

Allianz Global Investors Fund - Allianz Multi Asset Long / Short P14 H2-EUR

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

Morningstar Rating™

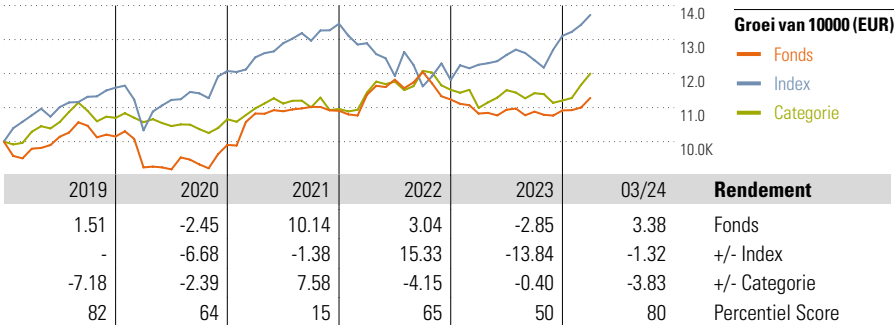
★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Systematic Futures

Beleggingsdoelstelling

The investment policy aims to generate long term capital growth through investments in a broad range of asset classes. The Sub-Fund seeks to generate superior risk adjusted returns throughout a market cycle. The investment policy is geared towards generating appropriate annualized returns while taking into account the opportunities and risks of a Long / Short multi asset strategy.



Risicomaatstaven

Alpha	0.90	Sharpe Ratio	0.06
Beta	-0.23	Std Deviatie	5.85
R-kwadraat	10.50	3-jr Risico	Laag
Informatie Ratio	-0.16	5-jr Risico	- gem
Tracking Error	11.82	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	3.90	1.18	-1.05
6 Maanden	4.06	-7.64	-1.50
1 jaar	4.32	-6.87	-3.40
3 jr gean.	1.72	-0.62	-0.65
5 jr gean.	2.87	-1.44	0.72

Kwartaalrendementen

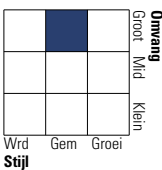
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	3.38	-	-	-
2023	-3.68	1.05	-0.51	0.33
2022	4.30	3.93	1.92	-6.73
2021	9.33	0.62	1.17	-1.03
2020	-8.96	-0.62	1.58	6.14

Portefeuille 31 jan 2024

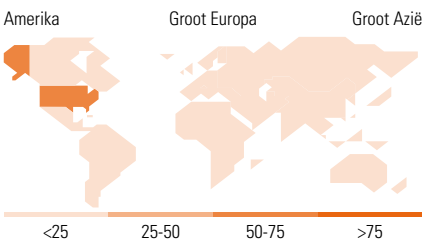
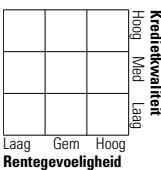
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	36.36	1.07	35.29
Obligaties	104.87	16.82	88.05
Kas/ geldmarkt	169.85	183.58	-13.74
Overig	0.00	9.60	-9.60

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
E-mini S&P 500 Future Mar...	—	13.52
TOPIX Index Future Mar14	—	12.56
10 Year Treasury Note Future...	—	4.02
Mini Dax Future Mar 242024-03-15	—	3.55
United States Treasury Notes...	—	3.51
Future on 10 Year Japanese...	—	3.49
United States Treasury Notes...	—	3.42
10 Year Government of Canada...	—	2.55
United States Treasury Notes...	—	2.48
Long-Term Euro BTP Future Mar...	—	2.45
Totaal Aantal Aandelen		0
Totaal Aantal Obligaties		135
% Van Vermogen In Top 10 Posities		51.56

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	37.14
Basismaterialen	4.20
Cyclische consumentenproducten	8.83
Financiële dienstverlening	19.98
Vastgoed	4.13
Licht Cyclisch	45.40
Communicatiediensten	7.72
Energie	5.02
Industrie	9.47
Technologie	23.19
Defensief	17.46
Defensieve consumptiegoederen	5.52
Gezondheidszorg	9.95
Nutsbedrijven	1.99

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	81.91
Verenigde Staten	71.32
Canada	10.58
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	0.77
Verenigd Koninkrijk	0.47
West Europa – Euro	0.10
West Europa – Niet Euro	0.21
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	17.32
Japan	0.00
Australazië	7.71
Azië - Ontwikkeld	9.27
Azië - Emerging	0.34

Fondsinformatie

Fondsgroep	Allianz Global Investors...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	3,000,000
Telefoon	+49 (0) 69 2443-1140	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.allianzglobalinves...	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	12 apr 2018	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Michael Verhofen	ISIN	LU1481688148		
Aanvangsdatum	25 jul 2022				
Koers (26 apr 2024)	EUR 1,016.55				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.17				