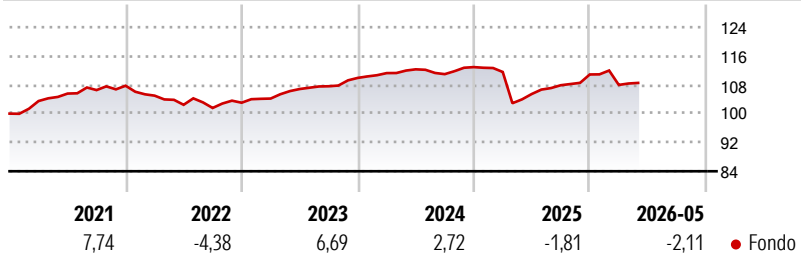
Allianz Global Investors Fund - Allianz Volatility Strategy Fund AT EUR Cap

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	2026-05	
7,74	-4,38	6,69	2,72	-1,81	-2,11	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,36
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,58
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,54
6-Mesi	-1,68
1-Anno	3,09
3-Anni Ann.ti	0,58
5-Anni Ann.ti	0,61
10-Anni Ann.ti	0,63

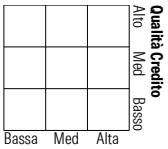
Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

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

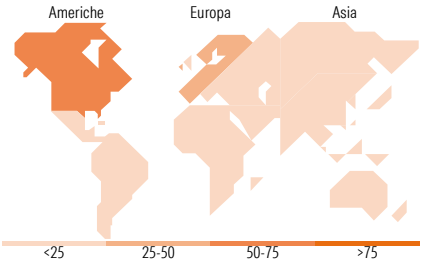
Portafoglio 31/05/2026

Asset Allocation %	Netta
Azioni	-0,62
Obbligazioni	69,75
Liquidità	30,68
Altro	0,19

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
France (Republic Of) 0%	—	6,95
Belgium (Kingdom Of) 0%	—	6,95
The Toronto-Dominion Bank...	—	3,67
National Australia Bank Ltd....	—	3,44
Deutsche Pfandbriefbank AG...	—	3,23
Development Bank of Japan...	—	2,84
Netherlands (Kingdom Of) 0%	—	2,77
Japan Finance Organization...	—	2,65
European Union 0%	—	2,43
Agence Francaise De...	—	2,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		37,08
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		157

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	47,74
Societario	3,13
Cartolarizzazioni	32,41
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	16,71
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	18,97
Da 0 a 4 cedole	78,42
Da 4 a 6 cedole	2,61
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	**65,94**
Stati Uniti	65,94
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**34,00**
Regno Unito	0,02
Europa Occidentale - Euro	33,38
Europa Occidentale - Non Euro	0,60
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,06**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,06

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 (26/06/2026)	EUR 103,30
Patrimonio Netto (Mln) (31/05/2026)	257,11 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (26/06/2026)	1,11 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	-

See disclosures for more details

© 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