**Informacje ujawniane na podstawie Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 (Dz.Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015)** *(poniższe informacje nie podlegały przeglądowi półrocznemu prowadzonemu przez biegłego rewidenta)*

**Definicje i skróty**

Transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych, TFUPW - transakcje, o których mowa w art. 3 pkt 11 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 (Dz. Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015)
SWAP Przychodu Całkowitego - transakcje, o których mowa w art. 3 pkt 18 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 (Dz. Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015)
Dokonując lokat Aktywów, Fundusz:

- Może stosować Transakcje finansowane z Użyciem Papierów Wartościowych (TFUPW)
- Nie będzie stosował transakcji typu swap przychodu całkowitego

**Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych**

Na dzień bilansowy stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych były Subfundusze:

- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Selektywny

W okresie sprawozdawczym występowały transakcje typu sell-buy-back w:

- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych (143 transakcje)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus (9 transakcji)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny (266 transakcji)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji (1 transakcja)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu (8 transakcji)

Zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN. Były to transakcje z okresem zapadalności od 1 dnia do 1 tygodnia.

W okresie sprawozdawczym występowały transakcje typu buy-sell-back w:

- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji (50 transakcji)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu (24 transakcje)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus (41 transakcji)
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Selektywny (36 transakcji)

**Dane dotyczące koncentracji:**

- 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy) : nie dotyczy,
- 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)

**Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| buy-sell-back | m Bank S.A | 13 998 |
| buy-sell-back | Bank Pekao S.A. | 0 |
| sell-buy-back | m Bank S.A. | 0 |

**Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| sell-buy-back | m Bank S.A | 45 455 |
| sell-buy-back | Bank Pekao S.A. | 0 |

**Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| buy-sell-back | m Bank S.A | 0 |
| buy-sell-back | Bank Pekao S.A. | 0 |
| sell-buy-back | m Bank S.A | 0 |
| sell-buy-back | Bank Pekao S.A. | 0 |

**Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| sell-buy-back | m Bank S.A | 24 070 |
| sell-buy-back | Bank Pekao S.A. | 0 |

**Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| sell-buy-back | Bank Pekao S.A. | 0 |
| sell-buy-back | m Bank S.A | 0 |
| buy-sell-back | m Bank S.A | 0 |
| buy-sell-back | Bank Pekao S.A. | 0 |

## Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Selektywny

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Nazwa kontrahenta | Wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia |
|---|---|---|
| buy-sell-back | m Bank S.A | 10 996 |
| buy-sell-back | Bank Pekao S.A. | 0 |

## Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w pierwszym półroczu 2022 roku

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Rodzaj i jakość zabezpieczeń | Waluta zabezpieczeń | Kraj siedziby kontrahenta | Rozliczenie i rozrachunek | Okres zapadalności transakcji |
|---|---|---|---|---|---|
| Repo | n/d | n/d | n/d | n/d | n/d |
| Reverse repo | n/d | n/d | n/d | n/d | n/d |
| Buy-sell-back, w tym: | | | | | |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Selektywny* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| Sell-buy-back, w tym: | | | | | |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny* | *obligacje Skarbu Państwa* | *PLN* | *Polska* | *dwustronne* | *Od 1 dnia do 1 tygodnia* |
| Udzielenie pożyczki papierów wartościowych | n/d | n/d | n/d | n/d | n/d |
| Zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych | n/d | n/d | n/d | n/d | n/d |
| Z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego | n/d | n/d | n/d | n/d | n/d |

**Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w tys. złotych)**

| Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych | Przychody | Koszty |
|---|---|---|
| **Repo** | **n/d** | **n/d** |
| **Reverse repo** | **n/d** | **n/d** |
| **Buy-sell-back** | **329** | **6** |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji* | *153* | *2* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus* | *47* | *2* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Selektywny* | *90* | *1* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu* | *39* | *1* |
| **Sell-buy-back, w tym:** | **0** | **1 305** |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu* | *0* | *24* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych* | *0* | *285* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus* | *0* | *1* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacji* | *0* | *1* |
| *Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny* | *0* | *994* |
| **Udzielenie pożyczki papierów wartościowych** | **n/d** | **n/d** |
| **Zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych** | **n/d** | **n/d** |
| **Z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego** | **n/d** | **n/d** |

Całość dochodów generowanych z TFUPW jest przekazywana do Funduszu.
W związku z zawieraniem TFUPW Subfundusz może ponosić wyłącznie koszty przewidziane zapisami statutu Funduszu.
Papiery wartościowe nabyte przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu, wycenia się, począwszy od dnia zawarcia umowy kupna, metodą skorygowanej ceny nabycia oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.
Zobowiązania z tytułu zbycia papierów wartościowych, przy zobowiązaniu się Funduszu do odkupu, wycenia się, począwszy od dnia zawarcia umowy sprzedaży, metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu, a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

**Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych**
Zabezpieczania otrzymane przez Fundusz przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanego Subfunduszu w banku pełniącym funkcję depozytariusza Funduszu.

**Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych**
Zabezpieczania udzielone przez Fundusz przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

**Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń gotówkowych**
Środki pieniężne otrzymane przez wskazany Subfundusz w ramach transakcji finansowych z użyciem papierów wartościowych lokowane są w taki sam sposób, jak pozostałe aktywa tego Subfunduszu. Wynik osiągnięty z tego tytułu wyznaczany jest poprzez oszacowanie wyniku Subfunduszu

przypadającego na jednostkę uczestnictwa kategorii A w okresie sprawozdawczym, przypadającego na środki pieniężne otrzymane w ramach tych transakcji w czasie ich trwania. W okresie sprawozdawczym wynik ten wyniósł:

- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Konserwatywny: - 461 tys. złotych;
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Obligacji Plus: n/d,
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych: -633 tys. złotych.
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Aktywnej Alokacjo: -4 tys. złotych.
- Allianz Fundusz Inwestycyjny Otwarty Subfundusz Stabilnego Wzrostu: -66 tys. złotych.

## Wartość Całkowitej Ekspozycji wyznaczonej metodą zaangażowania

| Całkowita Ekspozycja* | Wartość aktualna w złotych | Wartość średnia w roku 2021 w złotych | Wartość minimalna w roku 2021 w złotych | Wartość maksymalna w roku 2021 w złotych |
|---|---|---|---|---|
| Allianz FIO Subfundusz Stabilnego Wzrostu | 0,00 | 921 937,71 | 0,00 | 7 168 186,50 |
| Allianz FIO Subfundusz Obligacji Plus | 0,00 | 75 116,65 | 0,00 | 1 080 937,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Aktywnej Alokacji | 0,00 | 19 460,08 | 0,00 | 2 413 050,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Konserwatywny | 45 455 496,00 | 51 085 586,58 | 35 872 344,50 | 61 984 608,90 |
| Allianz FIO Subfundusz Polskich Obligacji Skarbowych | 24 169 710,70 | 14 971 288,01 | 3 084 622,20 | 41 160 328,70 |
| Allianz FIO Subfundusz Akcji Małych i Średnich Spółek | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Selektywny | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Akcji Globalnych | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Obligacji Globalnych | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Allianz FIO Subfundusz Akcji Rynku Złota | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Allianz FIO Globalny Stabilnego Dochodu | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

**Dane na dzień ostatniej wyceny oficjalnej 30.06.2022r..*

| | | |
|---|---|---|
| Robert Hörberg | Prezes Zarządu<br>TFI Allianz Polska S.A. | Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego<br>*(podpis)* |
| Tymoteusz Paleczny | Wiceprezes Zarządu<br>TFI Allianz Polska S.A. | Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego<br>*(podpis)* |
| Anna Bąkała | Członek Zarządu<br>TFI Allianz Polska S.A. | Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego<br>*(podpis)* |
| Katarzyna Witek | Osoba odpowiedzialna za prowadzenie ksiąg rachunkowych | Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego<br>*(podpis)* |

*Dokument sporządzony został w wersji elektronicznej, podpisy złożone zostały w formie kwalifikowanych podpisów elektronicznych.*

Warszawa, dnia 23 sierpnia 2022 roku