

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

Schweiz/Juni 2022

Anlagepolitik

Die Anlagegruppe Obligationen USD Credit (Hegded CHF) bietet dem Anleger die Möglichkeit in Forderungspapiere von Unternehmen inkl. Agencies und Supranationales zu investieren, wobei der Fokus auf Unternehmensanleihen liegt. Erlaubt ist der Erwerb von auf USD lautende Obligationen und in geringem Umfang auch von Wandel- und Optionsanleihen. Es werden nur Schuldner berücksichtigt, die von einer der führenden Ratingagenturen mit «Investmentgrade» eingestuft werden. Fremdwährungsrisiken werden soweit möglich gegen CHF abgesichert.

Kennzahlen

Investment Manager	Allianz Suisse Versicherungs-Gesellschaft AG
Investment Manager seit	03.05.2017
Standort Investment Manager	Zürich
Währung	CHF
Ende des Geschäftsjahres	31. März
Emissionsdatum	03.05.2017
Verwaltungskommission in % p.a.	0.33
TER (gemäss letztem Jahresbericht) in %	0.33
Zeichnung / Rücknahme	Täglich
Benchmark (BM)	Bloomberg US Credit 5-10Y (TR) (CHF-Hgd)
Valoren-Nr.	36484368
ISIN	CH0364843687

	05.22	06.22
Nettoinventarwert gesamt (in Mio.)	50.04	48.70
Nettoinventarwert pro Anspruch (NAV)	98.02	95.40
Ausgabepreis	98.02	95.40
Rücknahmepreis	98.02	95.40
Aufgelaufener Ertrag	0.00	0.00

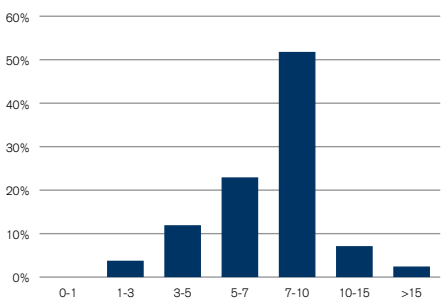
Laufzeit und Rendite

	05.22	06.22
Durchschnittliche Restlaufzeit in Jahren	7.83	7.74
Modified Duration in Jahren	6.43	6.34

Währungen in %

Basiswährung (einschliesslich abgesicherter Währungen)	103.87
Nicht abgesicherte Währungen	-3.87

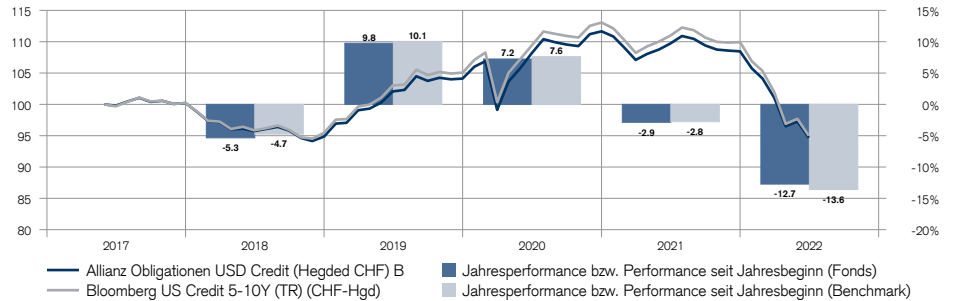
Verfallstruktur in Jahren



Statistische Kennzahlen

	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität, annualisiert	7.45	6.16
Volatilität der Benchmark, annualisiert	-	-
Tracking Error, annualisiert	-	-
Alpha	-	-
Beta	-	-
Sharpe Ratio	-0.24	-0.05
Information Ratio	-	-
Korrelation zum Benchmark	-	-

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



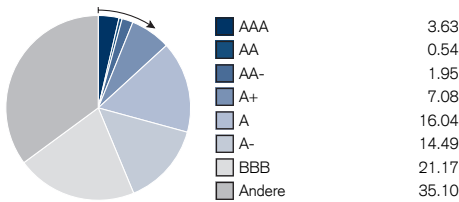
Netto-Performance bis 30.06.2022

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	3 Jahre % p.a.	5 Jahre % p.a.
Fonds CHF	-2.67	-6.32	-12.73	-13.71	-7.25	-5.13	-2.47	-1.05
Benchmark CHF	-2.77	-6.84	-13.59	-14.40	-7.80	-4.72	-2.66	-0.96

Netto-Performance Kalenderjahr

	2017	2018	2019	2020	2021	YTD
Fonds CHF	-	-5.34	9.76	7.24	-2.86	-12.73
Benchmark CHF	-	-4.74	10.06	7.61	-2.77	-13.59

Kredit-Ratings in %



Länder in %

	Fonds 05.22	Fonds 06.22
USA	71.05	71.79
UK	9.83	9.77
Japan	3.48	3.43
Deutschland	1.36	1.36
Supranational	0.97	0.97
Niederlande	0.82	0.81
Schweiz	0.75	0.75
Zahlungsmittel / -äquivalente	6.44	5.87
Andere	5.30	5.25

Sektoren in %

	Fonds 05.22	Fonds 06.22
Finanzgesellschaften	36.08	36.35
Energie	10.80	10.56
Immobilien	8.82	8.60
Versorgungsbetriebe	8.37	8.20
Kommunikationsdienstleistung	7.89	7.72
Gesundheitswesen	7.53	7.37
Technologie	6.24	6.09
Konsumgüter (nicht zyklisch)	4.41	5.43
Andere	9.86	9.68

Grösste Schuldner

Schuldner Obligationen	Identifikation	in %
JPMorgan Chase & Co	448037	4.47
Bank of America Corp	32938	4.08
Citigroup Inc	883765	2.34
Barclays PLC	371815	2.19
Verizon Communications Inc	1095642	2.06
Total		15.14

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 Finanzmarktsszenarien 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.