SPRAWOZDANIE Z DZIAŁALNOŚCI ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO ZA ROK 2022

1. Podstawowe informacje o Funduszu

Allianz Strategiczny Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty („Fundusz" lub „Allianz Inwestycje SFIO") jest funduszem inwestycyjnym otwartym z wydzielonymi subfunduszami w rozumieniu Ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz.U. 2021 poz. 605 z późn. zm.). Fundusz powstał na podstawie decyzji Komisji Nadzoru Finansowego o numerze DFI/I/4033/16/24/U/15/KS z dnia 22 października 2015.

Fundusz został wpisany do rejestru funduszy inwestycyjnych w dniu 9 listopada 2015 roku, pod numerem RFi 1 243.

Fundusz jest specjalistycznym funduszem inwestycyjnym otwartym z wydzielonymi subfunduszami w rozumieniu przepisów Ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tekst jednolity Dz.U. 2022 poz. 1523) („Ustawa").

W ramach Funduszu wydzielono następujące subfundusze:

- Allianz Globalnych Strategii,
- Allianz Obligacji,

przy czym na dzień sporządzenia niniejszego sprawozdania finansowego utworzono jedynie Subfundusz Allianz Globalnych Strategii.

W dniu 1 lipca 2022 roku weszły w życie zmiany statutu Funduszu, w wyniku czego nastąpiła zmiana nazwy Funduszu na Allianz Strategiczny Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty.

Fundusz jako specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty został utworzony na czas nieograniczony.

2. Sytuacja Finansowa Funduszu

Aktywa netto na dzień 31 grudnia 2022 roku wynosiły 6 509 tys. złotych. W 2022 roku Fundusz odnotował zysk z operacji w kwocie 1 099 tys. złotych. Łączny odpływ netto kapitału z Funduszu w 2022 roku wyniósł 13 927 tys. złotych.

Procentowa zmiana wartości jednostki uczestnictwa (kategoria A), wg ostatnich wycen w okresach sprawozdawczych (30.12.2022r. i 30.12.2021r.)	
Allianz Globalnych Strategii	8,91%

3. Zdarzenia istotnie wpływające na działalności Funduszu, jakie nastąpiły w roku obrotowym, a także po jego zakończeniu

Allianz Globalnych Strategii

W 2022 roku struktura portfela nie uległa istotnej zmianie. Subfundusz lokował przeważającą część aktywów w tytuły uczestnictwa funduszu źródłowego. Pozostała część aktywów utrzymywana była na rachunkach bankowych w celu pokrycia potrzeb płynnościowych Subfunduszu oraz w celach zabezpieczenia waluty funduszu źródłowego.

Na końcu 2022 roku, podstawowym składnikiem lokat Subfunduszu były tytuły uczestnictwa funduszu źródłowego. Oprócz nich, w skład aktywów wchodziła głównie gotówka, utrzymywana m.in. na potrzebę zabezpieczenia przed ryzykiem walutowym. Subfundusz utrzymywał też pozycje w instrumentach pochodnych ograniczających ryzyko walutowe.

W 2022 roku cena jednostki uczestnictwa kategorii A wzrosła o 8,91%. Najważniejszymi czynnikami wpływającymi na osiągnięty wynik były: stopa zwrotu z funduszu źródłowego, efekt zabezpieczenia kursowego, koszty.

Głównym ryzykiem, które ponosi Subfundusz, jest ryzyko związane z decyzjami podejmowanymi przez fundusz źródłowy.

4. Przewidywany rozwój Funduszu

Aktywa Funduszu powinny rosnąć zarówno z powodu wzrostu wartości jednostek uczestnictwa poszczególnych subfunduszy, jak i z powodu napływów. W długim terminie oczekuje się, że wzrost wartości jednostek uczestnictwa będzie powiązany z ryzykiem: będzie największy w przypadku subfunduszy posiadających ekspozycję na ceny akcji, i najmniejszy w przypadku subfunduszy charakteryzujących się niskim ryzykiem, eksponowanych głównie na poziom stóp procentowych. Bardzo dobra sytuacja finansowa wszystkich funduszy – w tym wysoka płynność portfeli – powinna się utrzymywać.

Robert Hörberg	Prezes Zarządu TFI Allianz Polska S.A.	Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego *(podpis)*
Tymoteusz Paleczny	Wiceprezes Zarządu TFI Allianz Polska S.A.	Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego *(podpis)*
Anna Bąkała	Członek Zarządu TFI Allianz Polska S.A.	Podpisano przy użyciu kwalifikowanego podpisu elektronicznego *(podpis)*

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

Warszawa, dnia 15 marca 2023 roku