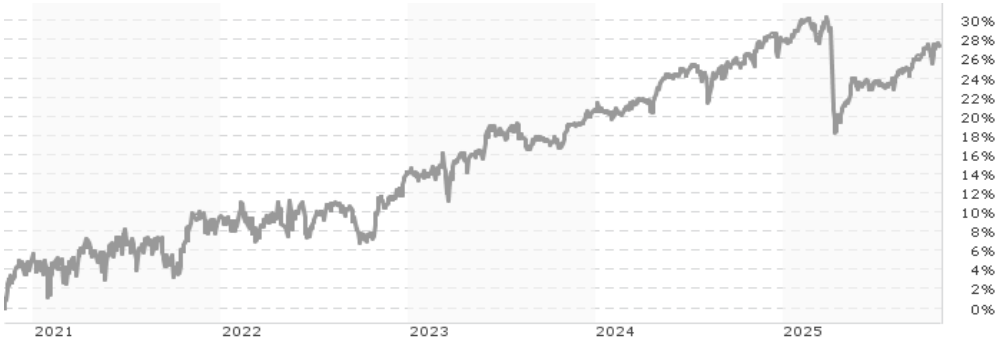
Assenagon Alpha Premium (I2R) / LU2053560962 / A2PR13 / Assenagon AM

Aktuell 31.10.2025 [1]	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
1229,25 EUR	weltweit	AI Volatility	thesaurierend	Alternative Investm.



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

Risikokennzahlen

SRI 1 2 **3** 4 5 6 7

Jahresperformance

2024	+6,19%
2023	+5,69%
2022	+4,06%
2021	+4,36%
2020	+1,58%

Stammdaten

Fondart	Einzelfond
Kategorie	Alternative Investments
Fondsunterkategorie	AI Volatility
Ursprungsland	Luxemburg
Tranchenvolumen	(31.10.2025) EUR 3,05 Mio.
Gesamt-Fondsvolumen	(31.10.2025) EUR 151,67 Mio.
Auflagedatum	10.12.2019
KESt-Meldefonds	Nein
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.
Nachhaltigkeitsfondsart	-
Fondsmanager	Daniel Danon, Tobias Knecht
Thema	-

Konditionen

Ausgabeaufschlag	0,00%
Managementgebühr	0,95%
Depotgebühr	0,05%
Tilgungsgebühr	0,00%
Sonstige lfd. Kosten	(05.03.2025) 1,15%
Transaktionskosten	0,37%

Sonstige Kennzahlen

Mindestveranlagung	EUR 0,00
Sparplan	Nein
UCITS / OGAW	Ja
Gewinnbeteiligung	0,00%
Umschichtgebühr	0,00%

Fondsgesellschaft

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

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	+0,70%	+5,16%	-0,45%	+1,22%	+8,40%	+16,01%	+30,35%	+22,93%
Performance p.a.	-	-	-	+1,22%	+4,11%	+5,07%	+5,45%	+3,56%
Performance p.a. nach max. AGA	+0,70%	+5,16%	-0,45%	+1,22%	+4,11%	+5,07%	+5,45%	+3,56%
Sharpe Ratio	1,16	2,10	-0,32	-0,10	0,33	0,51	0,46	0,18
Volatilität	5,69%	4,03%	8,23%	7,88%	6,20%	5,97%	7,39%	8,38%
Schlechtester Monat	-	-6,06%	-6,06%	-6,06%	-6,06%	-6,06%	-6,06%	-6,06%
Bester Monat	-	+1,76%	+1,76%	+1,76%	+1,76%	+2,32%	+5,65%	+5,65%
Maximaler Verlust	-1,56%	-1,56%	-9,16%	-9,16%	-9,16%	-9,16%	-9,16%	-12,22%

Vertriebszulassung

Österreich,Deutschland,Schweiz;

1. Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 04.11.2025 10:45

Assenagon Alpha Premium (I2R) / LU2053560962 / A2PR13 / Assenagon AM

Investmentstrategie

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 Derivatemärkten. Dazu gehört, dass die für einen Zeitraum erwartete Volatilität oft höher ist als die sich im Zeitverlauf realisierende Volatilität. Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch Terminkontrakte abgesichert werden. Das Basisportfolio des Fonds zielt darauf ab, Wertbeiträge in Höhe des kurzfristigen Rentenmarkts zu erzielen. Je nach Marktphasen und identifizierten Chancen für die Investment-Strategien können, zwischen 0 % und 100% in das Basisportfolio investiert werden. Zur Umsetzung der Anlagestrategie nutzt der Fonds vor allem Derivate. Eingesetzt werden vor allem Swaps, Optionen, Forwards und Futures, auf Einzeltitel, Körbe von Einzeltiteln, Indizes und abgeleitete Größen wie Zinssätze, Volatilität oder Varianz. Derivate können sowohl zu Anlage- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden.

Fondsspezifische Informationen

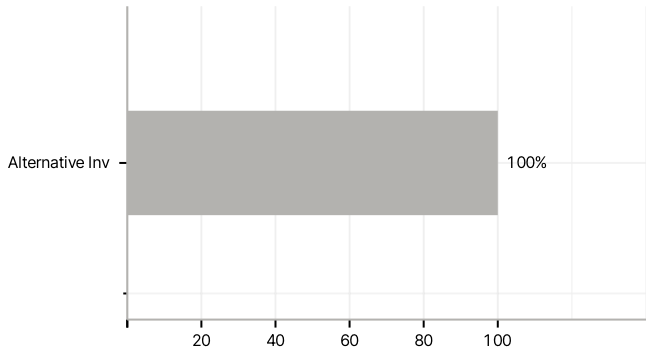
Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Assenagon Alpha Premium (I2R) wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Premium (I2R) kann mehr als 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-rechtli-chen 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.

Investmentziel

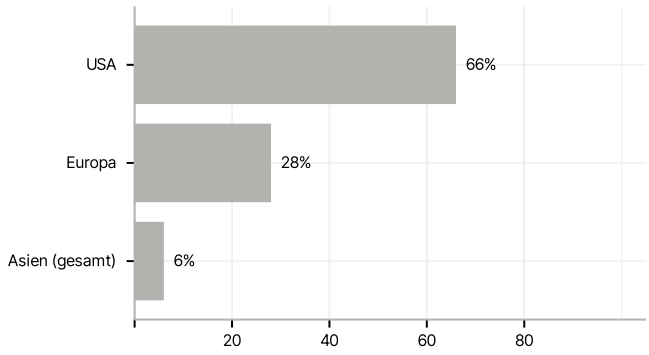
Der Fonds verfolgt das Ziel, durch die Vereinnahmung von Risikoprämien am Volatilitätsmarkt mittelfristig einen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Zwischenzeitliche Wertschwankungen werden dabei toleriert. Der Fonds wird aktiv verwaltet, ohne dass die Investitionen auf ein bestimmtes Benchmarkuniversum beschränkt sind. Alle Erträge verbleiben im Fonds und erhöhen den Wert der Anteile.

Veranlagungsstruktur

Anlagearten



Länder



RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 04.11.2025 10:45