

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

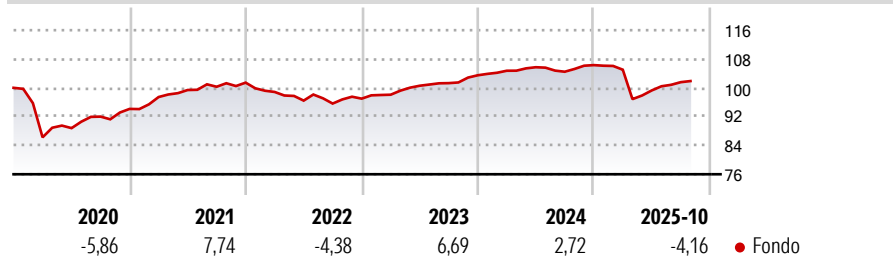
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	-0,21
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,09
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

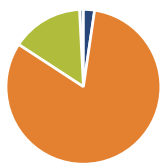
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,45	2025	-1,19	-5,48	2,30	-
6-Mesi	5,19	2024	1,21	0,94	-1,19	1,76
1-Anno	-3,18	2023	1,12	2,54	0,72	2,16
3-Anni Ann.ti	1,73	2022	-2,56	-2,42	-0,85	1,43
5-Anni Ann.ti	2,23	2021	3,50	2,00	0,92	1,13
10-Anni Ann.ti	0,77					

Rendimenti aggiornati al 31/10/2025

Portafoglio 30/09/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	-2,43
Obbligazioni	85,87
Liquidità	15,70
Altro	0,86

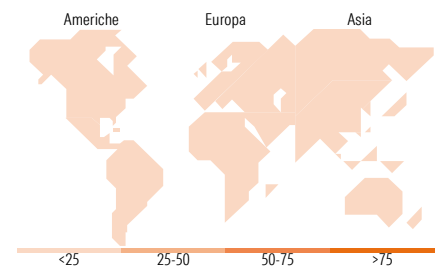
Fixed Income Style

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Qualità Credito		
Alto	Med	Basso
Bassa	Med	Alta

Sensibilità ai Tassi

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Spain (Kingdom of) 2.8%	—	4,13
Spain (Kingdom of) 1.5%	—	4,06
Germany (Federal Republic...)	—	4,01
European Stability Mechanism...	—	2,98
Agence Francaise De...	—	2,93
The Toronto-Dominion Bank...	—	2,50
Spain (Kingdom of) 2.4%	—	2,21
National Australia Bank Ltd...	—	1,95
Netherlands (Kingdom Of) 0%	—	1,94
Slovak (Republic of) 4.35%	—	1,87
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		28,57
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		173

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Fondo
Governativo	47,40
Societario	1,18
Cartolarizzazioni	37,33
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	14,09
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	4,61
Da 0 a 4 cedole	93,31
Da 4 a 6 cedole	2,08
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	Fondo
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Allianz Global Investors GmbH	Patrimonio Classe (Mln)	44,57 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+49 (0) 69 2443-1140	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.allianzglobalinvestor.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 (31/10/2025)	EUR 102,99				
Patrimonio Netto (Mln)	503,00 EUR				

(30/09/2025)