

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.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	-0,13
3Y Beta	- 3Y Std Dev	5,17
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,79	-	-	-	-
6-Mesi	4,22	2026	-	-	-
1-Anno	-1,68	2025	-1,19	-5,48	2,30
3-Anni Ann.ti	2,19	2024	1,21	0,94	-1,19
5-Anni Ann.ti	1,75	2023	1,12	2,54	0,72
10-Anni Ann.ti	1,13	2022	-2,56	-2,42	-0,85

Rendimenti aggiornati al 19/02/2026

Portafoglio 31/01/2026



Asset Allocation %

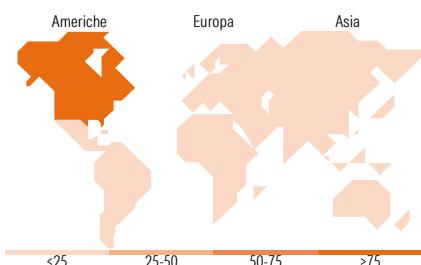
• Azioni	-9,23
• Obbligazioni	93,88
• Liquidità	14,93
• Altro	0,43

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Spain (Kingdom of) 2.8%	—	8,18
The Toronto-Dominion Bank...	—	4,13
Spain (Kingdom of) 1.5%	—	4,12
National Australia Bank Ltd....	—	3,86
Germany (Federal Republic...	—	3,17
Put On S&P 500 Jan26	—	3,17
Development Bank of Japan...	—	3,15
Japan Finance Organization...	—	2,96
European Union 0%	—	2,70
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	35,43	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	196	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo
Governativo
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

Ripartizione Geografica %

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

Anagrafica

Società di Gestione	Allianz Global Investors GmbH	Patrimonio Classe (Mln) (19/02/2026)	1,41 EUR	Investimento Min. Ingresso
Telefono	+49 (0) 69 2443-1140	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo
Web	www.allianzglobalinvestor	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.
	s.de	UCITS	Si	Spese correnti
Data di Partenza	29/06/2017	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	Mikhail Krayzler	ISIN		
Data Inizio Gestione	01/07/2018			
NAV (19/02/2026)	EUR 105,84			
Patrimonio Netto (Mln)	255,92 EUR			
(31/01/2026)				