätigkeitsbericht. Die im Tätigkeitsbericht aufgeführten Risiken sind geschäftsjahrbezogen, jedoch sehen wir mittel- bis langfristig keine Änderung der dort dargestellten Risikoeinschätzung. Unter anderem finden sich allgemeine Informationen zu den wesentlichen mittel- bis langfristigen Risiken des Sondervermögens im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Risikohinweise“. Unsere Verkaufsprospekte sind auf der AllianzGI-Homepage <https://de.allianzgi.com/de-de/unsere-fonds> veröffentlicht.

2. Über die Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten

Informationen über die Zusammensetzung des Portfolios, die Portfolioumsätze und die Portfolioumsatzkosten sind in den Abschnitten „Vermögensaufstellung“, „Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen“ und „Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote“ ersichtlich.

3. Zur Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung

Angaben zur Berücksichtigung der mittel- bis langfristigen Entwicklung der Gesellschaft bei der Anlageentscheidung sind im Abschnitt 2.3 des AllianzGI Stewardship Statements aufgeführt. Unser AllianzGI Stewardship Statement ist verfügbar unter

<https://www.allianzgi.com/en/our-firm/esg/documents>.

4. Zum Einsatz von Stimmrechtsberatern

Angaben zum Einsatz von Stimmrechtsberatern sind im Abschnitt 2.6 des AllianzGI Stewardship Statements sowie im Proxy Voting Report aufgeführt, welche unter <https://www.allianzgi.com/en/our-firm/esg/documents> verfügbar sind.

5. Zur Handhabung der Wertpapierleihe und zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten

Informationen zu dem Umfang der Wertpapierleihe während des Berichtszeitraums, sofern betrieben, sind in der Vermögensaufstellung und unter dem Abschnitt „Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte“ dieses Berichts aufgeführt.

Die grundsätzliche Handhabung der Wertpapierleihe ist im Verkaufsprospekt unter dem Abschnitt „Wertpapier-Darlehensgeschäfte“ beschrieben. Unsere Verkaufsprospekte sind auf der AllianzGI-Homepage <https://de.allianzgi.com/de-de/unsere-fonds> veröffentlicht.

Angaben zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Gesellschaften, insbesondere durch Ausübung von Aktionärsrechten, sind im Abschnitt 2.2 des AllianzGI Stewardship Statements aufgeführt. In dem Textteil „Securities Lending“, unter dem Abschnitt 2.6 des AllianzGI Stewardship Statements, befinden sich Informationen zum Umgang mit Stimmrechten im Rahmen von Wertpapierleihe. Unser AllianzGI Stewardship Statement ist verfügbar unter

<https://www.allianzgi.com/en/our-firm/esg/documents>.

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

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				
- Kostenanteil des Fonds				
- Ertragsanteil der KVG		0		0
- Kostenanteil der KVG		-		
- Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)		0		0
- Kostenanteil Dritter		-		
für Wertpapierdarlehen				
- Ertragsanteil des Fonds		6.562,10		70
- Kostenanteil des Fonds		-		
- Ertragsanteil der KVG		0		0
- Kostenanteil der KVG		-		
- Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)		2.812,24		30
- 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.
Verleihte 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	0
Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps	In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps	
Verwahrart bestimmt Empfänger		100

Allianz Strategiefonds Balance

Frankfurt am Main, den 21. Januar 2022

Allianz Global Investors GmbH

Die Geschäftsführung

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die Allianz Global Investors GmbH, Frankfurt am Main

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht nach § 7 KARBV des Sondervermögens Allianz Strategiefonds Balance – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2020 bis zum 30. September 2021, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2021, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2020 bis zum 30. September 2021 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht nach § 7 KARBV in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Allianz Global Investors GmbH (im Folgenden die „Kapitalverwaltungsgesellschaft“) unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachwei-

se ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die Publikation „Jahresbericht“ – ohne weitergehende Querverweise auf externe Informationen –, mit Ausnahme des geprüften Jahresberichts nach § 7 KARBV sowie unseres Vermerks.

Unsere Prüfungsurteile zum Jahresbericht nach § 7 KARBV erstrecken sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht nach § 7 KARBV oder unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht nach § 7 KARBV

Die gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts nach § 7 KARBV zu ermöglichen, der

frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet unter anderem, dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV die Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV als Ganzes frei von wesentlichen – beabsichtigten oder unbeabsichtigten – falschen Darstellungen ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus Verstößen oder Unrichtigkeiten resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts nach § 7 KARBV getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher – beabsichtigter oder unbeabsichtigter – falscher Darstellungen im Jahresbericht nach § 7 KARBV, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet 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 Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Kapitalverwaltungsgesellschaft abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Kapitalverwaltungsgesellschaft bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht nach § 7 KARBV aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresberichts nach § 7 KARBV einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen

lichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Frankfurt am Main, den 21. Januar 2022

PricewaterhouseCoopers GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Sonja Panter

ppa. Stefan Gass

Wirtschaftsprüferin

Wirtschaftsprüfer

Weitere Informationen (nicht durch das Testat erfasst)

Wertentwicklung des Allianz Strategiefonds Balance A (EUR)

		Fonds	Vergleichsindex
		50% BLOOMBERG BARCLAYS CAPITAL EURO-AGGREGATE: 1-10 YEAR RETURN, 50% MSCI THE WORLD INDEX EUR TOTAL RETURN (NET) REBASED LAST BUSINESS DAY OF MONTH IN EUR	
		%	%
1 Jahr	30.09.2020 - 30.09.2021	16,69	14,41
2 Jahre	30.09.2019 - 30.09.2021	12,55	16,43
3 Jahre	30.09.2018 - 30.09.2021	15,99	24,83
4 Jahre	30.09.2017 - 30.09.2021	21,69	32,72
5 Jahre	30.09.2016 - 30.09.2021	28,91	40,36
10 Jahre	30.09.2011 - 30.09.2021	108,78	136,88

Vergleichsindex: für das jeweilige Anlagesegment als repräsentativ angesehener Index, der ggf. zur Berechnung einer erfolgsabhängigen Vergütung herangezogen wird. Berechnungsbasis Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt); ggf. Ausschüttungen wieder angelegt. Berechnung nach der BVI-Methode. Zahlen aus der Vergangenheit garantieren keine zukünftige Wertentwicklung.

Wertentwicklung des Allianz Strategiefonds Balance IT2 (EUR)

		Fonds	Vergleichsindex
		50% BLOOMBERG BARCLAYS CAPITAL EURO-AGGREGATE: 1-10 YEAR RETURN, 50% MSCI THE WORLD INDEX EUR TOTAL RETURN (NET) REBASED LAST BUSINESS DAY OF MONTH IN EUR	
		%	%
1 Jahr	30.09.2020 - 30.09.2021	17,70	14,41
2 Jahre	30.09.2019 - 30.09.2021	14,51	16,43
3 Jahre	30.09.2018 - 30.09.2021	19,03	24,83
4 Jahre	30.09.2017 - 30.09.2021	25,94	32,72
Seit Auflegung	05.10.2016 - 30.09.2021	34,79	40,51

Vergleichsindex: für das jeweilige Anlagesegment als repräsentativ angesehener Index, der ggf. zur Berechnung einer erfolgsabhängigen Vergütung herangezogen wird. Berechnungsbasis Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt). Berechnung nach der BVI-Methode. Zahlen aus der Vergangenheit garantieren keine zukünftige Wertentwicklung.

Wertentwicklung des Allianz Strategiefonds Balance PT2 (EUR)

		Fonds	Vergleichsindex
		50% BLOOMBERG BARCLAYS CAPITAL EURO-AGGREGATE: 1-10 YEAR RETURN, 50% MSCI THE WORLD INDEX EUR TOTAL RETURN (NET) REBASED LAST BUSINESS DAY OF MONTH IN EUR	
		%	%
1 Jahr	30.09.2020 - 30.09.2021	17,82	14,41
2 Jahre	30.09.2019 - 30.09.2021	14,73	16,43
3 Jahre	30.09.2018 - 30.09.2021	19,38	24,83
4 Jahre	30.09.2017 - 30.09.2021	26,43	32,72
5 Jahre	30.09.2016 - 30.09.2021	35,20	40,36
Seit Auflegung	21.02.2014 - 30.09.2021	69,06	77,02

Vergleichsindex: für das jeweilige Anlagesegment als repräsentativ angesehener Index, der ggf. zur Berechnung einer erfolgsabhängigen Vergütung herangezogen wird. Berechnungsbasis Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt). Berechnung nach der BVI-Methode. Zahlen aus der Vergangenheit garantieren keine zukünftige Wertentwicklung.

Wertentwicklung des Allianz Strategiefonds Balance R (EUR)

		Fonds	Vergleichsindex
		50% BLOOMBERG BARCLAYS CAPITAL EURO-AGGREGATE: 1-10 YEAR RETURN, 50% MSCI THE WORLD INDEX EUR TOTAL RETURN (NET) REBASED LAST BUSINESS DAY OF MONTH IN EUR	
		%	%
1 Jahr	30.09.2020 - 30.09.2021	17,27	14,41
2 Jahre	30.09.2019 - 30.09.2021	13,67	16,43
3 Jahre	30.09.2018 - 30.09.2021	17,74	24,83
Seit Auflegung	16.11.2017 - 30.09.2021	22,20	30,75

Vergleichsindex: für das jeweilige Anlagesegment als repräsentativ angesehener Index, der ggf. zur Berechnung einer erfolgsabhängigen Vergütung herangezogen wird. Berechnungsbasis Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt); ggf. Ausschüttungen wieder angelegt. Berechnung nach der BVI-Methode. Zahlen aus der Vergangenheit garantieren keine zukünftige Wertentwicklung.

Unterverwahrung (nicht durch das Testat erfasst)

Die Verwahrstelle hat die Verwahrungsaufgaben generell auf die nachfolgend aufgeführten Unternehmen (Unterverwahrer) übertragen. Die Unterverwahrer werden dabei entweder als Zwischenverwahrer, Unterverwahrer oder Zentralverwahrer tätig, wobei sich die Angaben jeweils auf Vermögensgegenstände in den nachfolgend genannten Ländern bzw. Märkten beziehen:

Land bzw. Markt	Unterverwahrer
Ägypten	Citibank N.A.
Albanien	Raiffeisen Bank sh.a.
Argentinien	Citibank N.A.
Australien	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Ltd.
Bahrain	HSBC Bank Middle East Limited
Bangladesch	Standard Chartered Bank
Belgien	BNP Paribas Securities Services, S.C.A.
Benin	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Bermuda	HSBC Bank Bermuda Limited
Bosnien und Herzegowina	UniCredit Bank d.d.
Botswana	Standard Chartered Bank Botswana Limited
Brasilien	Citibank N.A.
Bulgarien	Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Bulgarien UniCredit Bulbank AD
Burkina Faso	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Chile	Banco de Chile
China – A-Aktien-Markt	HSBC Bank (China) Company Limited China Construction Bank Corporation
China – B-Aktien-Markt	HSBC Bank (China) Company Limited China Construction Bank Corporation
China - Shanghai -Hong Kong Stock Connect	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited Citibank N.A.
Costa Rica	Banco BCT S.A.
Dänemark	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Schweden (handelt durch ihre Zweigniederlassung in Kopenhagen)
Deutschland	Deutsche Bank AG State Street Bank International GmbH
Elfenbeinküste	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A.
Estland	AS SEB Pank
Eswatini (vorher Swasiland)	Standard Bank Eswatini Limited
Finnland	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Schweden (handelt durch ihre Zweigniederlassung in Helsinki)
Frankreich	BNP Paribas Securities Services, S.C.A.
Ghana	Standard Chartered Bank Ghana Plc
Griechenland	BNP Paribas Securities Services S.C.A.
Großbritannien	State Street Bank and Trust Company, Zweigniederlassung Großbritannien
Guinea-Bissau	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Hongkong	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Indien	Deutsche Bank AG Citibank N.A.
Indonesien	Deutsche Bank AG
Irland	State Street Bank and Trust Company, Zweigniederlassung Grossbritannien
Island	Landsbankinn hf.
Israel	Bank Hapoalim B.M.
Italien	Intesa Sanpaolo S.p.A.

Land bzw. Markt	Unterverwahrer
Japan	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited Mizuho Bank, Limited
Jordanien	Standard Chartered Bank, Zweigniederlassung Shmeissani
Kanada	State Street Trust Company Canada
Kasachstan	JSC Citibank Kasachstan
Katar	HSBC Bank Middle East Limited
Kenia	Standard Chartered Bank Kenya Limited
Kolumbien	Cititrust Colombia, S.A. Sociedad Fiduciaria
Kroatien	Privredna Banka Zagreb d.d. Zagrebacka Banka d.d.
Kuwait	HSBC Bank Middle East Limited
Lettland	AS SEB banka
Litauen	AB SEB bankas
Malawi	Standard Bank PLC
Malaysia	Standard Chartered Bank (Malaysia) Berhad
Mali	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Marokko	Citibank Maghreb S.A.
Mauritius	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Mexiko	Banco Nacional de México S.A.
Namibia	Standard Bank Namibia Limited
Neuseeland	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Niederlande	BNP Paribas Securities Services, S.C.A.
Niger	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Nigeria	Stanbic IBTC Bank Plc.
Norwegen	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Schweden (handelt durch ihre Zweigniederlassung in Oslo)
Oman	HSBC Bank Oman S.A.O.G.
Österreich	UniCredit Bank Austria AG Deutsche Bank AG
Pakistan	Deutsche Bank AG
Panama	Citibank N.A.
Peru	Citibank del Perú S.A.
Philippinen	Standard Chartered Bank
Polen	Bank Handlowy w Warszawie S.A.
Portugal	Deutsche Bank AG, Niederlande
Republik Georgien	JSC Bank of Georgia
Republik Korea	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited Deutsche Bank AG
Republik Srpska	UniCredit Bank d.d.
Rumänien	Citibank Europe plc, Dublin, Zweigniederlassung Rumänien
Russland	AO Citibank
Sambia	Standard Chartered Bank Zambia Plc.
Saudi-Arabien	HSBC Saudi Arabia Saudi British Bank
Schweden	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)
Schweiz	UBS Switzerland AG Credit Suisse (Switzerland) Limited
Senegal	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Serbien	UniCredit Bank Serbia JSC

Land bzw. Markt	Unterverwahrer
Simbabwe	Stanbic Bank Zimbabwe Limited
Singapur	Citibank N.A.
Slowakische Republik	UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
Slowenien	UniCredit Banka Slovenija d.d.
Spanien	Deutsche Bank S.A.E.
Sri Lanka	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Südafrika	Standard Bank of South Africa Limited FirstRand Bank Limited
Taiwan - R.O.C.	Standard Chartered Bank (Taiwan) Limited
Tansania	Standard Chartered Bank (Tanzania) Limited
Thailand	Standard Chartered Bank (Thai) Public Company Limited
Togo	Standard Chartered Bank Cote d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Tschechische Republik	Ceskoslovenská obchodní banka, a.s. UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
Tunesien	Union Internationale de Banques
Türkei	Citibank A.S.
Uganda	Standard Chartered Bank Uganda Limited
Ukraine	JSC Citibank
Ungarn	UniCredit Bank Hungary Zrt. Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe
Uruguay	Banco Itaú Uruguay S.A.
Vereinigte Arabische Emirate - Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)	HSBC Bank Middle East Limited
Vereinigte Arabische Emirate - DFM	HSBC Bank Middle East Limited
Vereinigte Arabische Emirate - Dubai International Financial Center (DIFC)	HSBC Bank Middle East Limited
Vereinigte Staaten	State Street Bank and Trust Company
Vietnam	HSBC Bank (Vietnam) Limited
Zypern	BNP Paribas Securities Services, S.C.A., Griechenland

Weitergehende Informationen über den Fonds finden sich in den Wesentlichen Anlegerinformationen und im Verkaufsprospekt.

Weitere Informationen (nicht durch das Testat erfasst)

Ihre Partner

Allianz Global Investors GmbH
Bockenheimer Landstraße 42-44
60323 Frankfurt am Main
Kundenservice Hof
Telefon: 09281-72 20
Telefax: 09281-72 24 61 15
09281-72 24 61 16
E-Mail: info@allianzgi.de

Geschäftsführung

Alexandra Auer (Vorsitzende)
Ingo Mainert
Dr. Thomas Schindler
Petra Trautschold
Birte Trenkner

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
49,9 Mio. Euro
Stand: 31.12.2020

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Brienner Strasse 59
80333 München
Eigenkapital der State Street Bank
International GmbH: EUR 109,4 Mio.
Stand: 31.12.2020

Gesellschafter

Allianz Asset Management GmbH
München

Besondere Orderannahmestellen

Fondsdepot Bank GmbH
Windmühlenweg 12
95030 Hof

Aufsichtsrat

Tobias C. Pross
Mitglied der Geschäftsführung
der Allianz Global Investors Holdings GmbH
CEO Allianz Global Investors
München (Vorsitzender)

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

Klaus-Dieter Herberg
Allianz Networks Germany
Allianz Global Investors GmbH
München

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Friedrich-Ebert-Anlage 35-37
60327 Frankfurt am Main

Giacomo Campora
CEO Allianz Bank
Financial Advisers S.p.A.
Mailand
(stellvertretender Vorsitzender)

Prof. Dr. Michael Hüther
Direktor und Mitglied des Präsidiums
Institut der deutschen Wirtschaft
Köln

Stand: 30. September 2021

David Newman
CIO Global High Yield
Allianz Global Investors GmbH
UK Branch
London

Isaline Marcel
Mitglied Geschäftsführung
der Allianz Asset Management GmbH
München.

Sie erreichen uns auch über Internet: <https://de.allianzgi.com>

Allianz Global Investors GmbH

Bockenheimer Landstraße 42–44
60323 Frankfurt am Main
info@allianzgi.de
<https://de.allianzgi.com>