

Allianz Volatility Strategy Fund - A - EUR (LU0417273140)

KAG: Allianz GI Investors

ISIN: LU0417273140

Rücknahmepreis: 107,05 EUR

Stand: 02.12.2024

| | |
|--|------------------|
| Auflagedatum | 07.06.22 |
| Ausgabeaufschlag | 6,00% |
| Konditionsdetails auf www.bawag.at | |
| Fondsvolumen | 587.42 Mio. |
| Ertragstyp | ausschüttend |
| Letzte Ausschüttung | keine |
| Anlageregion | weltweit |
| Fondstyp | AI Volatility |
| Fondsmanager | Mikhail Krayzler |



| | |
|---|--|
| Kapitalanlagegesellschaft | |
| Allianz GI Investors | |
| Bockenheimer Landstraße 42-44 | |
| 60323 Frankfurt am Main | |
| Deutschland | |
| https://www.allianzgi.com | |

| Wertentwicklung* | | 1J | 3J p.a. | 5J p.a. |
|---------------------------|--|-----------|----------------|----------------|
| Performance vor AGA | | +3,19% | - | - |
| Performance nach max. AGA | | -2,65% | - | - |
| Kennzahlen* | | 1J | 3J | 5J |
| Sharpe Ratio | | 0,09 | - | - |
| Volatilität | | +3,02% | - | - |

* Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Fondsstrategie

Langfristiges Kapitalwachstum durch Ausnutzung von Renditechancen im Bereich der Volatilität auf der Grundlage von Volatilitätsrisikoprämien durch Anlagen in eine breite Palette von Anlageklassen. Darüber hinaus nutzt der Teilfonds volatilitätsbezogene Derivate, insbesondere Varianz-Swaps, Optionen und Volatilitätsswaps, die sich auf verschiedene Anlageklassen beziehen.

Das Teilfondsvermögen wird in Anleihen mit einem Mindestrating von B- der OECD-, EWR- und/oder EU-Mitgliedstaaten und/oder in globale Aktienmärkte investiert. Die Kernstrategie des Teilfonds verwendet volatilitätsbezogene Derivate, z. B. Varianz-Swaps auf den globalen Aktienmärkten (z. B. USamerikanische und europäische Aktienmärkte als Basiswert). Diese Swaps können sich in Bezug auf die Swap-Periode, die zugrunde liegende Sicherheit und Abweichungen im Ausübungspreis unterscheiden. Ein Varianz-Swap führt zu einem finanziellen Ausgleich zwischen den Parteien am Ende der Swap-Periode. Der Wert eines Varianz-Swaps hängt nicht 1:1 von der absoluten Wertentwicklung des zugrunde liegenden Basiswerts ab, sondern insbesondere von der Veränderung der annualisierten realisierten Varianz des jeweiligen Basiswerts in der jeweiligen Swap-Periode. Aus diesem Grund kann der Wert eines Varianz-Swaps sogar steigen, wenn der Wert seines Basiswerts sinkt, oder kann entsprechend fallen, wenn der Wert seines Basiswerts steigt. Je nachdem, wie der Varianz-Swap strukturiert ist, kann der aus dem Varianz-Swap resultierende potenzielle Verlust des Teilfonds auch automatisch durch das Portfoliomanagement begrenzt werden.

Kommentar:

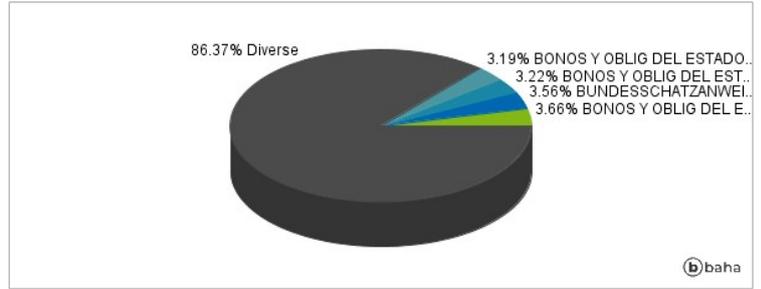
Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Allianz Volatility Strategy Fund - A - EUR wurden durch die FMA bewilligt. Der Allianz Volatility Strategy Fund - A - EUR kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: die von der Europäischen Union, der Europäischen Zentralbank, einem Mitgliedstaat der EU oder seinen Gebietskörperschaften, von einem OECD-Mitgliedstaat oder von internationalen Organismen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten der EU angehören, oder von anderen Staaten, die nicht Mitglied der EU sind, von der CSSF jedoch offiziell akzeptiert werden, begeben werden oder garantiert sind (zum Datum dieses Verkaufsprospekts werden die folgenden Staaten von der CSSF akzeptiert: Die Sonderverwaltungsregion Hongkong, die Volksrepublik China, die Föderative Republik Brasilien, die Republik Indien, die Republik Indonesien, die Russische Föderation, die Republik Südafrika, die Republik Singapur).

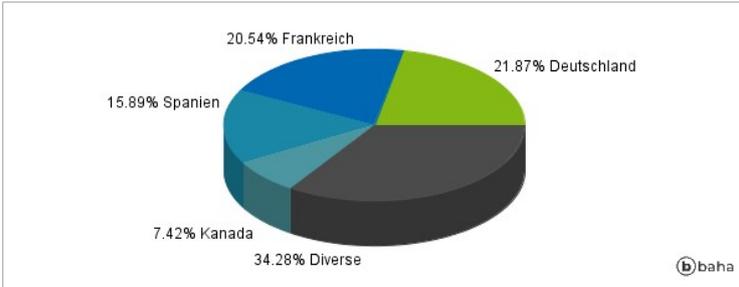
Anlagearten



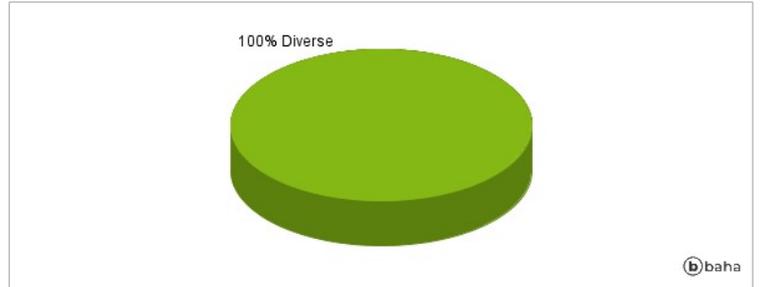
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 12/2024

Erstellt: 02.12.2024 23:55