Allianz Obligationen Fremdwährungen

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

Svizzera/Settembre 2023

Politica d'investimento

L'obiettivo del gruppo d'investimento «Obbligazioni in moneta estera» è quello di offrire agli investitori la possibilità di partecipare a un portafoglio di titoli che, conformemente alle direttive d'investimento, investe esclusivamente in titoli denominati in moneta estera di debitori con domicilio in Svizzera o all'estero. La maggior parte delle esposizioni in moneta estera è oggetto di copertura. È consentito l'acquisto di obbligazioni e titoli di debito e, in minore misura, anche di prestiti a opzione e obbligazioni convertibili di debitori sia pubblici che privati. Vengono presi in considerazione soltanto i debitori classificati da una delle principali agenzie di rating nella categoria «investment grade». La strategia d'investimento è basata su un orizzonte d'investimento a lungo termine. Per motivi di ottimizzazione dei costi gli investimenti ricorrono all'impiego di un fondo per investitori qualificati.

Cifre salienti

Responsabile di investimento	Allianz Global Investors GmbH
Responsabile di investimento da allora	30.09.2014
Domicilio	Francoforte
Valuta base	CHF
Investimento minimo (dirito)	1
Chiusura d'esercizio	31 marzo
Data di lancio	09.01.2003
Commissione di gestione in % p.a.	0.30
TER (come da ultimo rapporto annuale) in %	0.30
Sottoscrizioni / Riscatti	Giornalieri
Indice di riferimento (BM)	Bloomberg Global Aggr. (TR) (12/15)
Numero di valore	1536419
Codice ISIN	CH0015364190

	08.23	09.23
Quota totale (in mio.)	0.76	0.73
Quota per dirito (NAV)	96.23	96.47
Prezzo d'emissione	96.23	96.47
Prezzo di riscatto	96.23	96.47
Redditi maturati	0.00	0.01

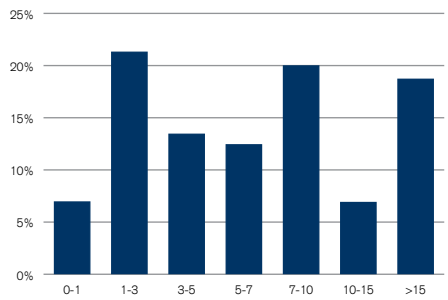
Duration e rendimento

	08.23	09.23
Duration media sino alla scadenza in anni	8.71	8.62
Modified duration in anni	6.75	6.59

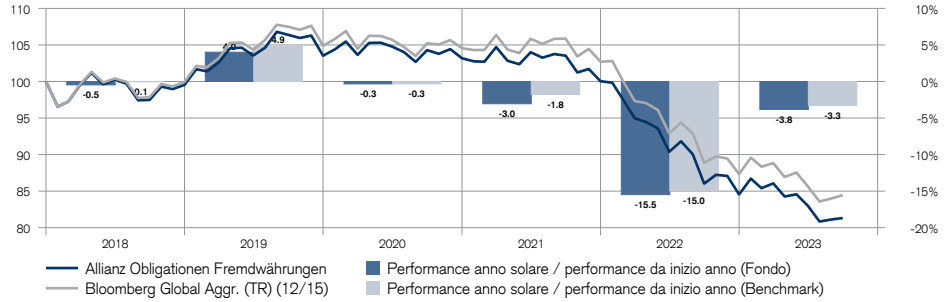
Valute in % (dopo la copertura)

USD	45.50
EUR	24.18
JPY	11.67
GBP	5.96
CHF	2.76
Altri	9.93

Scadenze in anni



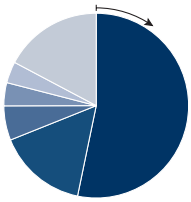
Performance netta in CHF (base 100) e performance annua



Performance netta al 30.09.2023	1 mese %	3 mesi %	6 mesi %	1 anno %	3 anni %	5 anni %	3 anni % p.a	5 anni % p.a
Fondo CHF	0.25	-2.03	-5.50	-5.47	-22.03	-16.58	-7.97	-3.56
Indice di riferimento CHF	0.55	-1.41	-4.93	-4.97	-19.73	-13.71	-7.07	-2.90

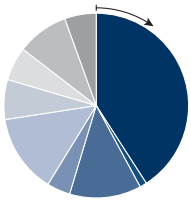
Performance netta anno solare	2018 %	2019 %	2020 %	2021 %	2022 %	YTD %
Fondo CHF	-0.46	4.01	-0.33	-3.05	-15.48	-3.82
Indice di riferimento CHF	-0.05	4.95	-0.32	-1.77	-14.96	-3.31

Categorie in %



	Fondo 08.23	Fondo 09.23
Governo	53.79	53.25
Società finanziarie	15.87	15.69
Stato (sovranazionale)	6.13	6.02
Beni di consumo (ciclici)	3.92	4.05
Tecnologia	3.59	3.74
Altri	16.70	17.25

Ripartizione per rating in %



AAA	40.88
AA+	1.23
AA	12.55
AA-	4.10
A+	13.82
A	6.98
A-	5.88
BBB	9.04
Altri	5.52

Paesi in %

	Fondo 08.23	Fondo 09.23
USA	35.78	34.60
Giappone	9.40	9.49
Germania	7.11	6.93
Sovranazionale	6.25	6.10
Regno Unito	6.03	6.02
Francia	4.79	4.81
Canada	4.27	4.41
Attività liquide e strumenti assimilati	4.93	5.58
Altri	21.44	22.06

Maggiori debitori

Obbligazioni di debitori	Identificazione	in %
United States of America	863024	19.74
Japan	759610	9.19
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	358800	4.21
Italian Republic	20479017	3.83
Federal Republic of Germany	59131784	3.27
Totale		**40.24**

Indici statistici

	3 anni	5 anni
Volatilità, annualizzato	5.65	5.43
Volatilità del indice di riferimento, annual.	5.69	5.47
Tracking error, annualizzato	0.77	0.69
Alpha	-0.09	-0.06
Beta	0.98	0.98
Sharpe ratio	-1.47	-0.62
Information ratio	-1.15	-0.94
Correlazione al indice di riferimento	0.99	0.99

Allianz Suisse Fondazione d'investimento così come Credit Suisse AG non forniscono alcuna garanzia circa il contenuto e la completezza del presente documento e declinano qualsiasi responsabilità per eventuali perdite legate all'utilizzo delle presenti informazioni. Tutti i dati non sono certificati, salvo indicazioni contrarie. Il presente documento ha scopo puramente informativo e non costituisce né un'offerta né una raccomandazione di acquisto o di vendita di strumenti finanziari o servizi bancari. Una decisione d'acquisto deve essere presa sulla base dello statuto, del regolamento e delle direttive d'investimento, nonché del rapporto annuale attuale. La riproduzione, anche parziale, del presente documento è consentita esclusivamente previa autorizzazione scritta di Allianz Suisse Fondazione d'investimento o di Credit Suisse AG. Il documento non è espressamente indirizzato alle persone che, in ragione della loro nazionalità o luogo di residenza, non sono autorizzate ad accedere a tali informazioni in base alle leggi vigenti.
Tutti gli investimenti comportano rischi, in particolare quelli soggetti a fluttuazioni del valore e del rendimento. Informazioni dettagliate sui rischi comportati dalla negoziazione di titoli sono disponibili nell'opuscolo «Rischi particolari nel commercio di valori mobiliari» pubblicato dall'Associazione Svizzera dei Banchieri. Si sottolinea che i dati storici sul rendimento e gli scenari dei mercati finanziari non costituiscono alcuna garanzia dei risultati futuri. La fonte per i dati sulla performance è Lipper, una società del Gruppo Reuters. L'emittente e amministratore del gruppo d'investimento è Allianz Suisse Fondazione d'investimento, Zurigo. La banca depositaria del gruppo d'investimento è CREDIT SUISSE (Schweiz) AG, Zurigo. Statuto, regolamento e direttive d'investimento, nonché gli attuali rapporti annuali possono essere richiesti gratuitamente presso Allianz Suisse Fondazione d'investimento. La fondazione è accessibile soltanto a un gruppo limitato di istituti di previdenza domiciliati in Svizzera ed esenti da imposte (art. 5 dello statuto).
Copyright © 2023 Credit Suisse Group AG e/o le sue affiliate. Tutti i diritti riservati.