

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	-0,07
3Y Beta	- 3Y Std Dev	5,19
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Fondo	Rendimenti Trimestrali %
3-Mesi	2026
6-Mesi	2025
1-Anno	2024
3-Anni Ann.ti	2023
5-Anni Ann.ti	2022
10-Anni Ann.ti	

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

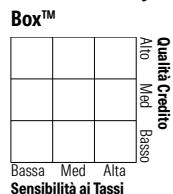
Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %

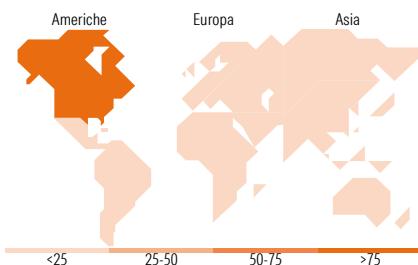
Azioni	-1,25
Obbligazioni	96,08
Liquidità	5,07
Altro	0,10

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Spain (Kingdom of) 2.8%	—	5,23
Spain (Kingdom of) 1.5%	—	5,14
Germany (Federal Republic...	—	5,07
Agence Francaise De...	—	3,70
Japan Finance Organization...	—	3,66
The Toronto-Dominion Bank...	—	3,14
National Australia Bank Ltd....	—	2,47
Latvia (Republic Of) 3.5%	—	2,11
Development Bank of Japan...	—	2,02
Deutsche Pfandbriefbank AG...	—	1,99
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	34,54	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	8	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	362	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	
Governativo	51,50
Societario	2,84
Cartolarizzazioni	40,64
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	5,01
Derivati	0,00

Coupon Range %

Fondo	
0 coupon	4,91
Da 0 a 4 cedole	93,74
Da 4 a 6 cedole	1,35
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	85,85
Stati Uniti	85,85
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	14,15
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	13,92
Europa Occidentale - Non Euro	0,21
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 - Emergenti	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Allianz Global Investors GmbH	Patrimonio Classe (Mln) (30/01/2026)	1,51 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	LU1602092592	
Data Inizio Gestione	01/07/2018			
NAV (30/01/2026)	EUR 105,54			
Patrimonio Netto (Mln)	390,69 EUR			
(30/11/2025)				