Allianz Global Investors Fund - Allianz Volatility Strategy Fund AT EUR Cap

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

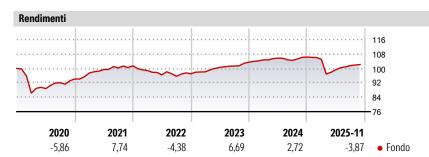
Benchmark Dichiarato Euro Short Term Rate Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The fund seeks long-term capital growth by exploiting return opportunities in the volatility space based on the volatility risk premium through investments in a broad range of asset classes. In addition, the Sub-Fund will use volatility related derivatives including, but not limited to, variance swaps, options and volatility swaps related to different asset classes. The Sub-Fund's core strategy uses variance swaps on equity markets of the US and Europe as underlying.

Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,25
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,08
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,38	Trimestrali %				
6-Mesi	5,06	2025	-1,19	-5,48	2,30	-
1-Anno	-3,09	2024	1,21	0,94	-1,19	1,76
3-Anni Ann.ti	2,10	2023	1,12	2,54	0,72	2,16
5-Anni Ann.ti	1,99	2022	-2,56	-2,42	-0,85	1,43
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 17/12/2025	1,00	2021	3,50	2,00	0,92	1,13

Portafoglio 31/10/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Spain (Kingdom of) 2.8%	-	4,46
Spain (Kingdom of) 1.5%	_	4,39
Germany (Federal Republic	_	4,33
Put On S&P 500 Nov25	_	3,22
Agence Française De	-	3,17
Japan Finance Organization	_	3,12
The Toronto-Dominion Bank	_	2,70
National Australia Bank Ltd	_	2,11
Latvia (Republic Of) 3.5%	_	1,81
Development Bank of Japan	-	1,72
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		31,02
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	1
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	rionari	326

₩ Governativo	45,23
Societario	1,56
☆ Cartolarizzazioni	38,26
🔀 Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	14,95
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	5,47
Da 0 a 4 cedole	93,28
Da 4 a 6 cedole	1,25
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	99,61
Stati Uniti	99,61
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	0,39
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,12
Europa Occidentale - Non Eu	ro 0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica	
Società di Gestione	Allianz Global Investors
	GmbH
Telefono	+49 (0) 69 2443-1140
Web	www.allianzglobalinvestor
	s.de
Data di Partenza	29/06/2017
Nome del Gestore	Mikhail Krayzler
Data Inizio Gestione	01/07/2018
NAV (17/12/2025)	EUR 104,61
Patrimonio Netto (MIn)	429,97 EUR
(31/10/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	14,28 EUR
Domicilio Valuta del Fondo UCITS Inc/Acc	LUSSEMBURGO EUR Si Acc
ISIN	LU1602092592

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,25%
Spese correnti	1,30%
Commissione di incentivo	-