

Allianz Suisse Anlagestiftung
 Richtplatz 1, 8304 Wallisellen
 Telefon: +41 058 358 88 32
 E-mail: asast.mail@allianz.ch

Schweiz/Juni 2022

Anlagepolitik

Ziel der Anlagegruppe «Obligationen Fremdwährung» ist es, dem Anleger die Möglichkeit zu bieten, sich an einem Wertpapierportfolio zu beteiligen, das laut den Anlagerichtlinien nur in auf Fremdwährung lautende Anlagen von Schuldern mit Domizil Schweiz oder Ausland investiert. Fremdwährungsexposures werden weitestgehend abgesichert. Erlaubt ist der Erwerb von Obligationen und Schuldverschreibungen und in geringem Umfang auch von Wandel- und Optionsanleihen öffentlichrechtlicher und privater Schuldner. Es werden nur Schuldner berücksichtigt, die von einer der führenden Ratingagenturen mit «Investmentgrade» eingestuft werden. Die Anlagestrategie ist auf einen langen Anlagehorizont ausgelegt. Aus Gründen der Kostenoptimierung erfolgen die Anlagen über den Einsatz eines Fonds für qualifizierte Anleger.

Kennzahlen

Investment Manager	Allianz Global Investors GmbH
Investment Manager seit	30.09.2014
Standort Investment Manager	Frankfurt am Main
Währung	CHF
Mindestinvestition (Anspruch)	1
Ende des Geschäftsjahres	31. März
Emissionsdatum	09.01.2003
Verwaltungskommission in % p.a.	0.30
TER (gemäss letztem Jahresbericht) in %	0.31
Zeichnung / Rücknahme	Täglich
Benchmark (BM)	Bloomberg Global Aggr. (TR) (12/15)
Valoren-Nr.	1536419
ISIN	CH0015364190

	05.22	06.22
Nettoinventarwert gesamt (in Mio.)	0.84	0.84
Nettoinventarwert pro Anspruch (NAV)	111.01	107.22
Ausgabepreis	111.01	107.22
Rücknahmepreis	111.01	107.22
Aufgelaufener Ertrag	0.00	0.00

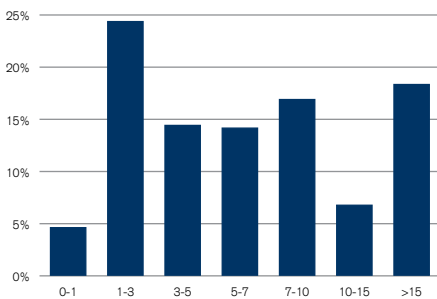
Laufzeit und Rendite

	05.22	06.22
Durchschnittliche Restlaufzeit in Jahren	8.41	8.62
Modified Duration in Jahren	6.97	7.17

Währungen in % (nach Absicherung)

USD	42.69
EUR	25.44
JPY	13.37
GBP	6.34
CHF	0.42
Andere	11.74

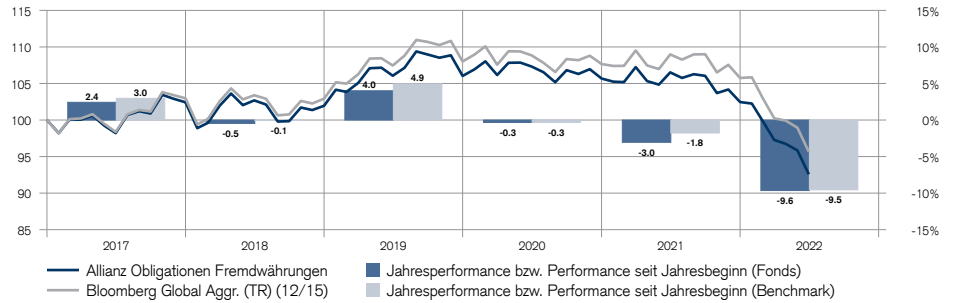
Verfallstruktur in Jahren



Statistische Kennzahlen

	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität, annualisiert	4.80	5.14
Volatilität der Benchmark, annualisiert	5.07	5.27
Tracking Error, annualisiert	0.67	0.54
Alpha	-0.07	-0.05
Beta	0.94	0.97
Sharpe Ratio	-0.79	-0.09
Information Ratio	-0.93	-1.15
Korrelation zum Benchmark	0.99	1.00

Netto-Performance in CHF (zurückgesetzt auf Basis 100) und Jahresperformance



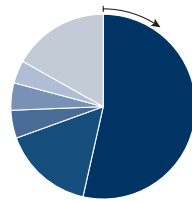
Netto-Performance bis 30.06.2022

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	3 Jahre	5 Jahre
	%	%	%	%	%	%	% p.a.	% p.a.
Fonds CHF	-3.41	-4.83	-9.65	-13.09	-12.72	-5.74	-4.42	-1.17
Benchmark CHF	-3.33	-4.56	-9.55	-12.22	-10.98	-2.77	-3.79	-0.56

Netto-Performance Kalenderjahr

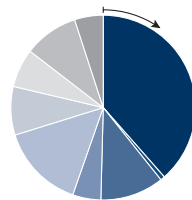
	2017	2018	2019	2020	2021	YTD
	%	%	%	%	%	%
Fonds CHF	2.43	-0.46	4.01	-0.33	-3.05	-9.65
Benchmark CHF	2.97	-0.05	4.95	-0.32	-1.77	-9.55

Sektoren in %



	Fonds	Fonds
	05.22	06.22
Staatsanleihen	51.06	53.52
Finanzgesellschaften	16.77	15.96
Konsumgüter (zyklisch)	5.22	4.89
Technologie	4.79	4.78
Staat (supranational)	4.05	4.01
Andere	18.11	16.84

Kredit-Ratings in %



AAA	38.50
AA+	0.77
AA	11.14
AA-	4.94
A+	14.84
A	8.49
A-	6.76
BBB	9.54
Andere	5.01

Länder in %

	Fonds	Fonds
	05.22	06.22
USA	33.36	35.23
Japan	10.62	10.23
Deutschland	7.61	7.93
UK	5.49	5.79
Kanada	5.11	5.39
Supranational	4.31	4.32
Frankreich	3.97	3.89
Zahlungsmittel / -äquivalente	6.00	3.70
Andere	23.53	23.52

Grösste Schuldner

Schuldner Obligationen	Identifikation	in %
United States of America	863024	18.39
Japan	759610	9.59
Canada Government	57893916	3.66
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	358800	3.54
Federal Republic of Germany	59131784	3.25
Total		38.43

Sowohl die Allianz Suisse Anlagestiftung als auch die Credit Suisse AG geben keine Gewähr hinsichtlich des Inhaltes und der Vollständigkeit dieses Dokumentes und lehnen jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung dieser Informationen ergeben. Ist nichts anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Das Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken. Es stellt weder ein Angebot, noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Bankdienstleistungen dar. Eine Kaufentscheidung ist aufgrund der Statuten, des Reglements und der Anlagerichtlinien sowie des jeweils aktuellen Jahresberichts zu treffen. Dieses Dokument darf ohne schriftliche Genehmigung der Allianz Suisse Anlagestiftung oder der Credit Suisse AG weder auszugswise noch vollständig vervielfältigt werden. Es richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbietet. Mit jeder Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen verbunden. Ausführliche Informationen über Risiken im Effektenhandel gibt die Broschüre "Besondere Risiken im Effektenhandel", herausgegeben von der Schweizerischen Bankiervereinigung. Zu beachten ist, dass historische Renditeangaben und Finanzmarktszenarien keine Garantie für zukünftige Ergebnisse sind. Datenquelle für die Performancedaten ist Lipper, a Reuters Company. Emittent und Verwalter der Anlagegruppe ist die Allianz Suisse Anlagestiftung, Zürich. Depotbank der Anlagegruppe ist die CREDIT SUISSE (Schweiz) AG, Zürich. Statuten, Reglement und Anlagerichtlinien sowie die jeweils aktuellen Jahresberichte können bei der Allianz Suisse Anlagestiftung kostenlos bezogen werden. Diese Stiftung ist nur einem eingeschränkten Kreis von in der Schweiz domizilierten steuerbefreiten Vorsorgeeinrichtungen zugänglich (Art. 5 der Statuten). Copyright © 2022 Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.