

ALLIANZ VALEURS DURABLES

Document d'information périodique

28.06.2024

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Eléments de l'état du patrimoine | Montant à l'arrêté périodique * |
|--|---------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier | 956 214 701,78 |
| b) Avoirs bancaires | 66 269,87 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPCVM | 1 237 572,18 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPCVM | 957 518 543,83 |
| e) Passif | -2 047 172,95 |
| f) Valeur nette d'inventaire | 955 471 370,88 |

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

| Code ISIN de la part | Libellé de la part | Affectation des sommes distribuables | Devise de la part | Actif net de la part (EUR) | Nombre de parts | Valeur liquidative (EUR) |
|----------------------|--------------------|--------------------------------------|-------------------|----------------------------|-----------------|--------------------------|
| FR0010339481 | Instit - I/C | Capitalisable | EUR | 197 508 954,20 | 516 879,296 | 382,11 |
| FR0011173947 | Instit - I/D | Distribuable | EUR | 11 524 484,99 | 48 253,000 | 238,83 |
| FR0013479367 | RC (H2-USD) HEDGE | Capitalisable | USD | 14 631,04 | 100,000 | 146,31 |
| FR0013479375 | RC (USD) | Capitalisable | USD | 1 324,74 | 10,000 | 132,47 |
| FR0014003X00 | RD (EUR) | Distribuable | EUR | 6 043 895,74 | 56 159,593 | 107,62 |
| FR0013285087 | Retail - MC | Capitalisable | EUR | 20 551 572,69 | 134 210,777 | 153,12 |
| FR0000017329 | Retail - R/C | Capitalisable | EUR | 460 635 463,77 | 455 666,758 | 1 010,90 |
| FR0013287844 | Retail - W/C | Capitalisable | EUR | 259 191 043,71 | 167 897,520 | 1 543,74 |

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

| Eléments du portefeuille titres: | Pourcentage | |
|---|-------------|------------------|
| | Actif net | Total des actifs |
| a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier | 98,98 | 98,77 |
| b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen | 0,00 | 0,00 |
| c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières | 1,10 | 1,09 |
| d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier | 0,00 | 0,00 |
| e) Autres actifs | 0,00 | 0,00 |

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

| Devise | En montant (EUR) | Pourcentage | |
|------------------|-----------------------|---------------|------------------|
| | | Actif net | Total des actifs |
| Dollar américain | 10 494 051,78 | 1,10 | 1,09 |
| Euro | 945 720 650,00 | 98,98 | 98,77 |
| Total | 956 214 701,78 | 100,08 | 99,86 |

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

| Pays | Pourcentage | |
|--------------|---------------|------------------|
| | Actif net | Total des actifs |
| Irlande | 1,10 | 1,10 |
| Belgique | 1,24 | 1,24 |
| Royaume-Uni | 1,57 | 1,57 |
| Suisse | 1,66 | 1,65 |
| Finlande | 1,71 | 1,71 |
| Italie | 6,09 | 6,08 |
| Espagne | 6,48 | 6,46 |
| Pays-Bas | 17,38 | 17,34 |
| Allemagne | 23,18 | 23,13 |
| France | 39,67 | 39,58 |
| Total | 100,08 | 99,86 |

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

| Secteur économique | Pourcentage | |
|--|-------------|------------------|
| | Actif net | Total des actifs |
| Machinerie-Matériau | 0,41 | 0,41 |
| Activité pétrolière | 0,77 | 0,77 |
| Biens industriels - Constructions et mines | 0,78 | 0,77 |
| Savons et produits de nettoyage | 0,87 | 0,87 |
| Divers Fabrication | 0,89 | 0,89 |
| Conteneurs - Papiers/Plastiques | 0,93 | 0,93 |
| Laboratoires médicaux et services de dépistage | 0,93 | 0,93 |
| Brasserie | 0,94 | 0,94 |
| Secteur automobile - Voitures/camions légers | 0,97 | 0,97 |
| Hôtels et Motels | 1,00 | 1,00 |
| BTP et autres biens d'équipement | 1,06 | 1,06 |
| Services pétroliers | 1,10 | 1,09 |
| Matériaux de construction - Ciment et agrégats | 1,10 | 1,10 |

| Secteur économique | Pourcentage | |
|--|---------------|------------------|
| | Actif net | Total des actifs |
| Produits pharmaceutiques | 1,13 | 1,12 |
| Ingenierie/Transmission/distribution d'electricite | 1,24 | 1,24 |
| Boissons - Vins/Spiritueux | 1,33 | 1,32 |
| Alimentation - Restauration | 1,49 | 1,49 |
| Fils et Cables | 1,51 | 1,51 |
| Eau | 1,61 | 1,60 |
| Chaussures de sport | 1,63 | 1,63 |
| Chimie - Specialite | 1,66 | 1,65 |
| Produits de soin et de beaute | 1,72 | 1,71 |
| Alimentation - detail | 1,73 | 1,73 |
| Composants electroniques - Semi-conducteurs | 1,74 | 1,73 |
| Investissement Immobilier-Centre commerciaux | 1,77 | 1,77 |
| Services de Publicite | 1,77 | 1,77 |
| Alimentation - Produits laitiers | 1,79 | 1,79 |
| Logiciel de conception | 1,85 | 1,84 |
| Re-assurance | 1,95 | 1,95 |
| Chimie - Diversifie | 2,04 | 2,04 |
| BTP - Construction lourde | 2,06 | 2,06 |
| Assurance des biens et des personnes | 2,24 | 2,24 |
| Telephonie - integre | 2,46 | 2,45 |
| Assurance multi-lignes | 2,72 | 2,71 |
| Produits optiques | 2,74 | 2,73 |
| Gaz industriels | 2,87 | 2,86 |
| Services commerciaux | 3,50 | 3,50 |
| Convertisseur de courant/Alimentation | 3,52 | 3,51 |
| Produits manufactures diverses | 3,64 | 3,63 |
| Produits pharmaceutiques et biotechnologie | 4,44 | 4,43 |
| Logiciels d'entreprises/services | 4,66 | 4,65 |
| Electricite - integre | 4,83 | 4,82 |
| Banque commerciale - non US | 5,79 | 5,78 |
| banque - Clientele diverse | 6,14 | 6,13 |
| Produits lies a l'industrie des semi-conducteurs | 8,76 | 8,74 |
| Total | 100,08 | 99,86 |

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

| Nature d'actifs | Pourcentage | |
|---|-------------|------------------|
| | Actif net | Total des actifs |
| Parts d'OPC | 0,00 | 0,00 |
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne | 0,00 | 0,00 |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne | 0,00 | 0,00 |
| Autres OPC et fonds d'investissements | 0,00 | 0,00 |
| Autres actifs | 0,00 | 0,00 |
| Total | 0,00 | 0,00 |

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Eléments du portefeuille titres: | Mouvements (en montant) | |
|---|-------------------------|----------------|
| | Acquisitions | Cessions |
| a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier | 184 029 926,09 | 124 467 682,26 |
| b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen | 0,00 | 0,00 |
| c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières | 0,00 | 14 940 593,88 |
| d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier | 0,00 | 0,00 |
| e) Autres actifs | 62 847 136,90 | 64 536 119,72 |

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Mouvements intervenus au cours de la période | Mouvements (en montant) |
|--|-------------------------|
| Acquisitions | 246 877 062,99 |
| Cessions | 203 944 395,86 |

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

| | Part | Montant net unitaire (€) | Crédit d'impôt | Montant brut unitaire |
|----------------------------|--------------|--------------------------|----------------|-----------------------|
| Dividendes versés | | | | |
| 15/05/2024 | Instit - I/D | 4,78 | 0,48 | 5,26 |
| 15/05/2024 | RD (EUR) | 1,11 | 0 | 1,11 |
| Dividendes à verser | | | | |

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments | Devise | Quantité | Montant | %AN |
|---|--------|--------------|-----------------------|---------------|
| Actions et valeurs assimilées | | | 956 214 701,78 | 100,08 |
| Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | 956 214 701,78 | 100,08 |
| Activite petroliere | | | 7 367 500,00 | 0,77 |
| REPSOL SA COMMON STOCK EUR1. | EUR | 500 000,00 | 7 367 500,00 | 0,77 |
| Alimentation - detail | | | 16 554 000,00 | 1,73 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 600 000,00 | 16 554 000,00 | 1,73 |
| Alimentation - Produits laitiers | | | 17 124 000,00 | 1,79 |
| DANONE COMMON STOCK EUR.25 | EUR | 300 000,00 | 17 124 000,00 | 1,79 |
| Alimentation - Restauration | | | 14 280 000,00 | 1,49 |
| SODEXHO ALLIANCE EUR4 | EUR | 170 000,00 | 14 280 000,00 | 1,49 |
| Assurance des biens et des personnes | | | 21 399 000,00 | 2,24 |
| AXA SA COMMON STOCK EUR2.29 | EUR | 700 000,00 | 21 399 000,00 | 2,24 |
| Assurance multi-lignes | | | 25 950 000,00 | 2,72 |
| ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT) | EUR | 100 000,00 | 25 950 000,00 | 2,72 |
| banque - Clientele diverse | | | 58 670 000,00 | 6,14 |
| BCO SANT CENT HISP EURO.50(REGD) | EUR | 4 000 000,00 | 17 322 000,00 | 1,81 |
| BNP PARIBAS EUR2 | EUR | 400 000,00 | 23 812 000,00 | 2,49 |
| SOC GENERALE EUR1.25 | EUR | 800 000,00 | 17 536 000,00 | 1,84 |
| Banque commerciale - non US | | | 55 313 400,00 | 5,79 |
| ING GROEP NV COMMON STOCK | EUR | 1 200 000,00 | 19 154 400,00 | 2,01 |
| INTESA SANPAOLO | EUR | 7 000 000,00 | 24 297 000,00 | 2,54 |
| KBC GROUP NV COMMON STOCK | EUR | 180 000,00 | 11 862 000,00 | 1,24 |
| Biens industriels - Constructions et mines | | | 7 413 000,00 | 0,78 |
| METSO OYJ COMMON STOCK | EUR | 750 000,00 | 7 413 000,00 | 0,78 |
| Boissons - Vins/Spiritueux | | | 12 670 000,00 | 1,33 |
| PERNOD RICARD NPV | EUR | 100 000,00 | 12 670 000,00 | 1,33 |
| Brasserie | | | 9 030 000,00 | 0,94 |
| HEINEKEN NV EUR1.60 | EUR | 100 000,00 | 9 030 000,00 | 0,94 |
| BTP - Construction lourde | | | 19 676 000,00 | 2,06 |
| VINCI SA COMMON STOCK EUR 2.5 | EUR | 200 000,00 | 19 676 000,00 | 2,06 |
| BTP et autres biens d'equipement | | | 10 166 800,00 | 1,06 |
| CIE DE ST GOBAIN EUR4 | EUR | 140 000,00 | 10 166 800,00 | 1,06 |
| Chaussures de sport | | | 15 610 000,00 | 1,63 |
| ADIDAS AG NPV | EUR | 70 000,00 | 15 610 000,00 | 1,63 |
| Chimie - Diversifie | | | 19 545 000,00 | 2,04 |

| Instruments | Devise | Quantité | Montant | %AN |
|--|--------|--------------|---------------|------|
| ARKEMA EUR10 | EUR | 100 000,00 | 8 115 000,00 | 0,85 |
| SYMRISE AG | EUR | 100 000,00 | 11 430 000,00 | 1,19 |
| Chimie - Specialite | | | 15 840 000,00 | 1,66 |
| DSM FIRMENICH AG COMMON STOCK EUR.01 | EUR | 150 000,00 | 15 840 000,00 | 1,66 |
| Composants electroniques - Semi-conducteurs | | | 16 589 250,00 | 1,74 |
| STMICROELECTRONICS NV COMMON STOCK EUR1.04 | EUR | 450 000,00 | 16 589 250,00 | 1,74 |
| Conteneurs - Papiers/Plastiques | | | 8 928 500,00 | 0,93 |
| STORA ENSO OYJ NPV SER R | EUR | 700 000,00 | 8 928 500,00 | 0,93 |
| Convertisseur de courant/Alimentation | | | 33 645 000,00 | 3,52 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 150 000,00 | 33 645 000,00 | 3,52 |
| Eau | | | 15 356 000,00 | 1,61 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT COMMON STOCK EUR5.0 | EUR | 550 000,00 | 15 356 000,00 | 1,61 |
| Electricite - integre | | | 46 135 000,00 | 4,83 |
| ENEL SPA | EUR | 3 000 000,00 | 19 482 000,00 | 2,04 |
| IBERDROLA SA COMMON STOCK EUR.75 | EUR | 2 200 000,00 | 26 653 000,00 | 2,79 |
| Fils et Cables | | | 14 455 000,00 | 1,51 |
| PRYSMIAN CAB + SYS NPV | EUR | 250 000,00 | 14 455 000,00 | 1,51 |
| Gaz industriels | | | 27 417 600,00 | 2,87 |
| AIR LIQUIDE SA | EUR | 170 000,00 | 27 417 600,00 | 2,87 |
| Hotels et Motels | | | 9 575 000,00 | 1,00 |
| ACCOR EUR3 | EUR | 250 000,00 | 9 575 000,00 | 1,00 |
| Ingenierie/Transmission/distribution d'electricite | | | 11 830 000,00 | 1,24 |
| ARCADIS | EUR | 200 000,00 | 11 830 000,00 | 1,24 |
| Investissement Immobilier-Centre commerciaux | | | 16 909 600,00 | 1,77 |
| UNIBAIL RODAMCO WESTFIELD REIT EUR5.0 | EUR | 230 000,00 | 16 909 600,00 | 1,77 |
| Laboratoires medicaux et services de depistage | | | 8 875 000,00 | 0,93 |
| BIOMERIEUX COMMON STOCK | EUR | 100 000,00 | 8 875 000,00 | 0,93 |
| Logiciel de conception | | | 17 650 000,00 | 1,85 |
| DASSAULT SYSTEMES COMMON STOCK | EUR | 500 000,00 | 17 650 000,00 | 1,85 |
| Logiciels d'entreprises/services | | | 44 537 200,00 | 4,66 |
| SAP SE | EUR | 235 000,00 | 44 537 200,00 | 4,66 |
| Machinerie-Matériau | | | 3 909 000,00 | 0,41 |
| KION GROUP AG COMMON STOCK | EUR | 100 000,00 | 3 909 000,00 | 0,41 |
| Materiaux de construction - Ciment et agregats | | | 10 494 051,78 | 1,10 |
| CRH PLC COMMON STOCK EUR.32 | USD | 150 000,00 | 10 494 051,78 | 1,10 |
| Divers Fabrication | | | 8 556 000,00 | 0,89 |
| KNORR BREMSE AG COMMON STOCK | EUR | 120 000,00 | 8 556 000,00 | 0,89 |

| Instruments | Devise | Quantité | Montant | %AN |
|--|--------|--------------|-----------------------|---------------|
| Produits de soin et de beauté | | | 16 402 000,00 | 1,72 |
| L OREAL COMMON STOCK EUR.2 | EUR | 40 000,00 | 16 402 000,00 | 1,72 |
| Produits liés à l'industrie des semi-conducteurs | | | 83 658 400,00 | 8,76 |
| ASM INTL NLG0.01 | EUR | 20 000,00 | 14 236 000,00 | 1,49 |
| ASML HOLDING NV ORDSHS COMMON STOCK | EUR | 72 000,00 | 69 422 400,00 | 7,27 |
| Produits manufacturés diverses | | | 34 744 000,00 | 3,64 |
| SIEMENS AG NPV (REGD) | EUR | 200 000,00 | 34 744 000,00 | 3,64 |
| Produits optiques | | | 26 156 000,00 | 2,74 |
| ESSILORLUXOTTICA | EUR | 130 000,00 | 26 156 000,00 | 2,74 |
| Produits pharmaceutiques | | | 10 760 000,00 | 1,13 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG COMMON STOCK | EUR | 200 000,00 | 10 760 000,00 | 1,13 |
| Produits pharmaceutiques et biotechnologie | | | 42 457 000,00 | 4,44 |
| MERCK KGAA ORD NPV | EUR | 100 000,00 | 15 475 000,00 | 1,62 |
| SANOFI COMMON STOCK EUR2.0 | EUR | 300 000,00 | 26 982 000,00 | 2,82 |
| Re-assurance | | | 18 680 000,00 | 1,95 |
| MUENCHENER RUCKVERS AG NPV(REGD) | EUR | 40 000,00 | 18 680 000,00 | 1,95 |
| Savons et produits de nettoyage | | | 8 322 000,00 | 0,87 |
| HENKEL AG CO KGAA VORZUG PREFERENCE | EUR | 100 000,00 | 8 322 000,00 | 0,87 |
| Secteur automobile - Voitures/camions légers | | | 9 238 000,00 | 0,97 |
| STELLANTIS NV COMMON STOCK EUR.01 | EUR | 500 000,00 | 9 238 000,00 | 0,97 |
| Services commerciaux | | | 33 481 800,00 | 3,50 |
| AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 170 000,00 | 10 563 800,00 | 1,11 |
| EDENRED | EUR | 200 000,00 | 7 882 000,00 | 0,82 |
| RELX PLC COMMON STOCK GBP.00144397 | EUR | 350 000,00 | 15 036 000,00 | 1,57 |
| Services de Publicité | | | 16 894 600,00 | 1,77 |
| PUBLICIS GROUPE SA EUR0.40 | EUR | 170 000,00 | 16 894 600,00 | 1,77 |
| Services pétroliers | | | 10 470 000,00 | 1,10 |
| TECHNIP ENERGIES NV COM- MON STOCK EUR.01 | EUR | 500 000,00 | 10 470 000,00 | 1,10 |
| Telephonie - integre | | | 23 480 000,00 | 2,46 |
| DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD) | EUR | 1 000 000,00 | 23 480 000,00 | 2,46 |
| Total | | | 956 214 701,78 | 100,08 |

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

| Libellé instrument | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) | | | |
|--------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| | Actif | Passif | Devises à recevoir (+) | | Devises à livrer (-) | |
| | | | Devise | Montant (*) | Devise | Montant (*) |
| Total | 0,00 | 0,00 | | 0,00 | | 0,00 |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

| Libellé instrument | Instruments financiers à terme – actions | | | Montant de l'exposition (*) +/- |
|---------------------------|--|------------------------------------|--------|------------------------------------|
| | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | |
| | | Actif | Passif | |
| Futures | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Options | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Swaps | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Autres instruments | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

| Libellé instrument | Instruments financiers à terme – taux d'intérêts | | | Montant de l'exposition (*) +/- |
|---------------------------|--|------------------------------------|--------|------------------------------------|
| | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | |
| | | Actif | Passif | |
| Futures | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Options | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Swaps | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Autres instruments | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

| Instruments financiers à terme – de change | | | | |
|--|------------------|------------------------------------|-------------|------------------------------------|
| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) +/- |
| | | Actif | Passif | |
| Futures | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Options | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Swaps | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Autres instruments | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

| Instruments financiers à terme – sur risque de crédit | | | | |
|---|------------------|------------------------------------|-------------|------------------------------------|
| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) +/- |
| | | Actif | Passif | |
| Futures | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Options | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Swaps | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Autres instruments | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

| Instruments financiers à terme – autres expositions | | | | |
|---|------------------|------------------------------------|--------|------------------------------------|
| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) +/- |
| | | Actif | Passif | |
| Futures | | | | |

| Instruments financiers à terme – autres expositions | | | | | |
|---|------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|--|
| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) | |
| | | Actif | Passif | +/- | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Options | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Swaps | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Autres instruments | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

| Libellé instrument | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) | | | | Classe de part couverte |
|-----------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|------------------|----------------------|-------------------|-------------------------|
| | Actif | Passif | Devises à recevoir (+) | | Devises à livrer (-) | | |
| | | | Devise | Montant (*) | Devise | Montant (*) | |
| A USD/EUR 15/08/24 | 0,62 | 0,00 | USD | 90,14 | EUR | -89,33 | FR0013479367 |
| A USD/EUR 15/08/24 | 70,40 | 0,00 | USD | 14 617,94 | EUR | -14 516,87 | FR0013479367 |
| Total | 71,02 | 0,00 | | 14 708,08 | | -14 606,20 | |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) | Classe de part couverte |
|--------------------|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------------------|
| | | Actif | Passif | | |
| Futures | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Options | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Swaps | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Autres instruments | | | | | |
| Sous total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |

| Libellé instrument | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan | | Montant de l'exposition (*) | Classe de part couverte |
|--------------------|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------------------|
| | | Actif | Passif | | |
| Total | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

| | Valeur actuelle présentée au bilan |
|---|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT) | 956 214 701,78 |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises): | |
| Total opérations à terme de devises | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - actions | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - taux | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - change | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - crédit | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions | 0,00 |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises | 71,02 |
| Autres actifs (+) | 1 303 771,03 |
| Autres passifs (-) | -2 047 172,95 |
| Passifs de financement (-) | - |
| Total = actif net | 955 471 370,88 |

COMMISSION DE PERFORMANCE

| | |
|---|-------------------|
| Instit - I/C | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| Instit - I/D | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| RC (H2-USD) HEDGE | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| RC (USD) | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| RD (EUR) | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| Retail - MC | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| Retail - R/C | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |
| Retail - W/C | 28/06/2024 |
| Commission de performance (frais variables) | 0,00 |
| Pourcentage de commission de performance | 0,00 |

SFTR

Au cours de la période de référence, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

NOTE À L'INTENTION DES INVESTISSEURS SUISSES (NON AUDITÉE)

1. Représentant et Agent payeur pour la Suisse

Le représentant et l'agent payeur en Suisse est BNP Paribas, Paris, Zurich Branch, Selnaustrasse 16, 8002 Zurich, Suisse.

2. Lieu d'obtention des documents pertinents

Le Prospectus, les Documents d'Information Clés pour l'Investisseur, les Statuts, la liste des mouvements intervenus dans les portefeuilles, ainsi que les rapports annuels et semestriels de la Société peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant en Suisse.

3. Publications

Les publications de la Société en Suisse sont effectuées sur le site www.fundinfo.com.

Les prix d'émission et de rachat des Actions de chacun des compartiments, respectivement la valeur liquidative des Actions de chacun des compartiments (ainsi que la mention « à l'exception des commissions ») sont publiés conjointement et sur une base quotidienne sur le site www.fundinfo.com.

4. Lieu d'exécution et de juridiction

Le lieu d'exécution et la juridiction associés aux Actions des Compartiments de la Société offertes ou distribuées en ou depuis la Suisse sont situés au siège du représentant Suisse.

| Dénomination du Fonds | Catégorie | FC/SFC* | (Synthétique) Frais Courants hors/crcommission de performance en % | Commission de performance en/cr% | (Synthétique) Frais Courants, y compris/crcommission de performance en % |
|--------------------------|-------------|---------|--|----------------------------------|--|
| ALLIANZ VALEURS DURABLES | IC (EUR) | FC | 0,70 | - | 0,70 |
| | ID (EUR) | FC | 0,70 | - | 0,70 |
| | MC (EUR) | FC | 0,80 | - | 0,80 |
| | RC (EUR) | FC | 1,79 | - | 1,79 |
| | RC (H2-USD) | FC | 1,79 | - | 1,79 |
| | RC (USD) | FC | 1,79 | - | 1,79 |
| | RD (EUR) | FC | 1,79 | - | 1,79 |
| | WC (EUR) | FC | 0,58 | - | 0,58 |

*FC: Frais Courants, SFC: Synthétique Frais Courants

PERFORMANCE DU FONDS

| | | Catégorie IC (EUR) (capitalisation) %* | Catégorie ID (EUR) (capitalisation) %* | Catégorie MC (EUR) (capitalisation) %* | Catégorie RC (EUR) (capitalisation) %* | Catégorie RC (USD) (capitalisation) %* | Catégorie RC (H2-USD) (capitalisation) %* | Catégorie RD (EUR) (capitalisation) %* | Catégorie WC (EUR) (capitalisation) %* |
|---------------------------|-------------------------|---|---|---|---|---|--|---|---|
| Exercice financier actuel | (31.12.2023-28.06.2024) | 9,43 | 9,43 | 9,38 | 8,84 | 5,61 | 9,63 | 8,84 | - |
| 1 an | (31.12.2022-31.12.2023) | 17,91 | 17,92 | 17,79 | 16,63 | 20,68 | 20,24 | 16,64 | 18,05 |
| 2 ans | (31.12.2021-31.12.2023) | 2,10 | 2,11 | 1,46 | -0,34 | -2,98 | 2,11 | - | 2,34 |
| 3 ans | (31.12.2020-31.12.2023) | 25,57 | 25,59 | 24,67 | 21,24 | 9,69 | 24,95 | - | 26,02 |
| 5 ans | (31.12.2018-31.12.2023) | 63,00 | 63,02 | 61,52 | 53,98 | - | - | - | 63,99 |
| 10 ans | (31.12.2013-31.12.2023) | 95,49 | 95,51 | - | 74,84 | - | - | - | - |
| depuis le lancement | (12.06.2002-31.12.2023) | 210,21 | - | - | - | - | - | - | - |
| | (19.01.2012-31.12.2023) | - | 168,79 | - | - | - | - | - | - |
| | (16.10.2017-31.12.2023) | - | - | 39,53 | - | - | - | - | - |
| | (12.06.2002-31.12.2023) | - | - | - | 144,62 | - | - | - | - |
| | (03.06.2020-31.12.2023) | - | - | - | - | 34,43 | - | - | - |
| | (03.06.2020-31.12.2023) | - | - | - | - | - | 43,03 | - | - |
| | (18.01.2022-31.12.2023) | - | - | - | - | - | - | 0,94 | - |
| | (09.11.2017-31.12.2023) | - | - | - | - | - | - | - | 42,45 |

*Base de calcul : valeur par part (hors droits d'entrée), distributions réinvesties. Calcul conforme à la méthode du BVI.

La performance historique ne constitue pas un indicateur de la performance courante ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais éventuellement prélevés lors de l'émission et du rachat des parts.

COMPTE DE RÉSULTAT EN EUR

| | 28.06.2024 | 29.12.2023 |
|---|----------------------|-------------|
| Revenus financiers nets | | |
| Produits sur opérations financières | | |
| Produits sur actions | 20 413 520,54 | 0,00 |
| Produits sur obligations | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur titres de créance | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur des parts d'OPC * | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur instruments financiers à terme | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur opérations temporaires sur titres | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur prêts et créances | 0,00 | 0,00 |
| Produits sur autres actifs et passifs éligibles | 0,00 | 0,00 |
| Autres produits financiers | 1 454,77 | 0,00 |
| Sous-total Produits sur opérations financières | 20 414 975,31 | 0,00 |
| Charges sur opérations financières | | |
| Charges sur opérations financières | 0,00 | 0,00 |
| Charges sur instruments financiers à terme | 0,00 | 0,00 |
| Charges sur opérations temporaires sur titres | 0,00 | 0,00 |
| Charges sur emprunts | 0,00 | 0,00 |
| Charges sur autres actifs et passifs éligibles | 0,00 | 0,00 |
| Autres charges financières | -7 071,86 | 0,00 |
| Sous-total charges sur opérations financières | -7 071,86 | 0,00 |
| Total Revenus financiers nets (A) | 20 407 903,45 | 0,00 |
| Autres produits: | | |
| Rétrocession des frais de gestion au bénéfice de l'OPC | 0,00 | 0,00 |
| Versements en garantie de capital ou de performance | 0,00 | 0,00 |
| Autres produits | 0,00 | 0,00 |
| Autres charges: | | |
| Frais de gestion de la société de gestion | -5 679 432,40 | 0,00 |
| Frais d'audit, d'études des fonds de capital investissement | 0,00 | 0,00 |
| Impôts et taxes | 0,00 | 0,00 |
| Autres charges | 0,00 | 0,00 |
| Sous-total Autres produits et Autres charges (B) | -5 679 432,40 | 0,00 |
| Sous total revenus nets avant compte de régularisation C = A + B | 14 728 471,05 | 0,00 |
| Régularisation des revenus nets de l'exercice (D) | 589 168,51 | 0,00 |
| Revenus nets I = C + D | 15 317 639,56 | 0,00 |
| Plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations: | | |
| Plus et moins-values réalisées | 23 102 199,85 | 0,00 |
| Frais de transactions externes et frais de cession | -351 178,87 | 0,00 |
| Frais de recherche | 0,00 | 0,00 |
| Quote-part des plus-values réalisées restituées aux assureurs | 0,00 | 0,00 |
| Indemnités d'assurance perçues | 0,00 | 0,00 |

| | 28.06.2024 | 29.12.2023 |
|--|----------------------|-------------|
| Versements en garantie de capital ou de performance reçus | 0,00 | 0,00 |
| Sous total plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations E | 22 751 020,98 | 0,00 |
| Régularisations des plus ou moins-values réalisées nettes F | 775 099,35 | 0,00 |
| Plus ou moins-values réalisées nettes II = E + F | 23 526 120,33 | 0,00 |
| Plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisations: | | |
| Variation des plus ou moins-values latentes yc les écarts de change sur les actifs éligibles | 39 252 750,95 | 0,00 |
| Écarts de change sur les comptes financiers en devises | 33,14 | 0,00 |
| Versements en garantie de capital ou de performance à recevoir | 0,00 | 0,00 |
| Quote-part des plus-values latentes à restituer aux assureurs | 0,00 | 0,00 |
| Sous total plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisation G | 39 252 784,09 | 0,00 |
| Régularisations des plus ou moins-values latentes nettes H | 2 105 545,59 | 0,00 |
| Plus ou moins-values latentes nettes III = G + H | 41 358 329,68 | 0,00 |
| Acomptes: | | |
| Acomptes sur revenus nets versés au titre de l'exercice J | 0,00 | 0,00 |
| Acomptes sur plus ou moins-values réalisées nettes versés au titre de l'exercice K | 0,00 | 0,00 |
| Total acomptes versés au titre de l'exercice IV = J + K | 0,00 | 0,00 |
| Résultat net = I + II + III - IV | 80 202 089,57 | 0,00 |