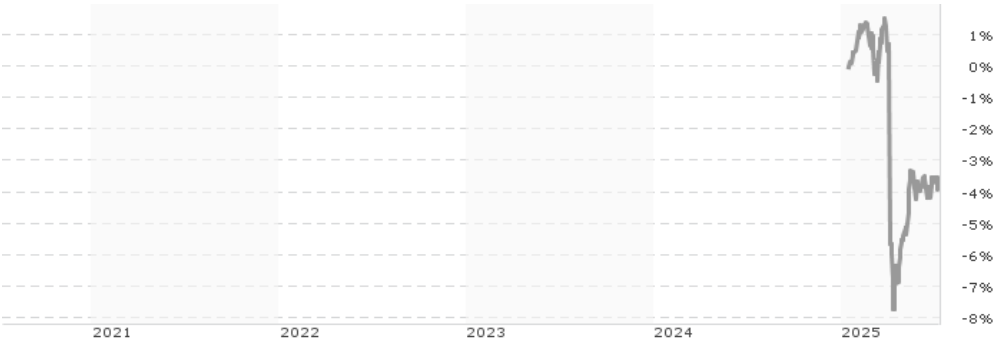


Assenagon Alpha Premium (I) / LU2053560889 / A2PR12 / Assenagon AM

Aktuell 09.07.2025 ¹	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
962,13 EUR	weltweit	AI Volatility	ausschüttend	Alternative Investm.



Risikokennzahlen							
SRI	1	2	3	4	5	6	7
Jahresperformance							

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

Stammdaten		Konditionen		Sonstige Kennzahlen	
Fondart	Einzelfond	Ausgabeaufschlag	0,00%	Mindestveranlagung	EUR 0,00
Kategorie	Alternative Investments	Managementgebühr	0,75%	Sparplan	Nein
Fondsunterkategorie	AI Volatility	Depotgebühr	0,01%	UCITS / OGAW	Ja
Ursprungsland	Luxemburg	Tilgungsgebühr	0,00%	Gewinnbeteiligung	15,00%
Tranchenvolumen	(09.07.2025) EUR 1,76 Mio.	Sonstige lfd. Kosten (05.03.2025)	0,96%	Umschichtgebühr	0,00%
Gesamt-Fondsvolumen	(09.07.2025) EUR 259,88 Mio.	Transaktionskosten	0,37%	Fondsgesellschaft	
Auflagedatum	16.01.2025	Assenagon AM			
KESSt-Meldefonds	Ja	1B Heienhaff, 1736, Senningerberg			
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.	Luxemburg			
Nachhaltigkeitsfondsart	-	https://www.assenagon.com			
Fondsmanager	Daniel Danon, Tobias Knecht				
Thema	-				

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	-0,30%	-3,79%	-3,79%	-	-	-	-	-3,79%
Performance p.a.	-	-	-	-	-	-	-	-
Performance p.a. nach max. AGA	-0,30%	-3,79%	-3,79%	-	-	-	-	-
Sharpe Ratio	-1,52	-	-	-	-	-	-	-0,94
Volatilität	3,74%	-	-	-	-	-	-	10,35%
Schlechtester Monat	-	-6,04%	-6,04%	-6,04%	-	-	-	-6,04%
Bester Monat	-	+1,78%	+1,78%	+1,78%	-	-	-	+1,78%
Maximaler Verlust	-0,74%	-	-	-	-	-	-	-9,11%

Vertriebszulassung
Österreich, Deutschland, Schweiz, Tschechien;

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 Wertpapiers oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapiers 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 10.07.2025 12:52

Assenagon Alpha Premium (I) / LU2053560889 / A2PR12 / Assenagon AM

Investmentstrategie

Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatilitäts-Strategien und einem Basisportfolio. Die Volatilitäts-Strategien nutzen strukturelle oder temporäre Ineffizienzen an den globalen Derivatemarkten. 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

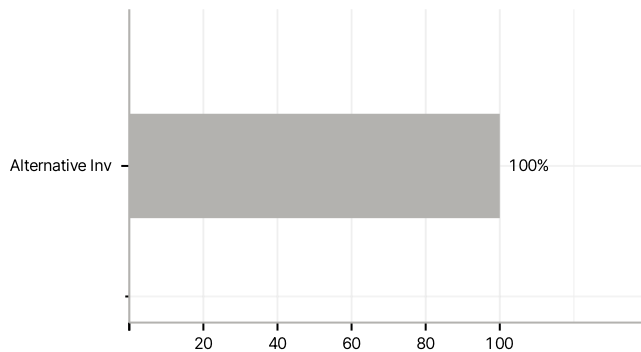
Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Assenagon Alpha Premium (I) wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Premium (I) kann mehr als 35 % 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 Mitgliedstaaten der Europäischen Union angehören, oder von anderen von der CSSF anerkannten Staaten (wie z. B. Brasilien, Singapur, Russland, Indonesien oder Südafrika) 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

