

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

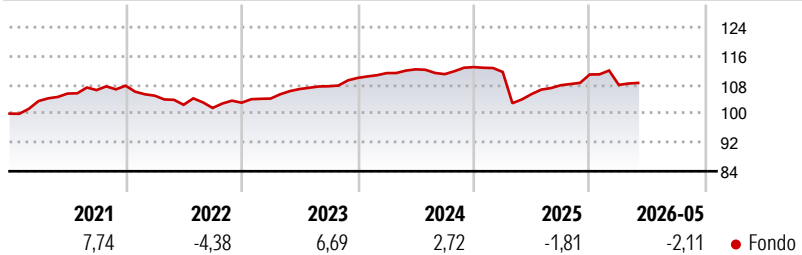
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	-0,36
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,58
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,78
6-Mesi	-1,85
1-Anno	3,21
3-Anni Ann.ti	0,60
5-Anni Ann.ti	0,60
10-Anni Ann.ti	0,70

Rendimenti aggiornati al 29/06/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-2,62	-	-	-
2025	-1,19	-5,48	2,30	2,78
2024	1,21	0,94	-1,19	1,76
2023	1,12	2,54	0,72	2,16
2022	-2,56	-2,42	-0,85	1,43

Portafoglio 31/05/2026



Asset Allocation %

Azioni	-0,62
Obbligazioni	69,75
Liquidità	30,68
Altro	0,19

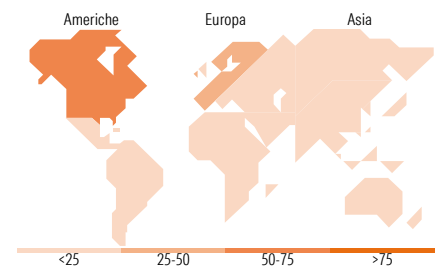
Fixed Income Style

Box™

Alto			
Med			
Basso			
	Bassa	Med	Alta
	Sensibilità ai Tassi		

Fondo

- Duration Effettiva -
- Maturità effettiva -
- Qualità Credito Media



Titoli principali

Nome	Settore	%
France (Republic Of) 0%	-	6,95
Belgium (Kingdom Of) 0%	-	6,95
The Toronto-Dominion Bank...	-	3,67
National Australia Bank Ltd...	-	3,44
Deutsche Pfandbriefbank AG...	-	3,23
Development Bank of Japan...	-	2,84
Netherlands (Kingdom Of) 0%	-	2,77
Japan Finance Organization...	-	2,65
European Union 0%	-	2,43
Agence Francaise De...	-	2,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		37,08
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		157

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	47,74
Societario	3,13
Cartolarizzazioni	32,41
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	16,71
Derivati	0,00
Coupon Range %	
0 coupon	18,97
Da 0 a 4 cedole	78,42
Da 4 a 6 cedole	2,61
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 %

Regione	Fondo
America	65,94
Stati Uniti	65,94
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	34,00
Regno Unito	0,02
Europa Occidentale - Euro	33,38
Europa Occidentale - Non Euro	0,60
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,06
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,06

Anagrafica

Società di Gestione	Allianz Global Investors GmbH	Patrimonio Classe (Mln)	1,11 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+49 (0) 69 2443-1140	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.allianzglobalinvestor.s.de	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,25%
Data di Partenza	29/06/2017	UCITS	Si	Spese correnti	1,30%
Nome del Gestore	Mikhail Krayzler	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2018	ISIN	LU1602092592		
NAV (29/06/2026)	EUR 103,49				
Patrimonio Netto (Mln)	257,11 EUR				

(31/05/2026)

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società produttrici; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.