

Allianz Global Investors Fund - Allianz Multi Asset Long / Short W9 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™

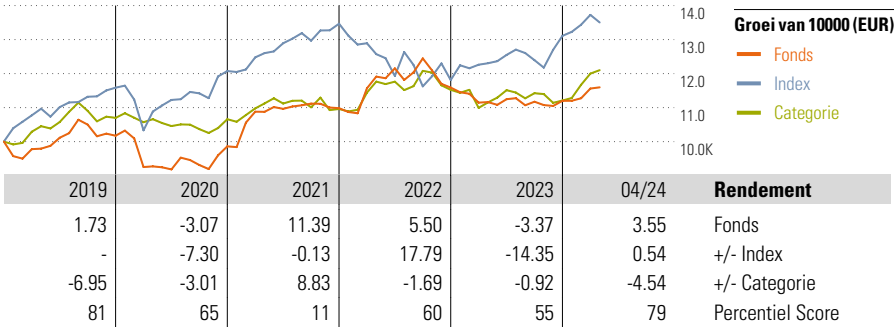
★★★

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	1.44	Sharpe Ratio	0.16
Beta	-0.28	Std Deviatie	6.69
R-kwadraat	12.98	3-jr Risico	- gem
Informatie Ratio	-0.01	5-jr Risico	- gem
Tracking Error	12.69	10-jr Risico	-

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

Rendementen (31 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.94	0.78	0.93
6 Maanden	5.05	-3.04	-1.95
1 jaar	4.74	-6.27	-1.20
3 jr gean.	1.75	-1.00	-0.22
5 jr gean.	3.28	-1.76	0.94

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	3.23	-	-	-
2023	-3.82	0.91	-0.66	0.23
2022	5.31	5.07	2.41	-6.89
2021	10.33	0.76	1.41	-1.20
2020	-9.05	-0.76	1.41	5.89

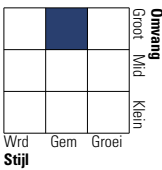
Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

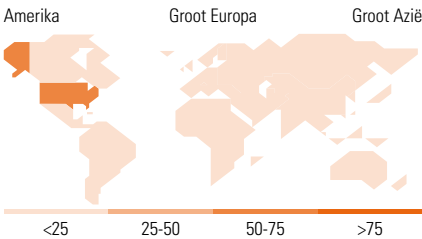
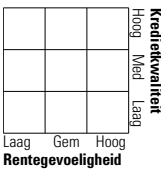
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	43.47	0.71	42.75
Obligaties	113.99	17.02	96.97
Kas/ geldmarkt	181.18	229.20	-48.02
Overig	8.30	0.00	8.30

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
E-mini S&P 500 Future June...	—	14.72
TOPIX Index Future June14	—	9.20
Fyubswpp Receive...	—	8.30
Mini Dax Future June...	—	6.29
United States Treasury Notes...	—	4.14
Ftse 100 Idx Fut 06242024-06-21	—	3.76
10 Year Government of Canada...	—	3.76
Long-Term Euro BTP Future June...	—	3.73
Long Gilt Future June...	—	3.65
S&P TSX 60 Index Future June...	—	3.61
Totaal Aantal Aandelen		0
Totaal Aantal Obligaties		128
% Van Vermogen In Top 10 Posities		61.16

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	39.17
Basismaterialen	4.74
Cyclische consumentenproducten	8.49
Financiële dienstverlening	21.85
Vastgoed	4.09
Licht Cyclisch	44.80
Communicatiediensten	7.36
Energie	5.92
Industrie	9.86
Technologie	21.66
Defensief	16.03
Defensieve consumptiegoederen	5.16
Gezondheidszorg	8.91
Nutsbedrijven	1.96

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	80.27
Verenigde Staten	65.21
Canada	15.06
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	0.74
Verenigd Koninkrijk	0.46
West Europa – Euro	0.09
West Europa – Niet Euro	0.19
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	19.00
Japan	0.00
Australazië	8.83
Azië - Ontwikkeld	9.86
Azië - Emerging	0.31

Fondsinformatie

Fondsgroep	Allianz Global Investors...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000,000
Telefoon	+49 (0) 69 2443-1140	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.allianzglobalinves...	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	6 apr 2017	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Michael Verhofen	ISIN	LU1584111725		
Aanvangsdatum	25 jul 2022				
Koers (31 mei 2024)	EUR 104,941.61				
Fondsvermogen (mln)	EUR 39.88				