

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

Schweiz/Oktober 2023

Anlagepolitik

Die währungsbesicherte Anlagegruppe „Obligationen Fremdwährung Hedged“ ist zu mindestens 85% gegen Schweizer Franken abgesichert. Ziel der Anlagegruppe ist es, dem Anleger die Möglichkeit zu bieten, sich an einem Wertpapierportefeuille zu beteiligen, das laut den Anlagerichtlinien nur in auf Fremdwährung lautende Anlagen von Schuldern mit Domizil Schweiz oder Ausland investiert. Erlaubt ist der Erwerb von Obligationen und Schuldverschreibungen und in geringem Umfang auch von Wandel- und Optionsanleihen öffentlichrechtlicher und privater Schuldner. Es werden nur Schuldner berücksichtigt, die von einer der führenden Ratingagenturen 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

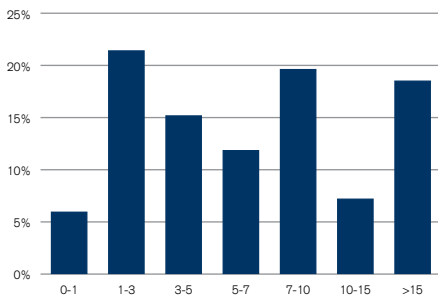
| | |
|------------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| Investment Manager | Allianz Global Investors GmbH |
| Investment Manager seit | 31.03.2014 |
| Standort Investment Manager | Frankfurt am Main |
| Währung | CHF |
| Ende des Geschäftsjahres | 31. März |
| Emissionsdatum | 10.07.2012 |
| Verwaltungskommission in % p.a. | 0.30 |
| TER (gemäss letztem Jahresbericht) in % | 0.31 |
| Zeichnung / Rücknahme | Täglich |
| Benchmark (BM) | Bloomberg Global Aggr. (TR) (CHF-Hgd) (12/15) |
| Valoren-Nr. | 18256787 |
| ISIN | CH0182567872 |

| | 09.23 | 10.23 |
|---------------------------------------------|-------|-------|
| Nettoinventarwert gesamt (in Mio.) | 93.62 | 92.53 |
| Nettoinventarwert pro Anspruch (NAV) | 89.36 | 88.32 |
| Ausgabepreis | 89.36 | 88.32 |
| Rücknahmepreis | 89.36 | 88.32 |
| Aufgelaufener Ertrag | 0.00 | 0.00 |

Laufzeit und Rendite

| | 09.23 | 10.23 |
|-------------------------------------------------|-------|-------|
| Durchschnittliche Restlaufzeit in Jahren | 8.66 | 8.65 |
| Modified Duration in Jahren | 6.63 | 6.56 |

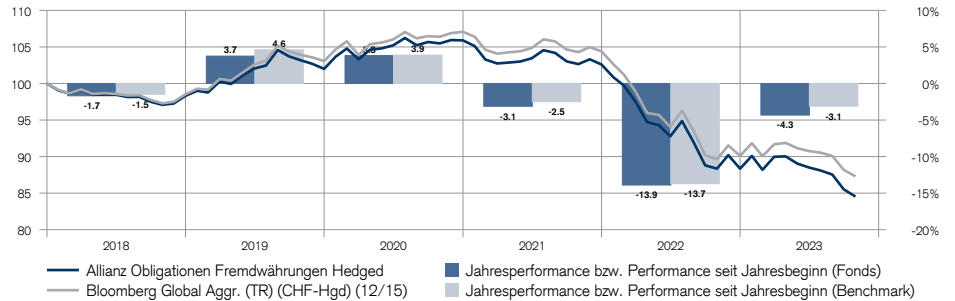
Verfallstruktur in Jahren



Statistische Kennzahlen

| | 3 Jahre | 5 Jahre |
|------------------------------------------------|---------|---------|
| Volatilität, annualisiert | 5.00 | 4.64 |
| Volatilität der Benchmark, annualisiert | 4.94 | 4.57 |
| Tracking Error, annualisiert | 0.50 | 0.47 |
| Alpha | -0.06 | -0.05 |
| Beta | 1.01 | 1.01 |
| Sharpe Ratio | -1.49 | -0.55 |
| Information Ratio | -1.46 | -1.24 |
| Korrelation zum Benchmark | 0.99 | 0.99 |

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



Netto-Performance bis 31.10.2023

| | 1 Monat | 3 Monate | 6 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 3 Jahre | 5 Jahre |
|---------------|---------|----------|----------|--------|---------|---------|---------|---------|
| | % | % | % | % | % | % | % p.a. | % p.a. |
| Fonds CHF | -1.16 | -4.05 | -6.11 | -4.32 | -19.87 | -12.93 | -7.11 | -2.73 |
| Benchmark CHF | -1.02 | -3.58 | -4.98 | -2.61 | -17.95 | -10.27 | -6.38 | -2.14 |

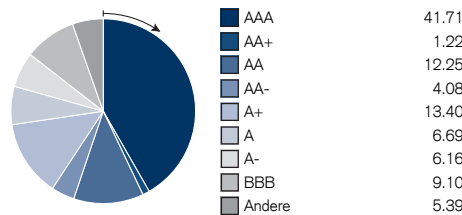
Netto-Performance Kalenderjahr

| | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | YTD |
|---------------|-------|------|------|-------|--------|-------|
| | % | % | % | % | % | % |
| Fonds CHF | -1.68 | 3.75 | 3.82 | -3.12 | -13.89 | -4.32 |
| Benchmark CHF | -1.47 | 4.61 | 3.88 | -2.49 | -13.71 | -3.10 |

Währungen in %

| | |
|--------------------------------------------------------|-------|
| Basiswährung (einschliesslich abgesicherter Währungen) | 98.27 |
| Nicht abgesicherte Währungen | 1.73 |

Kredit-Ratings in %



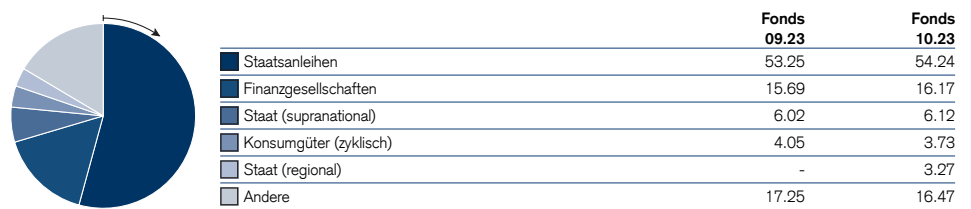
Länder in %

| | Fonds 09.23 | Fonds 10.23 |
|-------------------------------|-------------|-------------|
| USA | 34.98 | 35.23 |
| Japan | 9.59 | 9.25 |
| Deutschland | 7.00 | 7.01 |
| Supranational | 6.16 | 6.27 |
| UK | 6.08 | 6.03 |
| Frankreich | 4.86 | 4.85 |
| Kanada | 4.46 | 4.39 |
| Zahlungsmittel / -äquivalente | 4.57 | 3.83 |
| Andere | 22.30 | 23.14 |

Währungen in % (vor Absicherung)

| | Fonds 09.23 | Fonds 10.23 |
|--------|-------------|-------------|
| USD | 46.76 | 46.76 |
| EUR | 24.10 | 24.10 |
| JPY | 11.18 | 11.18 |
| GBP | 5.85 | 5.85 |
| CAD | 4.05 | 4.05 |
| AUD | 2.89 | 2.89 |
| CHF | 2.33 | 2.33 |
| NZD | 1.34 | 1.34 |
| Andere | 1.50 | 1.50 |

Sektoren in %



Grösste Schuldner

| Schuldner Obligationen | Identifikation | in % |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------|
| United States of America | 863024 | 20.96 |
| Japan | 759610 | 8.84 |
| Italian Republic | 20479017 | 4.17 |
| United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 358800 | 4.15 |
| Federal Republic of Germany | 59131784 | 3.25 |
| Total | | 41.37 |

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. 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 Performanceangaben 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 © 2023 Credit Suisse Group AG und/oder mit ihr verbundene Unternehmen. Alle Rechte vorbehalten.