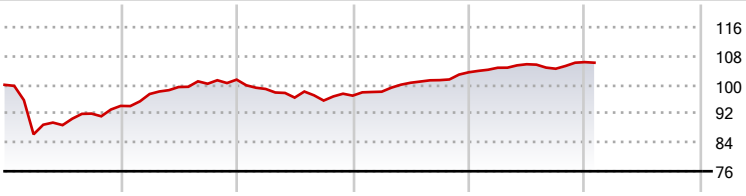
Allianz Global Investors Fund - Allianz Volatility Strategy Fund AT EUR Cap

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

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01
-5,86	7,74	-4,38	6,69	2,72	-0,16

● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,11
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,60
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	1,01
6-Mesi	0,49
1-Anno	1,98
3-Anni Ann.ti	1,85
5-Anni Ann.ti	1,26
10-Anni Ann.ti	1,26

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

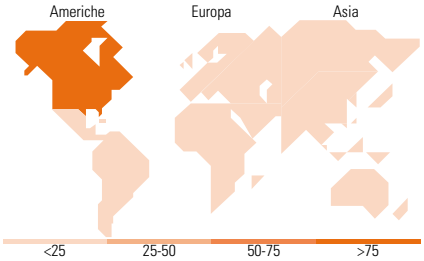
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	1,21	0,94	-1,19	1,76
2023	1,12	2,54	0,72	2,16
2022	-2,56	-2,42	-0,85	1,43
2021	3,50	2,00	0,92	1,13

Portafoglio 31/12/2024

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	-4,91
● Obbligazioni	71,32
● Liquidità	33,28
● Altro	0,32

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Put On S&P 500 Dec24	—	9,50
France (Republic Of) 2.5%	—	4,62
Spain (Kingdom of) 2.8%	—	3,63
Germany (Federal Republic...	—	3,53
Spain (Kingdom of) 0%	—	3,19
Spain (Kingdom of) 2.5%	—	3,17
France (Republic Of) 0%	—	2,58
Belgium (Kingdom Of) 0%	—	2,58
Spain (Kingdom of) 1.5%	—	2,57
France (Republic Of) 0%	—	2,22
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		37,58
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		91

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	50,46
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	27,67
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	21,88
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	14,01
Da 0 a 4 cedole	85,99
Da 4 a 6 cedole	0,00
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	**99,44**
Stati Uniti	99,44
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**0,52**
Regno Unito	0,09
Europa Occidentale - Euro	0,16
Europa Occidentale - Non Euro	0,27
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,04**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,04
Asia - Emergente	0,00

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 (04/02/2025)	EUR 107,01
Patrimonio Netto (Mln)	579,93 EUR
(31/12/2024)	

Patrimonio Classe (Mln)	15,44 EUR
(04/02/2025)	
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	1,29%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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.