

Assenagon Alpha Premium P (LU2053561937)

KAG: Assenagon AM ISIN: LU2053561937 Rücknahmepreis: 58,36 EUR Stand: 16.05.2024

Auflagedatum	10.12.19
Ausgabeaufschlag	4,00%
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondvolumen	220.31 Mio.
Ertragstyp	ausschüttend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Volatility
Fondsmanager	Daniel Danon, Tobias...



Kapitalanlagegesellschaft	
Assenagon AM	
1B Heienhaff	
1736 Senningerberg	
Luxemburg	
https://www.assenagon.com	

Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance	vor AGA	+6,19%	+4,84%	-
Performance	nach max. AGA	+2,10%	+3,48%	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		0,68	0,15	-
Volatilität		+3,54%	+6,68%	-

* Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Fondsstrategie

Der Fonds verfolgt das Ziel, durch die Vereinnahmung von Risikoprämien am Volatilitätsmarkt mittelfristig einen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Zwischenzeitliche Wertschankungen werden dabei toleriert. Der Fonds wird aktiv verwaltet, ohne dass die Investitionen auf ein bestimmtes Benchmarkuniversum beschränkt sind. Zur Berechnung der Performance Fee wird die Wertentwicklung des Fonds mit dem 1-Monats Euribor +2% p.a. verglichen.

Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatiliäts-Strategien und einem Basisportfolio. Die Volatilitäts-Strategien nutzen strukturelle oder temporäre Ineffizienzen an den globalen Derivatenmärkten. Dazu gehört, dass die für einen Zeitraum erwartete Volatilität oft höher ist als die sich im Zeitverlauf realisierende Volatilität.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des Assenagon Alpha Premium P wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Premium P kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: die von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder seinen Gebietskörperschaften oder von einem Mitgliedstaat der OECD oder von internationalen Organismen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen ein oder mehrere Mitglied-staaten der Europäischen Union angehören, oder von anderen von der CSSF anerkannten Staaten (wie z. B. Brasilien, Singapur, Russland, Indonesien oder Südaf-rika) begeben oder garantiert werden.

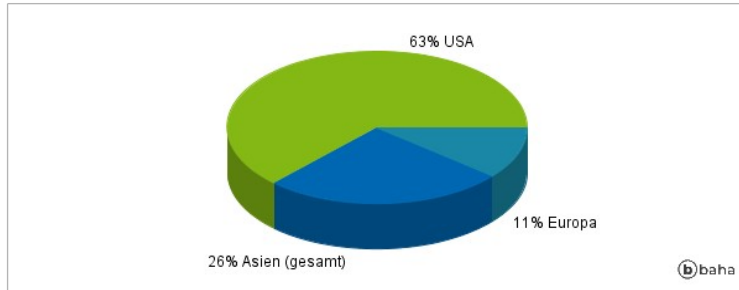
Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2024

Erstellt: 19.05.2024 00:23