

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

Schweiz/März 2024

Anlagepolitik

Ziel der Anlagegruppe «Obligationen CHF» ist es, dem Anleger die Möglichkeit zu bieten, sich an einem Wertpapierportefeuille zu beteiligen, das laut den Anlagerichtlinien in auf Schweizer Franken lautende Anlagen investiert. Erlaubt ist der Erwerb von Obligationen und Schuldverschreibungen und in geringem Umfang auch von Wandel- und Optionsanleihen öffentlich-rechtlicher und privater Schuldner. Es werden nur Schuldner berücksichtigt, die gemäss der SBI Ratingklassifizierung 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

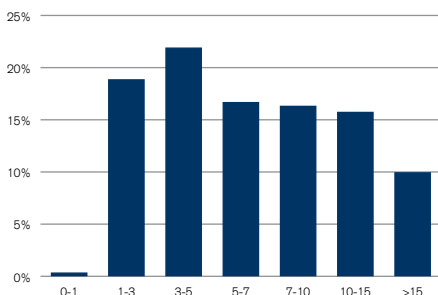
Investment Manager	Allianz Global Investors (Schweiz) AG
Investment Manager seit	01.10.2015
Standort Investment Manager	Zürich
Währung	CHF
Mindestinvestition (Anspruch)	1
Ende des Geschäftsjahres	31. März
Emissionsdatum	09.01.2003
Verwaltungskommission in % p.a.	0.16
TER (gemäss letztem Jahresbericht) in %	0.16
Zeichnung / Rücknahme	Täglich
Benchmark (BM)	SBI AAA-BBB (TR) (10/17)
Valoren-Nr.	1409113
ISIN	CH0014091133

	02.24	03.24
Nettoinventarwert gesamt (in Mio.)	276.43	277.71
Nettoinventarwert pro Anspruch (NAV)	141.61	142.78
Ausgabepreis	141.61	142.78
Rücknahmepreis	141.61	142.78
Aufgelaufener Ertrag	1.25	1.25

Laufzeit und Rendite

	02.24	03.24
Durchschnittliche Restlaufzeit in Jahren	7.60	7.61
Modified Duration in Jahren	6.99	7.00

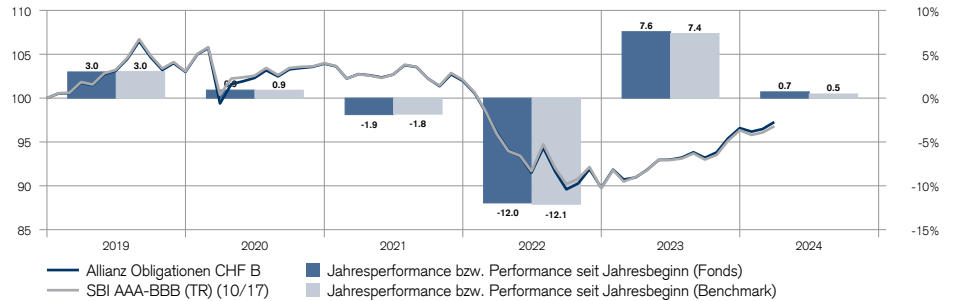
Verfallstruktur in Jahren



Statistische Kennzahlen

	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität, annualisiert	5.09	5.37
Volatilität der Benchmark, annualisiert	5.17	5.21
Tracking Error, annualisiert	0.47	0.60
Alpha	0.01	0.01
Beta	0.98	1.03
Sharpe Ratio	-0.43	-0.16
Information Ratio	0.34	0.19
Korrelation zum Benchmark	1.00	0.99

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



Netto-Performance bis 31.03.2024

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	3 Jahre	5 Jahre
	%	%	%	%	%	%	% p.a.	% p.a.
Fonds CHF	0.83	0.71	4.37	6.94	-5.32	-4.41	-1.81	-0.90
Benchmark CHF	0.74	0.47	4.09	6.38	-5.78	-4.95	-1.97	-1.01

Netto-Performance Kalenderjahr

	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
	%	%	%	%	%	%
Fonds CHF	2.98	0.91	-1.88	-11.95	7.57	0.71
Benchmark CHF	3.05	0.90	-1.82	-12.10	7.36	0.47

Sektoren in %

	Fonds 02.24	Fonds 03.24
Finanzgesellschaften	44.67	44.40
Hypothekenbesicherte Wertpapiere	23.21	22.71
Staatsanleihen	13.39	13.41
Staat (regional)	6.97	6.78
Konsumgüter (zyklisch)	2.73	2.71
Gesundheitswesen	2.25	2.25
Versorgungsbetriebe	1.57	1.87
Konsumgüter (nicht zyklisch)	0.54	1.17
Andere	4.67	4.70

Kredit-Ratings in %

AAA	56.03
AA+	4.17
AA	11.58
AA-	4.78
A+	5.36
A	7.31
A-	4.91
BBB	3.78
Andere	2.08

Länder in %

	Fonds 02.24	Fonds 03.24
Schweiz	56.95	56.21
Deutschland	7.77	7.70
Kanada	5.28	5.23
Frankreich	3.41	4.30
USA	3.01	3.61
UK	3.41	3.38
Australien	3.00	2.98
Zahlungsmittel / -äquivalente	2.90	2.61
Andere	14.27	13.98

Grösste Schuldner

Schuldner Obligationen	Identifikation	in %
Schweizerische Eidgenossenschaft	15103	23.44
Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute AG	28104	12.63
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	48857	7.37
Banco Santander SA	122793772	2.85
Federation nationale du Credit Agricole	1336531	2.47
Total		48.76

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 auszugsweise 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. Alle Verweise auf die CS können auch die UBS AG, ihre verbundenen Unternehmen, Tochtergesellschaften und Niederlassungen umfassen.

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). Die Anlagegruppe wird von der SIX Swiss Exchange weder unterstützt, abgetreten, verkauft oder beworben noch gibt die SIX Swiss Exchange Anlageempfehlungen für diesen Fonds ab. SBI® ist eine eingetragene lizenzierte Handelsmarke der SIX Swiss Exchange. Copyright © 2024 Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.