

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

Suisse/Mars 2024

Politique d'investissement

Le groupe de placement Obligations USD Credit (Hegded CHF) offre à l'investisseur la possibilité d'investir dans des titres de créance de sociétés, y c. d'agences et d'organismes supranationaux, avec un accent particulier sur les obligations d'entreprise. Est autorisée l'acquisition d'obligations libellées en USD et, dans une moindre mesure, d'emprunts convertibles et d'emprunts à option. Seuls les débiteurs classés «investment grade» par l'une des principales agences de notation sont pris en compte. Dans la mesure du possible, les risques de change sont couverts contre le CHF.

Repères

Gestionnaire	Allianz Suisse Versicherungs-Gesellschaft AG
Gestionnaire depuis	03.05.2017
Gestionnaire basé à	Francfort-sur-le-Main
Devise	CHF
Fin de l'exercice fiscal	31 mars
Date de lancement	03.05.2017
Frais de gestion en % par an	0.33
TER (à la date du dernier rapport annuel) en %	0.33
Souscription / Rachat	Quotidien
Indice de référence (BM)	Bloomberg US Credit 5-10Y (TR) (CHF-Hgd)
N° de valeur	36484368
Code ISIN	CH0364843687

	02.24	03.24
Valeur liquidative total (en mio.)	48.04	48.49
Valeur liquidative par droit (NAV)	94.10	94.98
Prix d'émission	94.10	94.98
Prix de rachat	94.10	94.98
Revenus courus	3.09	3.09

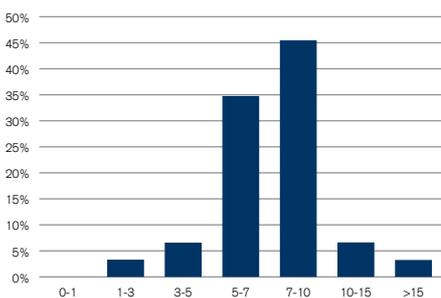
Duration et rendement

	02.24	03.24
Durée moyenne à l'échéance en années	7.94	7.85
Duration modifiée en années	5.55	5.50

Monnaies en %

Monnaie de base (y compris monnaies avec garantie de cours)	99.05
Monnaies sans garantie de cours	0.95

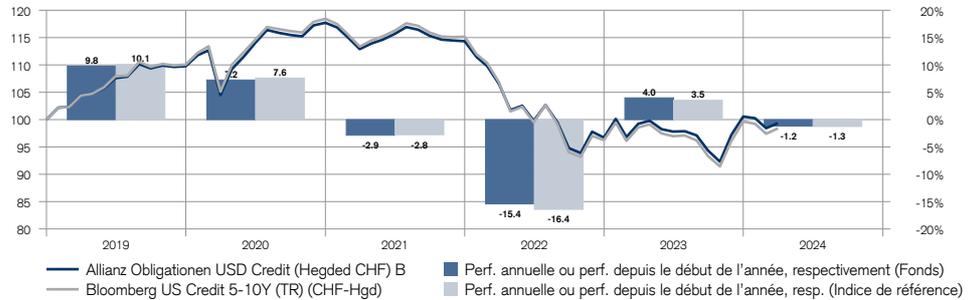
Maturité en années



Statistiques

	3 ans	5 ans
Volatilité, annualisée	8.26	8.05
Volatilité de l'indice de référence, annualisée	8.59	8.31
Tracking error, annualisé	0.64	0.56
Alpha	0.02	0.01
Beta	0.96	0.97
Ratio de Sharpe	-0.56	-0.12
Ratio d'information	0.69	0.33
Corrélation à l'indice de référence	1.00	1.00

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



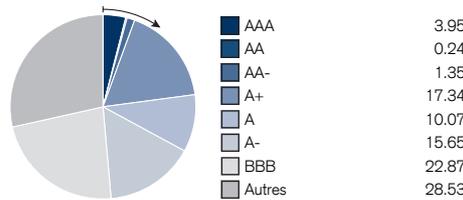
Performance nette au 31.03.2024

	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	3 ans	5 ans	3 ans	5 ans
	%	%	%	%	%	%	% p.a.	% p.a.
Fonds CHF	0.94	-1.20	5.33	0.12	-12.00	-4.87	-4.17	-0.99
Indice de référence CHF	1.00	-1.26	5.44	-0.19	-13.21	-5.75	-4.62	-1.18

Performance nette année civile

	2019	2020	2021	2022	2023	YTD
	%	%	%	%	%	%
Fonds CHF	9.76	7.24	-2.86	-15.42	3.98	-1.20
Indice de référence CHF	10.06	7.61	-2.77	-16.42	3.53	-1.26

Cote de crédit en %



Pays en %

	Fonds 02.24	Fonds 03.24
Etats Unis	72.41	73.35
Royaume-Uni	8.39	8.75
Japon	3.05	4.00
Supranational	3.09	3.02
Pays-Bas	1.41	1.36
Irlande	0.56	0.85
France	0.32	0.81
Liquidités/équivalents de liquidités	7.45	4.58
Autres	3.32	3.28

Secteurs en %

	Fonds 02.24	Fonds 03.24
Sociétés financières	33.82	34.51
Santé	12.46	13.37
Services aux collectivités	10.89	10.92
Services de communication	8.39	8.05
Energie	7.02	6.75
Immobilier	6.63	6.36
Biens de consommation (non cycliques)	7.23	6.07
Technologie	4.11	3.95
Autres	9.45	10.02

Principaux débiteurs

Débiteurs obligations	Identification	en %
JPMorgan Chase & Co	448037	3.48
Bank of America Corp	32938	3.16
Morgan Stanley	46010997	2.55
European Investment Bank EIB	115860964	2.27
Wells Fargo & Co	53731199	2.02
Total		13.48

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. Toutes références à CS peuvent également inclure UBS AG, ses sociétés affiliées, ses filiales et ses succursales. 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 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'investisseurs de prévoyance domiciliés en Suisse et exonérés d'impôts (art. 5 des statuts).
Copyright © 2024 Credit Suisse Group AG et/ou sociétés affiliées. Tous droits réservés.