

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

Suisse/Septembre 2023

Politique d'investissement

L'objectif du groupe de placement «Obligations en monnaies étrangères» est d'offrir à l'investisseur la possibilité de participer à un portefeuille investissant, selon les directives de placement, exclusivement dans des titres en monnaies étrangères émis par des débiteurs domiciliés en Suisse ou à l'étranger. Les expositions aux monnaies étrangères sont majoritairement couvertes contre le risque de change. Est autorisée l'acquisition d'obligations, de titres de créance et, dans une moindre mesure, d'obligations convertibles et à option de débiteurs publics et privés. Seuls les débiteurs classés «investment grade» par l'une des principales agences de notation sont pris en compte. La stratégie de placement est définie sur un horizon de placement long. Pour des raisons d'optimisation des coûts, les placements sont effectués par le biais d'un fonds pour investisseurs qualifiés.

Repères

Gestionnaire	Allianz Global Investors GmbH
Gestionnaire depuis	30.09.2014
Gestionnaire basé à	Francfort-sur-le-Main
Devise	CHF
Investissement minimal (droit)	1
Fin de l'exercice fiscal	31 mars
Date de lancement	09.01.2003
Frais de gestion en % par an	0.30
TER (à la date du dernier rapport annuel) en %	0.30
Souscription / Rachat	Quotidien
Indice de référence (BM)	Bloomberg Global Aggr. (TR) (12/15)
N° de valeur	1536419
Code ISIN	CH0015364190

	08.23	09.23
Valeur liquidative total (en mio.)	0.76	0.73
Valeur liquidative par droit (NAV)	96.23	96.47
Prix d'émission	96.23	96.47
Prix de rachat	96.23	96.47
Revenus courus	0.00	0.01

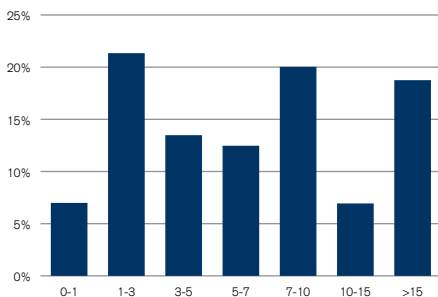
Duration et rendement

	08.23	09.23
Durée moyenne à l'échéance en années	8.71	8.62
Duration modifiée en années	6.75	6.59

Monnaies en % (après couverture)

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

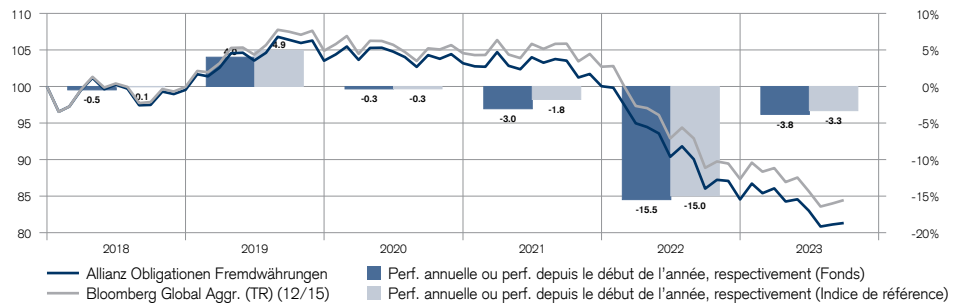
Maturité en années



Statistiques

	3 ans	5 ans
Volatilité, annualisée	5.65	5.43
Volatilité de l'indice de référence, annualisée	5.69	5.47
Tracking error, annualisé	0.77	0.69
Alpha	-0.09	-0.06
Beta	0.98	0.98
Ratio de Sharpe	-1.47	-0.62
Ratio d'information	-1.15	-0.94
Corrélation à l'indice de référence	0.99	0.99

Performance nette en CHF (base de 100) et performance annuelle



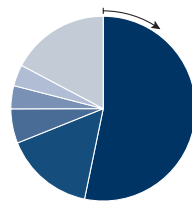
Performance nette au 30.09.2023

	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	3 ans	5 ans	3 ans	5 ans
	%	%	%	%	%	%	% p.a.	% p.a.
Fonds CHF	0.25	-2.03	-5.50	-5.47	-22.03	-16.58	-7.97	-3.56
Indice de référence CHF	0.55	-1.41	-4.93	-4.97	-19.73	-13.71	-7.07	-2.90

Performance nette année civile

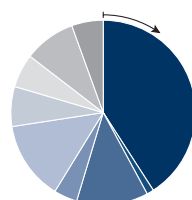
	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
	%	%	%	%	%	%
Fonds CHF	-0.46	4.01	-0.33	-3.05	-15.48	-3.82
Indice de référence CHF	-0.05	4.95	-0.32	-1.77	-14.96	-3.31

Secteurs en %



	Fonds 08.23	Fonds 09.23
Gouvernement	53.79	53.25
Sociétés financières	15.87	15.69
État (supranational)	6.13	6.02
Biens de consommation (cycliques)	3.92	4.05
Technologie	3.59	3.74
Autres	16.70	17.25

Cote de crédit en %



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

Pays en %

	Fonds 08.23	Fonds 09.23
États Unis	35.78	34.60
Japon	9.40	9.49
Allemagne	7.11	6.93
Supranational	6.25	6.10
Royaume-Uni	6.03	6.02
France	4.79	4.81
Canada	4.27	4.41
Liquidités/équivalents de liquidités	4.93	5.58
Autres	21.44	22.06

Principaux débiteurs

Débiteurs obligations	Identification	en %
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
Total		40.24

Ni la Fondation de placement Allianz Suisse ni Credit Suisse AG ne fournissent de garantie en ce qui concerne le contenu et l'exhaustivité de ce document et ils déclinent toute responsabilité pour les pertes qui pourraient résulter de son utilisation. Sauf mention contraire, les chiffres n'ont pas été vérifiés. Ce document est fourni exclusivement à titre d'information. Il ne constitue ni une offre ni une recommandation en vue de l'achat ou de la vente d'instruments financiers ou de services bancaires. Toute décision d'achat doit être prise en vertu des statuts, du règlement, des directives de placement et du rapport annuel actuel. La reproduction intégrale ou partielle du présent document sans l'accord écrit préalable de la Fondation de placement Allianz Suisse et de Credit Suisse AG est interdite. Il est expressément stipulé que ce document ne s'adresse pas aux personnes soumises à une législation leur interdisant l'accès à de telles informations du fait de leur nationalité ou de leur domicile.

Tout placement comporte des risques, en particulier des risques de fluctuation des valeurs et des rendements. Des informations détaillées sur les risques inhérents aux transactions sur titres sont données dans la brochure «Risques particuliers dans le négoce de titres», publiée par l'Association suisse des banquiers. Il est à noter que les rendements historiques et les scénarios de marché financier ne constituent en rien une garantie de résultats futurs. La source des données relatives à la performance est Lipper, une société du groupe Reuters. L'émetteur et l'administrateur du groupe de placement est la Fondation de placement Allianz Suisse, Zurich. La banque dépositaire est CREDIT SUISSE (Schweiz) AG, Zurich. Les statuts, le règlement et les directives de placement ainsi que les derniers rapports annuels peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Allianz Suisse. Cette fondation n'est ouverte qu'à un cercle restreint d'institutions domiciliées en Suisse et exonérées d'impôts (art. 5 des statuts).
Copyright © 2023 Credit Suisse Group AG et/ou sociétés affiliées. Tous droits réservés.