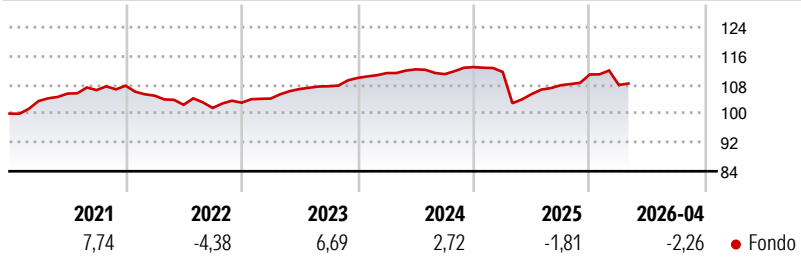
Allianz Global Investors Fund - Allianz Volatility Strategy Fund AT EUR Cap

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Volatilità	Not Categorized Usato nel Report	Euro Short Term Rate	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.

Rendimenti



2021	2022	2023	2024	2025	2026-04	
7,74	-4,38	6,69	2,72	-1,81	-2,26	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,33
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,60
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	-2,30
6-Mesi	0,48
1-Anno	4,52
3-Anni Ann.ti	0,74
5-Anni Ann.ti	0,96
10-Anni Ann.ti	0,63

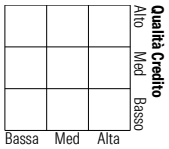
Rendimenti aggiornati al 15/05/2026

Rendimenti Trimestrali %	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

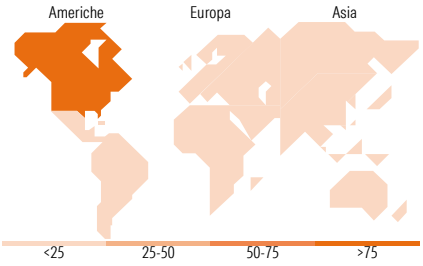
Portafoglio 31/03/2026

Asset Allocation %	Netta
Azioni	-3,61
Obbligazioni	66,98
Liquidità	35,82
Altro	0,81

Fixed Income Style Box™



Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Spain (Kingdom of) 2.8%	—	7,53
Put On S&P 500 Mar26	—	5,78
France (Republic Of) 0%	—	5,38
Belgium (Kingdom Of) 0%	—	5,38
Netherlands (Kingdom Of) 0%	—	5,37
Put On S&P 500 Mar26	—	3,95
The Toronto-Dominion Bank...	—	3,78
National Australia Bank Ltd....	—	3,52
Deutsche Pfandbriefbank AG...	—	3,30
Development Bank of Japan...	—	2,90
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		46,88
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		159

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	45,59
Societario	3,13
Cartolarizzazioni	35,95
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	15,33
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	4,76
Da 0 a 4 cedole	92,48
Da 4 a 6 cedole	2,76
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	**98,13**
Stati Uniti	98,13
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**1,76**
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	1,44
Europa Occidentale - Non Euro	0,29
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,11**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Allianz Global Investors GmbH
Telefono	+49 (0) 69 2443-1140
Web	www.allianzglobalinvestors.de
Data di Partenza	29/06/2017
Nome del Gestore	Mikhail Krayzler
Data Inizio Gestione	01/07/2018
NAV (15/05/2026)	EUR 103,17
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	279,26 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (15/05/2026)	1,18 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1602092592
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,25%
Spese correnti	1,30%
Commissione di incentivo	-

© 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 prodotto; (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.

MORNINGSTAR