

assenagon

Halbjahres-
bericht

Assenagon Alpha

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2024

Investmentfonds nach luxemburgischem Recht
"Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples"

R.C.S K72

Inhalt

Verwaltung und Administration

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

- Wertpapierbestand und sonstige Vermögensgegenstände
- Zusammensetzung des Nettoteilfondsvermögens
- Aufwands- und Ertragsrechnung sowie Entwicklung des Nettoteilfondsvermögens
- Statistische Angaben

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

- Wertpapierbestand und sonstige Vermögensgegenstände
- Zusammensetzung des Nettoteilfondsvermögens
- Aufwands- und Ertragsrechnung sowie Entwicklung des Nettoteilfondsvermögens
- Statistische Angaben

Konsolidierte Darstellung

- Zusammensetzung des Nettofondsvermögens
- Aufwands- und Ertragsrechnung sowie Entwicklung des Nettofondsvermögens

Erläuterungen zum Halbjahresbericht

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Risikomanagementverfahren (ungeprüft)

Angaben zur Mitarbeitervergütung (ungeprüft)

Sonstige Angaben (ungeprüft)

Wichtige Hinweise

Auf der alleinigen Grundlage dieses Halbjahresberichts können keine Zeichnungen vorgenommen werden. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage der wesentlichen Anlegerinformationen bzw. Basisinformationsblätter und des aktuellen ausführlichen Verkaufsprospekts erfolgen, ergänzt durch den jeweiligen letzten Jahresbericht inklusive geprüftem Jahresabschluss. Wenn der Stichtag des Jahresberichts länger als acht Monate zurückliegt, ist dem Erwerber auch ein Halbjahresbericht auszuhändigen.

Gemäß den gesetzlichen Bestimmungen in Luxemburg und in allen anderen maßgeblichen Rechtsgebieten sind die wesentlichen Anlegerinformationen bzw. Basisinformationsblätter und der ausführliche Verkaufsprospekt, die Jahresberichte, inklusive geprüftem Jahresabschluss (sofern zutreffend) sowie die ungeprüften Halbjahresberichte kostenfrei am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft des Fonds erhältlich.

Zusätzliche Informationen für die Anleger in der Schweiz

Der Prospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger, das Fondsreglement, die jährlichen und halbjährlichen Berichte, auf Deutsch, sowie weitere Informationen sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz erhältlich: REYL & Cie Ltd, Rue du Rhône 4, CH-1204 Geneva, Switzerland, Tel.: +41 22 816 80 00, www.reyl.com, contact@reyl.com. Zahlstelle in der Schweiz ist REYL & Cie Ltd, Rue du Rhône 4, CH-1204 Geneva, Switzerland, Tel.: +41 22 816 80 00, www.reyl.com, contact@reyl.com. Die aktuellen Anteilepreise können unter www.fundinfo.com abgerufen werden.

Verwaltung und Administration

Verwaltungsgesellschaft

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

Dr. Stephan Höcht
Matthias Kunze
Jens Meiser
Dr. Dr. Heimo Plössnig
Thomas Romig
Philip Seegerer

Register- und Transferstelle

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80 route d'Esch, BP.403
1470 Luxemburg
Luxemburg

Informationsstelle für Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Landsberger Straße 346
80687 München
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Commission de Surveillance du Secteur Financier
(CSSF)
283, Route d'Arlon
2991 Luxemburg
Luxemburg

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

KoppaKontor GmbH, vertreten durch Dr. Immo Querner
(Vorsitzender)
Hans Günther Bonk
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig

Verwahrstelle, Zentralverwaltung, Zahlstelle für Luxemburg, Deutschland, Österreich und Spanien

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80 route d'Esch, BP.403
1470 Luxemburg
Luxemburg

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland und Spanien

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Landsberger Straße 346
80687 München
Deutschland

Wirtschaftsprüfer des Fonds und der Verwaltungsgesellschaft

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée
20 Boulevard de Kockelscheuer
1821 Luxemburg
Luxemburg

Kontaktstelle für Österreich, Deutschland und Spanien

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
Deutschland					
DE0001141802	Bundesschatzanweisungen 0 %, 18.10.2024	27.000.000	EUR	26.733.260,25	2,00
DE0001102390	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,5 %, 15.02.2026	40.000.000	EUR	38.528.070,00	2,88
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	47.000.000	EUR	46.862.489,75	3,51
DE0001104909	Bundesschatzanweisungen 2,2 %, 12.12.2024	30.000.000	EUR	29.851.875,00	2,23
DE000BU22007	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 13.03.2025	40.000.000	EUR	39.778.550,00	2,98
DE000BU22049	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 19.03.2026	37.000.000	EUR	36.760.310,67	2,75
DE000BU22015	Bundesschatzanweisungen 2,8 %, 12.06.2025	40.000.000	EUR	39.846.832,00	2,98
DE000BU22056	Bundesschatzanweisungen 2,9 %, 18.06.2026	35.000.000	EUR	35.050.535,45	2,62
DE000BU22031	Bundesschatzanweisungen 3,1 %, 12.12.2025	50.000.000	EUR	50.071.200,00	3,75
DE000BU22023	Bundesschatzanweisungen 3,1 %, 18.09.2025	40.000.000	EUR	40.008.900,00	2,99
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				383.492.023,12	28,69
Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.				383.492.023,12	28,69
Tagesgelder					
Kontrahent	Zinssatz		Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland					
	DekaBank 3,58 %, Tagesgeld		EUR	115.000.000,00	8,60
	DZ Bank AG 3,55 %, Tagesgeld		EUR	125.000.000,00	9,35
	Commerzbank 3,65 %, Tagesgeld		EUR	120.094.112,00	8,99
				360.094.112,00	26,94
Schweiz					
	Zürcher Kantonalbank 3,00 %, Tagesgeld		EUR	110.000.000,00	8,23
				110.000.000,00	8,23
Summe Tagesgelder				470.094.112,00	35,17
Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.500,00)	2.100	EUR	178.281,15	0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.500,00)	1.200	EUR	101.874,94	0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.500,00)	-1.200	EUR	-101.874,94	-0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.500,00)	-2.100	EUR	-178.281,15	-0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.800,00)	2.200	EUR	213.230,87	0,02
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.800,00)	-2.200	EUR	-213.230,87	-0,02

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.000,00)	2.300	EUR	243.884,66	0,02
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.000,00)	-2.300	EUR	-243.884,66	-0,02
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	1.600	EUR	212.951,32	0,02
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	1.400	EUR	186.332,40	0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	-1.400	EUR	-186.332,40	-0,01
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	-1.600	EUR	-212.951,32	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (call, strike 4.903,00)	1.080	EUR	168.660,02	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (put, strike 4.903,00)	-1.080	EUR	-140.673,24	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (call, strike 4.956,00)	-1.400	EUR	-176.299,80	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (put, strike 4.956,00)	1.400	EUR	213.584,35	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (call, strike 4.966,00)	360	EUR	43.406,51	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (put, strike 4.966,00)	-360	EUR	-56.563,10	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (call, strike 4.975,00)	-1.485	EUR	-172.041,63	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (put, strike 4.975,00)	1.485	EUR	239.562,93	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (call, strike 4.992,00)	-1.000	EUR	-107.195,09	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2024 (put, strike 4.992,00)	1.000	EUR	169.518,20	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.700,00)	7.200	EUR	150.823,61	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.700,00)	-7.200	EUR	-150.823,61	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	10.200	EUR	249.699,07	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	8.500	EUR	208.082,56	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	7.000	EUR	171.362,11	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	7.000	EUR	171.362,11	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-5.000	EUR	-122.401,51	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-5.200	EUR	-127.297,57	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-7.000	EUR	-171.362,11	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-7.000	EUR	-171.362,11	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-8.500	EUR	-208.082,56	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	10.000	EUR	286.043,00	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	5.800	EUR	165.904,94	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	5.500	EUR	157.323,65	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	4.700	EUR	134.440,21	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-4.700	EUR	-134.440,21	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.500	EUR	-157.323,65	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.800	EUR	-165.904,94	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-10.000	EUR	-286.043,00	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	2.700	EUR	2.632.928,58	0,20
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	2.500	EUR	2.437.896,84	0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	2.500	EUR	2.437.896,84	0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	2.000	EUR	1.950.317,47	0,15
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	2.000	EUR	1.950.317,47	0,15
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-2.437.896,84	-0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-2.437.896,84	-0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.700	EUR	-2.632.928,58	-0,20
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-3.900.634,94	-0,29
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	15.000	EUR	505.202,22	0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	12.000	EUR	404.161,78	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	11.500	EUR	387.321,70	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	11.000	EUR	370.481,63	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	9.000	EUR	303.121,33	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	8.000	EUR	269.441,18	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	7.700	EUR	259.337,14	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	5.400	EUR	181.872,80	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	5.000	EUR	168.400,74	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	4.500	EUR	151.560,67	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	2.700	EUR	90.936,40	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	2.500	EUR	84.200,37	0,01

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	2.500	EUR	84.200,37	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	2.000	EUR	67.360,30	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	2.000	EUR	67.360,30	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-84.200,37	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-84.200,37	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.700	EUR	-90.936,40	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-134.720,59	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.000	EUR	-168.400,74	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.000	EUR	-168.400,74	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.400	EUR	-181.872,80	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.500	EUR	-252.601,11	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.500	EUR	-252.601,11	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.500	EUR	-252.601,11	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.700	EUR	-259.337,14	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-9.000	EUR	-303.121,33	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-11.000	EUR	-370.481,63	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-11.500	EUR	-387.321,70	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-12.000	EUR	-404.161,78	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.100,00)	3.300	EUR	2.913.908,56	0,22
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.100,00)	-3.300	EUR	-2.913.908,56	-0,22
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	7.500	EUR	298.248,71	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	7.500	EUR	298.248,71	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	3.500	EUR	139.182,73	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	3.300	EUR	131.229,43	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.300	EUR	-131.229,43	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.500	EUR	-139.182,73	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.700	EUR	-147.136,03	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.800	EUR	-151.112,68	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-7.500	EUR	-298.248,71	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	5.100	EUR	4.039.887,90	0,30
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	4.500	EUR	3.564.606,97	0,27
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	3.200	EUR	2.534.831,62	0,19
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	3.000	EUR	2.376.404,65	0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	2.200	EUR	1.742.696,74	0,13
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	1.900	EUR	1.505.056,28	0,11
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	300	EUR	237.640,46	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.200	EUR	-1.742.696,74	-0,13
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.300	EUR	-1.821.910,23	-0,14
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.600	EUR	-2.059.550,69	-0,15
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.600	EUR	-2.059.550,69	-0,15
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.800	EUR	-2.217.977,67	-0,17
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-3.200	EUR	-2.534.831,62	-0,19
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-4.500	EUR	-3.564.606,97	-0,27
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	8.000	EUR	377.130,14	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.100	EUR	240.420,46	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.000	EUR	235.706,34	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	4.500	EUR	212.135,70	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.200	EUR	150.852,05	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.000	EUR	141.423,80	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	2.200	EUR	103.710,79	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	1.900	EUR	89.568,41	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	300	EUR	14.142,38	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.200	EUR	-103.710,79	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.300	EUR	-108.424,91	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.600	EUR	-122.567,29	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.600	EUR	-122.567,29	-0,01

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.800	EUR	-131.995,55	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-3.200	EUR	-150.852,05	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-4.500	EUR	-212.135,70	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-5.000	EUR	-235.706,34	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-8.000	EUR	-377.130,14	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	2.200	EUR	1.546.653,89	0,12
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	1.750	EUR	1.230.292,87	0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	1.750	EUR	1.230.292,87	0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	-2.200	EUR	-1.546.653,89	-0,12
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	-3.500	EUR	-2.460.585,74	-0,18
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	2.200	EUR	123.801,41	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	1.750	EUR	98.478,39	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	1.750	EUR	98.478,39	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-2.200	EUR	-123.801,41	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-3.500	EUR	-196.956,78	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 100,00)	28.000	EUR	3.452.177,40	0,26
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 110,00)	12.000	EUR	16.191.955,80	1,21
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 110,00)	37.400	EUR	7.388.715,95	0,55
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 120,00)	13.200	EUR	4.130.366,46	0,31
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 130,00)	6.000	EUR	2.899.982,70	0,22
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 3.900,00)	-4.200	EUR	-286.578,26	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.000,00)	-4.500	EUR	-353.315,58	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.000,00)	-4.800	EUR	-376.869,95	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.000,00)	-6.000	EUR	-471.087,44	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.000,00)	-14.000	EUR	-1.099.204,02	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.100,00)	-4.000	EUR	-361.348,44	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.100,00)	-4.500	EUR	-406.516,99	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.100,00)	-8.400	EUR	-758.831,72	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	4.000	EUR	415.877,38	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-4.600	EUR	-478.258,98	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-5.200	EUR	-540.640,59	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-6.400	EUR	-665.403,80	-0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-7.500	EUR	-779.770,08	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-7.700	EUR	-800.563,95	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-10.100	EUR	-1.050.090,37	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-12.200	EUR	-1.268.426,00	-0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.300,00)	6.000	EUR	719.287,84	0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.300,00)	-4.600	EUR	-551.454,01	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.300,00)	-6.000	EUR	-719.287,84	-0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.300,00)	-7.000	EUR	-839.169,14	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.400,00)	-1.800	EUR	-1.170.947,01	-0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.400,00)	-2.300	EUR	-1.496.210,07	-0,11
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.400,00)	-3.900	EUR	-2.537.051,86	-0,19
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.400,00)	4.300	EUR	593.579,22	0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.400,00)	-1.800	EUR	-248.475,02	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.400,00)	-2.300	EUR	-317.495,86	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.400,00)	-3.900	EUR	-538.362,54	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.400,00)	-4.300	EUR	-593.579,22	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.500,00)	-5.300	EUR	-3.047.520,95	-0,23
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.500,00)	-5.300	EUR	-843.598,11	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.500,00)	-7.000	EUR	-1.114.186,19	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (put, strike 4.500,00)	-8.200	EUR	-1.305.189,53	-0,10
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	3.600	EUR	1.810.078,87	0,14
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	1.000	EUR	502.799,69	0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	-2.000	EUR	-1.005.599,37	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	-3.100	EUR	-1.558.679,03	-0,12

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	-3.600	EUR	-1.810.078,87	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	-4.300	EUR	-2.162.038,65	-0,16
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.600,00)	-7.300	EUR	-3.670.437,72	-0,27
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	3.600	EUR	661.014,48	0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	2.000	EUR	367.230,27	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	1.000	EUR	183.615,13	0,01
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-2.000	EUR	-367.230,27	-0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-3.100	EUR	-569.206,91	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-3.600	EUR	-661.014,48	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.200	EUR	-771.183,56	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.300	EUR	-789.545,07	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.500	EUR	-826.268,10	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-7.300	EUR	-1.340.390,47	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-9.200	EUR	-1.689.259,22	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-11.500	EUR	-2.111.574,03	-0,16
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-11.700	EUR	-2.148.297,06	-0,16
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	1.000	EUR	434.391,80	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-1.900	EUR	-825.344,41	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-2.500	EUR	-1.085.979,49	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-3.500	EUR	-1.520.371,28	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-3.600	EUR	-1.563.810,46	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-4.000	EUR	-1.737.567,18	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-5.700	EUR	-2.476.033,23	-0,19
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.700,00)	-7.000	EUR	-3.040.742,57	-0,23
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	2.000	EUR	423.714,37	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	1.000	EUR	211.857,18	0,02
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-1.900	EUR	-402.528,65	-0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-2.500	EUR	-529.642,96	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-3.500	EUR	-741.500,14	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-3.600	EUR	-762.685,86	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.000	EUR	-847.428,73	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.500	EUR	-953.357,32	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.800	EUR	-1.016.914,48	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-7.000	EUR	-1.483.000,28	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-11.700	EUR	-2.478.729,04	-0,19
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.000	EUR	-741.094,89	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.100	EUR	-778.149,63	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.500	EUR	-926.368,61	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.700	EUR	-1.000.478,10	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.700	EUR	-1.000.478,10	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-5.000	EUR	-1.852.737,22	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.000	EUR	-489.325,55	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.100	EUR	-513.791,83	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.500	EUR	-611.656,94	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.700	EUR	-660.589,49	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.700	EUR	-660.589,49	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-5.000	EUR	-1.223.313,87	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-8.300	EUR	-2.030.701,02	-0,15
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-2.400	EUR	-748.018,24	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-2.800	EUR	-872.687,94	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-2.400	EUR	-677.854,89	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-2.800	EUR	-790.830,71	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.000	EUR	-516.104,87	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.000	EUR	-650.935,30	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 120,00)	6.000	EUR	2.583.939,60	0,19
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.000,00)	-21.500	EUR	-2.457.568,27	-0,18

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.200,00)	-9.200	EUR	-1.342.935,17	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.200,00)	-9.900	EUR	-1.445.115,02	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.400,00)	-8.900	EUR	-1.657.909,81	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-3.700	EUR	-777.861,26	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-4.000	EUR	-840.931,09	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-4.200	EUR	-882.977,64	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-5.000	EUR	-1.051.163,86	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-7.200	EUR	-1.513.675,96	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.500,00)	-8.300	EUR	-1.744.932,01	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.100	EUR	-971.589,67	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.100	EUR	-971.589,67	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.600,00)	-4.500	EUR	-1.066.378,91	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.700,00)	-2.600	EUR	-1.389.885,42	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.700,00)	-4.400	EUR	-2.352.113,79	-0,18
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-2.600	EUR	-693.365,15	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-3.500	EUR	-933.376,16	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.000	EUR	-1.066.715,61	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.200	EUR	-1.120.051,39	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.400	EUR	-1.173.387,17	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-4.500	EUR	-1.200.055,06	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-5.500	EUR	-1.466.733,96	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-7.000	EUR	-1.866.752,31	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.000	EUR	-944.860,81	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.000	EUR	-599.534,21	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.900,00)	-1.900	EUR	-786.897,83	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.900,00)	-1.900	EUR	-786.897,83	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 4.900,00)	-2.000	EUR	-828.313,50	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.900,00)	-1.900	EUR	-639.772,88	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.900,00)	-1.900	EUR	-639.772,88	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.900,00)	-2.000	EUR	-673.445,13	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.900,00)	-5.100	EUR	-1.717.285,09	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 4.900,00)	-5.500	EUR	-1.851.974,12	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.000	EUR	-720.490,25	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.200	EUR	-792.539,28	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.000	EUR	-756.080,12	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.200	EUR	-831.688,13	-0,06
Euro Stoxx Banks Index EUR	Sep 2024 (call, strike 139,35)	-50.400	EUR	-260.035,62	-0,02
Euro Stoxx Banks Index EUR	Sep 2024 (put, strike 139,35)	50.400	EUR	341.772,98	0,03
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (put, strike 110,00)	200.000	EUR	790.237,00	0,06
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (call, strike 120,00)	200.000	EUR	3.925.708,80	0,29
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (put, strike 120,00)	200.000	EUR	1.251.626,20	0,09
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (call, strike 130,00)	210.000	EUR	2.808.125,88	0,21
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (put, strike 130,00)	210.000	EUR	2.029.987,89	0,15
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (call, strike 140,00)	130.000	EUR	1.103.786,84	0,08
Euro Stoxx Banks Index EUR	Jun 2025 (put, strike 140,00)	130.000	EUR	1.878.531,72	0,14
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2025 (call, strike 120,00)	100.000	EUR	2.176.147,30	0,16
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2025 (put, strike 120,00)	100.000	EUR	861.313,20	0,06
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2025 (put, strike 130,00)	200.000	EUR	2.454.720,60	0,18
S&P 500 Index	Sep 2024 (call, strike 5.519,00)	-1.950	USD	-216.317,49	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2024 (put, strike 5.519,00)	1.950	USD	218.337,69	0,02
S&P 500 Index	Sep 2024 (call, strike 5.522,00)	-1.250	USD	-136.669,54	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (put, strike 5.522,00)	1.250	USD	141.420,28	0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (call, strike 5.523,00)	735	USD	79.972,34	0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (put, strike 5.523,00)	-735	USD	-83.443,10	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (call, strike 5.531,00)	-1.200	USD	-125.534,13	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (put, strike 5.531,00)	1.200	USD	140.047,34	0,01

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Sep 2024 (call, strike 5.571,00)	-1.300	USD	-110.295,11	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2024 (put, strike 5.571,00)	1.300	USD	173.937,25	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	6.000	USD	65.659,59	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.000	USD	-65.659,59	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 3.900,00)	5.000	USD	7.718.794,13	0,58
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-7.718.794,13	-0,58
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	13.000	USD	159.712,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	5.000	USD	61.427,82	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	3.500	USD	42.999,48	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	3.000	USD	36.856,69	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	2.100	USD	25.799,68	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-61.427,82	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.500	USD	-67.570,61	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-6.100	USD	-74.941,95	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-10.000	USD	-122.855,65	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	11.000	USD	151.961,65	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	7.500	USD	103.610,22	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	7.500	USD	103.610,22	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	6.000	USD	82.888,17	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	5.500	USD	75.980,83	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	5.500	USD	75.980,83	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	5.200	USD	71.836,42	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	4.900	USD	67.692,01	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	4.700	USD	64.929,07	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	4.500	USD	62.166,13	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-1.000	USD	-13.814,70	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.500	USD	-62.166,13	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.700	USD	-64.929,07	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.900	USD	-67.692,01	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.200	USD	-71.836,42	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.500	USD	-75.980,83	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-82.888,17	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.500	USD	-103.610,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-11.000	USD	-151.961,65	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-12.000	USD	-165.776,35	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.100,00)	2.500	USD	3.412.821,87	0,26
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.100,00)	-2.500	USD	-3.412.821,87	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	12.000	USD	186.244,59	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	6.500	USD	100.882,49	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	6.000	USD	93.122,30	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	2.500	USD	38.800,96	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-2.500	USD	-38.800,96	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-6.000	USD	-93.122,30	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-6.500	USD	-100.882,49	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-12.000	USD	-186.244,59	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	4.300	USD	5.488.037,53	0,41
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	3.500	USD	4.467.007,29	0,33
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	3.100	USD	3.956.492,17	0,30
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	3.000	USD	3.828.863,39	0,29
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	2.750	USD	3.509.791,44	0,26
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	2.500	USD	3.190.719,50	0,24
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	1.000	USD	1.276.287,80	0,10
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-200	USD	-255.257,56	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.500	USD	-3.190.719,50	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.750	USD	-3.509.791,44	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.900	USD	-3.701.234,61	-0,28

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-3.500	USD	-4.467.007,29	-0,33
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-5.105.151,18	-0,38
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-4.300	USD	-5.488.037,53	-0,41
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	14.200	USD	250.088,69	0,02
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	10.200	USD	179.641,18	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	10.000	USD	176.118,80	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	7.000	USD	123.283,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	7.000	USD	123.283,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	6.900	USD	121.521,97	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	6.500	USD	114.477,22	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	6.500	USD	114.477,22	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.700	USD	100.387,71	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.500	USD	96.865,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.500	USD	96.865,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.500	USD	96.865,34	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.300	USD	93.342,96	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	5.000	USD	88.059,40	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	4.900	USD	86.298,21	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	4.600	USD	81.014,65	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	4.300	USD	75.731,08	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.700	USD	65.163,96	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.700	USD	65.163,96	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.500	USD	61.641,58	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.100	USD	54.596,83	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	3.000	USD	52.835,64	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	2.750	USD	48.432,67	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	2.500	USD	44.029,70	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	1.500	USD	26.417,82	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	1.000	USD	17.611,88	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-200	USD	-3.522,38	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.000	USD	-35.223,76	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.500	USD	-44.029,70	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.750	USD	-48.432,67	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.900	USD	-51.074,45	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-3.500	USD	-61.641,58	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-70.447,52	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-70.447,52	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-4.300	USD	-75.731,08	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-4.500	USD	-79.253,45	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-5.000	USD	-88.059,40	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-5.400	USD	-95.104,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-5.500	USD	-96.865,34	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-6.000	USD	-105.671,28	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-6.500	USD	-114.477,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-6.500	USD	-114.477,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-7.000	USD	-123.283,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-7.000	USD	-123.283,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-7.000	USD	-123.283,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-7.200	USD	-126.805,53	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-9.200	USD	-162.029,29	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-10.000	USD	-176.118,80	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-26.400	USD	-464.953,62	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	4.000	USD	4.751.041,53	0,36
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	500	USD	593.880,19	0,04
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.300,00)	-4.500	USD	-5.344.921,72	-0,40
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	7.900	USD	158.133,61	0,01

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	7.100	USD	142.120,08	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	6.000	USD	120.101,48	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	5.500	USD	110.093,03	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	5.300	USD	106.089,64	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	4.000	USD	80.067,66	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	500	USD	10.008,45	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-4.500	USD	-90.076,11	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-5.300	USD	-106.089,64	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-6.000	USD	-120.101,48	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-9.500	USD	-190.160,68	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-11.000	USD	-220.186,05	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	4.900	USD	5.388.120,31	0,40
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	2.800	USD	3.078.925,89	0,23
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	2.100	USD	2.309.194,42	0,17
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	2.000	USD	2.199.232,78	0,16
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	1.600	USD	1.759.386,22	0,13
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	500	USD	549.808,19	0,04
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	-900	USD	-989.654,75	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	-2.400	USD	-2.639.079,34	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	-2.600	USD	-2.859.002,61	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	-3.100	USD	-3.408.810,80	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.400,00)	-4.900	USD	-5.388.120,31	-0,40
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	6.000	USD	136.832,21	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	6.000	USD	136.832,21	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	4.900	USD	111.746,30	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	4.200	USD	95.782,55	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	4.000	USD	91.221,48	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	2.800	USD	63.855,03	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	2.100	USD	47.891,27	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	2.000	USD	45.610,74	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	1.600	USD	36.488,59	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	1.000	USD	22.805,37	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	500	USD	11.402,69	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-900	USD	-20.524,83	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-2.400	USD	-54.732,89	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-2.600	USD	-59.293,96	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-3.100	USD	-70.696,65	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-4.200	USD	-95.782,55	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-4.900	USD	-111.746,30	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-5.000	USD	-114.026,84	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.400,00)	-12.000	USD	-273.664,43	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	4.700	USD	4.757.171,83	0,36
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	2.500	USD	2.530.410,55	0,19
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	2.500	USD	2.530.410,55	0,19
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	-2.500	USD	-2.530.410,55	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	-2.500	USD	-2.530.410,55	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.500,00)	-4.700	USD	-4.757.171,83	-0,36
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	6.500	USD	170.856,72	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	6.400	USD	168.228,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	6.000	USD	157.713,89	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	5.500	USD	144.571,07	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	4.700	USD	123.542,55	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	2.500	USD	65.714,12	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	2.500	USD	65.714,12	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-2.500	USD	-65.714,12	0,00
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-2.500	USD	-65.714,12	0,00

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermogen (%)
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-4.700	USD	-123.542,55	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-5.500	USD	-144.571,07	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-6.000	USD	-157.713,89	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-6.400	USD	-168.228,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.500,00)	-6.500	USD	-170.856,72	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.600,00)	2.900	USD	2.683.356,15	0,20
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.600,00)	-2.900	USD	-2.683.356,15	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.600,00)	2.900	USD	88.012,39	0,01
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.600,00)	-2.900	USD	-88.012,39	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	4.000	USD	174.854,63	0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-174.854,63	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.300,00)	-5.000	USD	-245.025,35	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.500,00)	-5.000	USD	-310.221,47	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.500,00)	-7.000	USD	-434.310,05	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.600,00)	-8.800	USD	-615.932,75	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-5.800	USD	-458.928,83	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-7.300	USD	-577.617,31	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-8.000	USD	-633.005,27	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.700,00)	-11.900	USD	-941.595,34	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	2.000	USD	1.783.181,95	0,13
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	1.000	USD	891.590,98	0,07
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-2.900	USD	-2.585.613,83	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-4.200	USD	-3.744.682,10	-0,28
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-4.900	USD	-4.368.795,78	-0,33
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-5.900	USD	-5.260.386,76	-0,39
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-6.000	USD	-5.349.545,85	-0,40
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-6.500	USD	-5.795.341,35	-0,43
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.800,00)	-6.500	USD	-5.795.341,35	-0,43
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	2.000	USD	179.513,53	0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	1.000	USD	89.756,76	0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-2.900	USD	-260.294,62	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-4.200	USD	-376.978,41	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-4.900	USD	-439.808,15	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-5.200	USD	-466.735,18	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-5.900	USD	-529.564,92	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-6.000	USD	-538.540,59	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-6.400	USD	-574.443,29	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-6.500	USD	-583.418,97	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-6.500	USD	-583.418,97	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-7.000	USD	-628.297,35	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-8.800	USD	-789.859,53	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.800,00)	-12.000	USD	-1.077.081,18	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	1.000	USD	814.848,43	0,06
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-2.500	USD	-2.037.121,06	-0,15
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-2.650	USD	-2.159.348,33	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-3.700	USD	-3.014.939,17	-0,23
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-3.800	USD	-3.096.424,02	-0,23
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-4.200	USD	-3.422.363,39	-0,26
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 4.900,00)	-5.900	USD	-4.807.605,72	-0,36
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	2.000	USD	203.500,74	0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	1.000	USD	101.750,37	0,01
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-2.500	USD	-254.375,94	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-2.650	USD	-269.638,49	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-3.700	USD	-376.476,38	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-3.800	USD	-386.651,42	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-4.200	USD	-427.351,57	-0,03

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-5.500	USD	-559.627,05	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-5.900	USD	-600.327,20	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-7.200	USD	-732.602,69	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 4.900,00)	-10.300	USD	-1.048.028,84	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.400	USD	-1.775.894,30	-0,13
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.500	USD	-1.849.889,90	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.900	USD	-2.145.872,28	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-2.900	USD	-2.145.872,28	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-3.100	USD	-2.293.863,48	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-3.600	USD	-2.663.841,46	-0,20
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.000,00)	-4.000	USD	-2.959.823,84	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.400	USD	-277.425,75	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.500	USD	-288.985,16	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.900	USD	-335.222,79	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-2.900	USD	-335.222,79	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-3.100	USD	-358.341,60	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-3.600	USD	-416.138,63	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-4.000	USD	-462.376,25	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.600	USD	-647.326,76	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-6.000	USD	-693.564,39	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.000,00)	-6.200	USD	-716.683,20	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.100,00)	-2.500	USD	-1.667.469,01	-0,12
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.100,00)	-2.500	USD	-1.667.469,01	-0,12
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.100,00)	-3.000	USD	-2.000.962,82	-0,15
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.100,00)	-3.800	USD	-2.534.552,90	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.100,00)	-4.400	USD	-2.934.745,46	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.100,00)	-2.500	USD	-328.404,67	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.100,00)	-2.500	USD	-328.404,67	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.100,00)	-3.000	USD	-394.085,60	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.100,00)	-3.800	USD	-499.175,09	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.100,00)	-4.400	USD	-577.992,21	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.200,00)	-2.600	USD	-1.549.731,92	-0,12
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.200,00)	-2.750	USD	-1.639.139,54	-0,12
S&P 500 Index	Jun 2025 (call, strike 5.200,00)	-3.500	USD	-2.086.177,59	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.200,00)	-2.600	USD	-387.819,02	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.200,00)	-2.750	USD	-410.193,19	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2025 (put, strike 5.200,00)	-3.500	USD	-522.064,06	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 4.600,00)	-8.800	USD	-932.501,28	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 4.700,00)	-5.200	USD	-612.020,67	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 4.800,00)	-4.900	USD	-640.552,02	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 4.800,00)	-10.500	USD	-1.372.611,49	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-4.000	USD	-643.855,99	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-4.500	USD	-724.337,99	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-4.700	USD	-756.530,79	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.000	USD	-804.819,99	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.000	USD	-804.819,99	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.200	USD	-837.012,78	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.500	USD	-885.301,98	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-5.600	USD	-901.398,39	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-6.000	USD	-965.783,98	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-7.200	USD	-1.158.940,78	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.000,00)	-7.500	USD	-1.207.229,98	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2025 (call, strike 5.100,00)	-2.400	USD	-1.906.908,13	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2025 (call, strike 5.100,00)	-3.100	USD	-2.463.089,68	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.100,00)	-2.400	USD	-428.373,73	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.100,00)	-3.100	USD	-553.316,08	-0,04

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.100,00)	-4.300	USD	-767.502,94	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.100,00)	-4.400	USD	-785.351,85	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2025 (call, strike 5.200,00)	-1.700	USD	-1.235.786,93	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2025 (call, strike 5.200,00)	-3.600	USD	-2.616.960,56	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.200,00)	-1.700	USD	-336.118,47	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.200,00)	-3.600	USD	-711.780,28	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.200,00)	-7.200	USD	-1.423.560,58	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.300,00)	-4.500	USD	-985.018,31	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2025 (call, strike 5.400,00)	-2.100	USD	-1.255.255,28	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2025 (put, strike 5.400,00)	-2.100	USD	-508.625,01	-0,04
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.000,00)	2.500	CHF	121.624,36	0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.000,00)	-2.500	CHF	-121.624,36	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.500,00)	3.600	CHF	266.252,56	0,02
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.500,00)	-1.600	CHF	-118.334,47	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.500,00)	-2.000	CHF	-147.918,09	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (call, strike 10.900,00)	850	CHF	1.136.873,73	0,09
Swiss Market Index	Dez 2024 (call, strike 10.900,00)	-850	CHF	-1.136.873,73	-0,09
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.900,00)	850	CHF	91.254,17	0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.900,00)	-850	CHF	-91.254,17	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (call, strike 11.000,00)	850	CHF	1.058.750,32	0,08
Swiss Market Index	Dez 2024 (call, strike 11.000,00)	-850	CHF	-1.058.750,32	-0,08
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 11.000,00)	1.800	CHF	213.684,61	0,02
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 11.000,00)	850	CHF	100.906,62	0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 11.000,00)	-850	CHF	-100.906,62	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 11.000,00)	-1.800	CHF	-213.684,61	-0,02
Swiss Market Index	Jun 2025 (put, strike 10.000,00)	2.200	CHF	297.229,80	0,02
Swiss Market Index	Jun 2025 (put, strike 10.000,00)	-2.200	CHF	-297.229,80	-0,02
Swiss Market Index	Dez 2025 (put, strike 10.500,00)	-4.000	CHF	-1.199.615,40	-0,09
Swiss Market Index	Dez 2025 (put, strike 11.000,00)	-3.500	CHF	-1.448.907,89	-0,11
Swiss Market Index	Dez 2025 (put, strike 11.000,00)	-3.800	CHF	-1.573.100,00	-0,12
Summe Indexoptionen				-201.107.517,78	-15,05
Summe Indexoptionen				-201.107.517,78	-15,05
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Allianz SE	Jun 2025 (put, strike 210,00)	3.200	EUR	1.646.569,28	0,12
Allianz SE	Jun 2025 (put, strike 220,00)	900	EUR	603.942,03	0,05
Allianz SE	Jun 2025 (call, strike 230,00)	2.500	EUR	10.542.463,75	0,79
Allianz SE	Jun 2025 (put, strike 230,00)	2.500	EUR	2.212.222,25	0,17
Allianz SE	Dez 2025 (put, strike 200,00)	6.000	EUR	3.542.693,40	0,27
Allianz SE	Dez 2025 (put, strike 250,00)	1.000	EUR	1.840.203,50	0,14
American Express Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	180.000	USD	32.560,90	0,00
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 55,00)	400.000	USD	204.128,95	0,02
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 55,00)	-400.000	USD	-204.128,95	-0,02
American International Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 57,50)	210.000	USD	3.589.451,48	0,27
American International Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 57,50)	-210.000	USD	-3.589.451,48	-0,27
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 57,50)	210.000	USD	143.640,39	0,01
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 57,50)	-210.000	USD	-143.640,39	-0,01
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 62,50)	400.000	USD	481.698,90	0,04
American International Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 62,50)	-400.000	USD	-481.698,90	-0,04
American International Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 65,00)	600.000	USD	1.659.398,18	0,12
American International Group, Inc.	Jun 2025 (call, strike 70,00)	210.000	USD	2.083.576,21	0,16
American International Group, Inc.	Jun 2025 (call, strike 70,00)	200.000	USD	1.984.358,29	0,15

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
American International Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 70,00)	400.000	USD	1.718.411,20	0,13
American International Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 70,00)	210.000	USD	902.165,88	0,07
American International Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 70,00)	200.000	USD	859.205,60	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	-50.000	USD	-2.165.258,88	-0,16
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 160,00)	50.000	USD	2.584.556,52	0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 160,00)	-50.000	USD	-2.584.556,52	-0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	240.000	USD	248.258,87	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	150.000	USD	155.161,79	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	50.000	USD	51.720,60	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	-50.000	USD	-51.720,60	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	-150.000	USD	-155.161,79	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	-240.000	USD	-248.258,87	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 165,00)	130.000	USD	174.301,04	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 165,00)	-130.000	USD	-174.301,04	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	100.000	USD	4.330.517,75	0,32
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	100.000	USD	4.330.517,75	0,32
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	70.000	USD	3.031.362,43	0,23
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	70.000	USD	3.031.362,43	0,23
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	50.000	USD	2.165.258,88	0,16
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	-40.000	USD	-1.732.207,10	-0,13
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	-60.000	USD	-2.598.310,65	-0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	-70.000	USD	-3.031.362,43	-0,23
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	-170.000	USD	-7.361.880,18	-0,55
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	150.000	USD	258.567,39	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	150.000	USD	258.567,39	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	150.000	USD	258.567,39	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	120.000	USD	206.853,91	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	100.000	USD	172.378,26	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	100.000	USD	172.378,26	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	70.000	USD	120.664,78	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	70.000	USD	120.664,78	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	50.000	USD	86.189,13	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-40.000	USD	-68.951,30	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-50.000	USD	-86.189,13	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-60.000	USD	-103.426,96	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-70.000	USD	-120.664,78	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-150.000	USD	-258.567,39	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-150.000	USD	-258.567,39	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-170.000	USD	-293.043,04	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	-270.000	USD	-465.421,30	-0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 180,00)	70.000	USD	2.477.248,30	0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 180,00)	-70.000	USD	-2.477.248,30	-0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	140.000	USD	406.161,98	0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	100.000	USD	290.115,70	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	70.000	USD	203.080,99	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	-70.000	USD	-203.080,99	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	-100.000	USD	-290.115,70	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 180,00)	-140.000	USD	-406.161,98	-0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 160,00)	80.000	USD	4.454.291,02	0,33
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 160,00)	-80.000	USD	-4.454.291,02	-0,33
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 160,00)	200.000	USD	520.048,52	0,04
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 160,00)	80.000	USD	208.019,41	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 160,00)	80.000	USD	208.019,41	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 160,00)	80.000	USD	208.019,41	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 160,00)	80.000	USD	208.019,41	0,02

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 165,00)	75.000	USD	3.884.663,20	0,29
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 165,00)	75.000	USD	238.213,51	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	125.000	USD	481.549,34	0,04
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 180,00)	150.000	USD	6.117.477,68	0,46
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 180,00)	100.000	USD	4.078.318,45	0,31
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	260.000	USD	1.452.148,09	0,11
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	150.000	USD	837.777,75	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	150.000	USD	837.777,75	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	120.000	USD	670.222,20	0,05
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	110.000	USD	614.370,35	0,05
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	100.000	USD	558.518,50	0,04
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (call, strike 190,00)	150.000	USD	5.125.002,66	0,38
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2025 (put, strike 190,00)	150.000	USD	1.195.876,00	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (call, strike 165,00)	70.000	USD	3.986.369,67	0,30
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 165,00)	70.000	USD	397.676,22	0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (call, strike 170,00)	50.000	USD	2.673.039,23	0,20
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	300.000	USD	1.970.839,19	0,15
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	200.000	USD	1.313.892,79	0,10
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	130.000	USD	854.030,31	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	120.000	USD	788.335,68	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	50.000	USD	328.473,20	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 180,00)	100.000	USD	868.391,23	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2026 (put, strike 190,00)	200.000	USD	2.290.592,02	0,17
AXA S.A.	Dez 2024 (call, strike 26,00)	10.000	EUR	5.617.800,00	0,42
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 26,00)	-10.000	EUR	-549.226,00	-0,04
AXA S.A.	Jun 2025 (put, strike 24,00)	15.000	EUR	1.261.918,50	0,09
AXA S.A.	Jun 2025 (put, strike 26,00)	12.000	EUR	1.491.694,80	0,11
AXA S.A.	Jun 2025 (put, strike 28,00)	12.000	EUR	2.175.406,80	0,16
AXA S.A.	Jun 2025 (call, strike 30,00)	3.200	EUR	998.689,60	0,07
AXA S.A.	Jun 2025 (put, strike 30,00)	3.200	EUR	836.189,76	0,06
AXA S.A.	Dez 2025 (put, strike 26,00)	15.000	EUR	2.433.736,50	0,18
AXA S.A.	Dez 2025 (put, strike 28,00)	24.000	EUR	5.389.802,40	0,40
AXA S.A.	Dez 2025 (call, strike 32,00)	3.000	EUR	739.544,70	0,06
AXA S.A.	Dez 2025 (put, strike 32,00)	3.000	EUR	1.226.397,30	0,09
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 26,00)	450.000	USD	5.967.050,38	0,45
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 26,00)	-450.000	USD	-5.967.050,38	-0,45
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 26,00)	750.000	USD	96.545,84	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 26,00)	450.000	USD	57.927,50	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 26,00)	-450.000	USD	-57.927,50	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 26,00)	-750.000	USD	-96.545,84	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	400.000	USD	4.600.349,34	0,34
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	400.000	USD	4.600.349,34	0,34
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	400.000	USD	4.600.349,34	0,34
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	350.000	USD	4.025.305,67	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	-750.000	USD	-8.625.655,00	-0,65
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	-800.000	USD	-9.200.698,67	-0,69
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	900.000	USD	173.790,06	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	850.000	USD	164.135,06	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	400.000	USD	77.240,03	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	400.000	USD	77.240,03	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	400.000	USD	77.240,03	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	350.000	USD	67.585,02	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	-750.000	USD	-144.825,05	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	-850.000	USD	-164.135,06	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	-1.700.000	USD	-328.270,12	-0,02

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermogen (%)
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 30,00)	400.000	USD	3.913.124,52	0,29
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 30,00)	-400.000	USD	-3.913.124,52	-0,29
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 30,00)	700.000	USD	209.047,73	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 30,00)	400.000	USD	119.455,84	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 30,00)	-400.000	USD	-119.455,84	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 30,00)	-700.000	USD	-209.047,73	-0,02
Bank of America Corp.	Jun 2025 (call, strike 32,00)	800.000	USD	7.117.254,58	0,53
Bank of America Corp.	Jun 2025 (call, strike 32,00)	600.000	USD	5.337.940,94	0,40
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	1.500.000	USD	1.371.249,83	0,10
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	1.200.000	USD	1.096.999,86	0,08
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	850.000	USD	777.041,57	0,06
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	800.000	USD	731.333,24	0,05
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	800.000	USD	731.333,24	0,05
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 32,00)	600.000	USD	548.499,93	0,04
Bank of America Corp.	Jun 2025 (call, strike 35,00)	400.000	USD	2.724.346,16	0,20
Bank of America Corp.	Jun 2025 (put, strike 35,00)	400.000	USD	608.106,37	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 35,00)	700.000	USD	1.544.247,35	0,12
Bank of America Corp.	Jan 2026 (call, strike 37,00)	300.000	USD	1.966.200,42	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 37,00)	700.000	USD	1.962.381,99	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 37,00)	650.000	USD	1.822.211,85	0,14
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 37,00)	600.000	USD	1.682.041,71	0,13
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 37,00)	600.000	USD	1.682.041,71	0,13
Bank of America Corp.	Jan 2026 (put, strike 37,00)	300.000	USD	841.020,85	0,06
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2025 (put, strike 90,00)	3.000	EUR	3.335.051,70	0,25
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (put, strike 48,00)	14.500	EUR	3.680.072,45	0,28
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (put, strike 50,00)	4.500	EUR	1.372.517,10	0,10
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (call, strike 52,00)	3.000	EUR	3.429.917,10	0,26
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (put, strike 52,00)	7.000	EUR	2.560.973,80	0,19
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (call, strike 56,00)	2.500	EUR	2.165.806,00	0,16
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (put, strike 56,00)	2.500	EUR	1.290.153,00	0,10
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (call, strike 60,00)	6.300	EUR	3.964.933,35	0,30
BNP Paribas S.A.	Jun 2025 (put, strike 60,00)	6.300	EUR	4.452.535,08	0,33
BNP Paribas S.A.	Dez 2025 (put, strike 52,00)	3.000	EUR	1.362.668,10	0,10
BNP Paribas S.A.	Dez 2025 (call, strike 56,00)	1.900	EUR	1.751.261,16	0,13
BNP Paribas S.A.	Dez 2025 (put, strike 56,00)	1.900	EUR	1.166.535,40	0,09
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	120.000	USD	319.090,83	0,02
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	-120.000	USD	-319.090,83	-0,02
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (call, strike 160,00)	80.000	USD	1.728.793,62	0,13
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (call, strike 160,00)	-80.000	USD	-1.728.793,62	-0,13
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	80.000	USD	366.313,49	0,03
Cheniere Energy, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	-80.000	USD	-366.313,49	-0,03
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 37,50)	500.000	USD	65.638,44	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 37,50)	-500.000	USD	-65.638,44	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	300.000	USD	5.311.970,05	0,40
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	280.000	USD	4.957.838,71	0,37
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	250.000	USD	4.426.641,71	0,33
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	-250.000	USD	-4.426.641,71	-0,33
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	-280.000	USD	-4.957.838,71	-0,37
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 45,00)	-300.000	USD	-5.311.970,05	-0,40
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	500.000	USD	165.707,95	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	460.000	USD	152.451,32	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	300.000	USD	99.424,77	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	280.000	USD	92.796,45	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	250.000	USD	82.853,98	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	-250.000	USD	-82.853,98	-0,01

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	-280.000	USD	-92.796,45	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	-300.000	USD	-99.424,77	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	-460.000	USD	-152.451,32	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	-500.000	USD	-165.707,95	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 50,00)	270.000	USD	3.643.169,01	0,27
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (call, strike 50,00)	-270.000	USD	-3.643.169,01	-0,27
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 50,00)	270.000	USD	183.476,56	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 50,00)	-270.000	USD	-183.476,56	-0,01
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 45,00)	700.000	USD	539.554,19	0,04
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (call, strike 50,00)	450.000	USD	6.414.317,00	0,48
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (call, strike 50,00)	-450.000	USD	-6.414.317,00	-0,48
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 50,00)	450.000	USD	610.027,01	0,05
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 50,00)	450.000	USD	610.027,01	0,05
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (call, strike 52,50)	230.000	USD	2.863.279,07	0,21
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 52,50)	230.000	USD	412.379,97	0,03
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (call, strike 55,00)	280.000	USD	3.021.398,16	0,23
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 55,00)	280.000	USD	665.430,74	0,05
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (call, strike 57,50)	270.000	USD	2.494.982,14	0,19
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 57,50)	500.000	USD	1.534.882,67	0,11
Citigroup, Inc.	Jun 2025 (put, strike 57,50)	270.000	USD	828.836,64	0,06
Citigroup, Inc.	Jan 2026 (put, strike 60,00)	350.000	USD	1.763.982,37	0,13
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (put, strike 11,00)	36.500	EUR	2.417.073,80	0,18
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (put, strike 12,00)	30.000	EUR	2.929.581,00	0,22
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (call, strike 13,00)	22.000	EUR	2.831.314,20	0,21
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (put, strike 13,00)	22.000	EUR	3.148.695,00	0,24
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (call, strike 14,00)	38.500	EUR	3.276.430,85	0,25
Credit Agricole S.A.	Jun 2025 (put, strike 14,00)	38.500	EUR	7.749.845,95	0,58
Credit Agricole S.A.	Dez 2025 (call, strike 13,00)	12.500	EUR	1.696.306,25	0,13
Credit Agricole S.A.	Dez 2025 (put, strike 13,00)	12.500	EUR	2.008.386,25	0,15
Credit Agricole S.A.	Dez 2025 (call, strike 14,00)	7.000	EUR	644.196,00	0,05
Credit Agricole S.A.	Dez 2025 (put, strike 14,00)	7.000	EUR	1.517.035,10	0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 270,00)	80.000	USD	68.314,66	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 300,00)	90.000	USD	133.129,21	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 300,00)	70.000	USD	103.544,94	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 300,00)	55.000	USD	81.356,74	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 300,00)	-125.000	USD	-184.901,68	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 310,00)	40.000	USD	5.498.261,80	0,41
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 310,00)	-40.000	USD	-5.498.261,80	-0,41
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 310,00)	40.000	USD	70.782,59	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 310,00)	-40.000	USD	-70.782,59	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 320,00)	40.000	USD	5.148.386,25	0,39
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 320,00)	-40.000	USD	-5.148.386,25	-0,39
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 320,00)	60.000	USD	128.660,38	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 320,00)	40.000	USD	85.773,59	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 320,00)	-40.000	USD	-85.773,59	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 320,00)	-60.000	USD	-128.660,38	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 350,00)	50.000	USD	191.211,80	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 350,00)	100.000	USD	871.597,85	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2025 (call, strike 440,00)	40.000	USD	2.051.095,72	0,15
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2025 (put, strike 440,00)	40.000	USD	1.221.186,58	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2026 (call, strike 450,00)	40.000	USD	2.378.207,46	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2026 (put, strike 450,00)	40.000	USD	1.732.589,84	0,13
ING Groep NV	Jun 2025 (put, strike 11,00)	17.000	EUR	519.081,40	0,04
ING Groep NV	Jun 2025 (call, strike 15,00)	8.000	EUR	1.659.859,20	0,12
ING Groep NV	Jun 2025 (put, strike 15,00)	8.000	EUR	1.029.488,00	0,08

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktienoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ING Groep NV	Dez 2025 (put, strike 12,00)	15.000	EUR	1.027.924,50	0,08
ING Groep NV	Dez 2025 (put, strike 14,00)	13.000	EUR	1.660.262,50	0,12
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 130,00)	110.000	USD	7.554.628,91	0,57
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 130,00)	-110.000	USD	-7.554.628,91	-0,57
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	160.000	USD	66.787,22	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	140.000	USD	58.438,82	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	110.000	USD	45.916,21	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	20.000	USD	8.348,40	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	-20.000	USD	-8.348,40	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	-110.000	USD	-45.916,21	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	-160.000	USD	-66.787,22	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 135,00)	120.000	USD	60.928,43	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 140,00)	20.000	USD	1.195.820,97	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 140,00)	-20.000	USD	-1.195.820,97	-0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	200.000	USD	123.261,58	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	200.000	USD	123.261,58	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	150.000	USD	92.446,19	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	20.000	USD	12.326,16	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	-20.000	USD	-12.326,16	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	-550.000	USD	-338.969,35	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	300.000	USD	283.600,28	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	180.000	USD	170.160,17	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	-300.000	USD	-283.600,28	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (call, strike 170,00)	170.000	USD	6.437.793,96	0,48
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (call, strike 170,00)	120.000	USD	4.544.325,15	0,34
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	350.000	USD	1.617.093,73	0,12
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	300.000	USD	1.386.080,34	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	200.000	USD	924.053,56	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	200.000	USD	924.053,56	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	170.000	USD	785.445,52	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 170,00)	120.000	USD	554.432,13	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (call, strike 180,00)	100.000	USD	3.096.426,50	0,23
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (call, strike 180,00)	80.000	USD	2.477.141,20	0,19
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	100.000	USD	666.871,29	0,05
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 180,00)	80.000	USD	533.497,03	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (call, strike 190,00)	100.000	USD	2.482.025,66	0,19
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2025 (put, strike 190,00)	100.000	USD	952.495,92	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	200.000	USD	1.515.815,44	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (put, strike 170,00)	150.000	USD	1.136.861,58	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (put, strike 180,00)	200.000	USD	2.027.269,23	0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (put, strike 180,00)	130.000	USD	1.317.725,00	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (call, strike 190,00)	80.000	USD	2.401.908,88	0,18
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2026 (put, strike 190,00)	80.000	USD	1.062.203,76	0,08
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2025 (call, strike 60,00)	2.400	EUR	2.184.257,52	0,16
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2025 (put, strike 60,00)	2.400	EUR	1.075.545,36	0,08
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2025 (call, strike 68,00)	2.000	EUR	907.823,00	0,07
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2025 (put, strike 68,00)	2.000	EUR	1.710.147,40	0,13
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2025 (put, strike 56,00)	4.000	EUR	1.650.582,40	0,12
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2025 (call, strike 60,00)	3.300	EUR	3.245.019,36	0,24
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2025 (put, strike 60,00)	9.800	EUR	5.410.171,34	0,40
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2025 (call, strike 64,00)	5.000	EUR	3.720.835,50	0,28
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2025 (put, strike 64,00)	10.500	EUR	7.656.882,45	0,57
MetLife, Inc.	Jan 2025 (put, strike 57,50)	350.000	USD	310.717,05	0,02
MetLife, Inc.	Jan 2025 (put, strike 57,50)	-350.000	USD	-310.717,05	-0,02
MetLife, Inc.	Jan 2025 (put, strike 64,00)	400.000	USD	785.003,97	0,06

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
MetLife, Inc.	Jan 2025 (put, strike 64,00)	-400.000	USD	-785.003,97	-0,06
MetLife, Inc.	Jun 2025 (put, strike 65,00)	400.000	USD	1.406.959,46	0,11
MetLife, Inc.	Jun 2025 (call, strike 70,00)	200.000	USD	1.282.995,47	0,10
MetLife, Inc.	Jun 2025 (call, strike 70,00)	190.000	USD	1.218.845,70	0,09
MetLife, Inc.	Jun 2025 (put, strike 70,00)	200.000	USD	1.050.885,93	0,08
MetLife, Inc.	Jun 2025 (put, strike 70,00)	190.000	USD	998.341,64	0,07
MetLife, Inc.	Jan 2026 (put, strike 67,50)	300.000	USD	1.735.345,84	0,13
MetLife, Inc.	Jan 2026 (put, strike 67,50)	300.000	USD	1.735.345,84	0,13
Occidental Petroleum Corp.	Jan 2026 (put, strike 57,50)	400.000	USD	1.581.006,39	0,12
Porsche Automobil Holding SE	Dez 2025 (put, strike 36,00)	5.000	EUR	1.221.017,00	0,09
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (call, strike 90,00)	120.000	USD	3.174.013,04	0,24
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (call, strike 90,00)	-120.000	USD	-3.174.013,04	-0,24
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 90,00)	250.000	USD	240.557,73	0,02
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 90,00)	120.000	USD	115.467,71	0,01
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 90,00)	-120.000	USD	-115.467,71	-0,01
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 90,00)	-250.000	USD	-240.557,73	-0,02
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 92,50)	250.000	USD	286.807,79	0,02
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 92,50)	-250.000	USD	-286.807,79	-0,02
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (call, strike 100,00)	120.000	USD	2.189.657,55	0,16
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (call, strike 100,00)	-120.000	USD	-2.189.657,55	-0,16
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 100,00)	120.000	USD	242.840,14	0,02
Prudential Financial, Inc.	Jan 2025 (put, strike 100,00)	-120.000	USD	-242.840,14	-0,02
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (call, strike 100,00)	120.000	USD	2.430.625,28	0,18
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (put, strike 100,00)	300.000	USD	1.224.630,65	0,09
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (put, strike 100,00)	250.000	USD	1.020.525,54	0,08
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (put, strike 100,00)	120.000	USD	489.852,26	0,04
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (call, strike 110,00)	200.000	USD	2.778.047,87	0,21
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (call, strike 110,00)	120.000	USD	1.666.828,72	0,12
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (put, strike 110,00)	200.000	USD	1.347.713,55	0,10
Prudential Financial, Inc.	Jun 2025 (put, strike 110,00)	120.000	USD	808.628,13	0,06
Prudential Financial, Inc.	Jan 2026 (put, strike 100,00)	220.000	USD	1.406.995,19	0,11
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (put, strike 135,00)	120.000	USD	125.127,17	0,01
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (put, strike 135,00)	-120.000	USD	-125.127,17	-0,01
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (call, strike 140,00)	100.000	USD	3.737.661,39	0,28
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (call, strike 140,00)	-100.000	USD	-3.737.661,39	-0,28
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	100.000	USD	132.510,57	0,01
T-Mobile US, Inc.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	-100.000	USD	-132.510,57	-0,01
Volkswagen AG	Jun 2025 (call, strike 100,00)	1.000	EUR	1.414.570,60	0,11
Volkswagen AG	Jun 2025 (put, strike 100,00)	2.900	EUR	2.583.521,55	0,19
Volkswagen AG	Dez 2025 (put, strike 100,00)	2.000	EUR	2.068.266,60	0,15
Zurich Insurance Group AG	Dez 2024 (put, strike 380,00)	5.000	CHF	99.961,52	0,01
Zurich Insurance Group AG	Dez 2024 (call, strike 480,00)	5.000	CHF	1.080.211,05	0,08
Zurich Insurance Group AG	Dez 2024 (put, strike 480,00)	-5.000	CHF	-972.819,57	-0,07
Zurich Insurance Group AG	Dez 2025 (put, strike 400,00)	10.000	CHF	1.564.324,85	0,12
Zurich Insurance Group AG	Dez 2025 (put, strike 420,00)	19.000	CHF	3.947.139,44	0,30
Summe Aktioptionen				317.233.752,65	23,74
Summe Optionen				116.126.234,87	8,69

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps		Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Kontrahent				
BNP Paribas S.A. (Paris)		1.264.442.794	-5.190.265,39	-0,40
BofA Securities Europe SA		397.097.300	-1.730.479,48	-0,15
Citigroup Global Markets Europe AG		739.100.000	-3.770.866,32	-0,31
Goldman Sachs Bank Europe SE		353.147.400	-1.276.907,56	-0,12
HSBC Continental Europe		181.000.000	-738.623,18	-0,06
JP Morgan SE		1.508.293.000	-4.426.251,39	-0,32
Morgan Stanley Europe SE		1.378.551.800	-5.769.665,14	-0,40
UBS AG (London)		1.759.656.200	-6.334.943,53	-0,43
			-29.238.001,99	-2,19
Summe Volatility Swaps			-29.238.001,99	-2,19
Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland				
Allianz SE	2.702.162	EUR	152.908,00	0,01
Bayerische Motoren Werke AG	-12.211.656	EUR	-557.777,66	-0,04
Mercedes-Benz Group AG	-15.791.987	EUR	154.196,32	0,01
Porsche Automobil Holding SE	-4.870.381	EUR	-19.535,39	0,00
Volkswagen AG	-13.061.066	EUR	-618.164,67	-0,05
			-888.373,40	-0,07
Frankreich				
AXA S.A.	-21.330.622	EUR	-81.204,65	0,00
BNP Paribas S.A.	-952.713	EUR	-277.055,82	-0,02
Credit Agricole S.A.	-5.852.382	EUR	-93.211,36	-0,01
			-451.471,83	-0,03
Niederlande				
ING Groep NV	-6.169.495	EUR	60.436,84	0,01
			60.436,84	0,01
Schweiz				
Zurich Insurance Group AG	-3.165.776	CHF	-11.204,73	0,00
			-11.204,73	0,00
Vereinigte Staaten				
American International Group, Inc.	-1.118.628	USD	-4.078,40	0,00
Apple, Inc.	34.978.045	USD	-330.705,94	-0,02
Bank of America Corp.	7.274.380	USD	4.582,37	0,00
Bank of America Corp.	-2.198.293	USD	36.928,48	0,00
Citigroup, Inc.	-2.860.119	USD	138.570,38	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	7.223.301	USD	39.326,05	0,00
JPMorgan Chase & Co.	19.123.352	USD	-365.128,22	-0,03
MetLife, Inc.	-9.475.003	USD	-82.125,63	-0,01
Occidental Petroleum Corp.	-6.821.982	USD	72.910,18	0,01
Prudential Financial, Inc.	9.694.838	USD	-57.347,61	0,00
			-547.068,34	-0,04
Summe Differenzkontrakte			-1.837.681,46	-0,13

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder, Optionen und Volatility Swaps (Anschaffungskosten EUR 974.132.324,47)	938.636.686,54	70,23
Bankguthaben	401.044.479,61	30,00
Sonstige Vermögenswerte	58.107.901,23	4,35
Sonstige Verbindlichkeiten	-61.197.651,37	-4,58
Summe Nettoteilfondsvermögen	1.336.591.416,01	100,00

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2024 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	383.492.023,12
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	222.109,77
Tagesgelder (Erl. 2)	470.094.112,00
Optionen (Erl. 2)	116.126.234,87
Bankguthaben (Erl. 2) *	401.044.479,61
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	51.180.939,94
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	542.397,58
Zinsforderungen	6.162.453,94
Summe Aktiva	1.428.864.750,83
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	55.324.754,29
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	214.281,41
Unrealisierte Verluste aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	845.168,58
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	29.238.001,99
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	1.837.681,46
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	797.886,11
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	124.735,10
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	44.839,11
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	32.948,23
Zinsverbindlichkeiten	565.755,56
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	13,04
Gebühren für Differenzkontrakte	3.174.835,85
Sonstige Verbindlichkeiten	72.434,09
Summe Passiva	92.273.334,82
Summe Nettoteilfondsvermögen	1.336.591.416,01

Anteilklassen	I	I2 CHF	I2 SPEZ	I2 USD	I GBP	P	R
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	817.296,19	64.469,06	54.400,00	10.252,02	34.991,02	158.415,01	2.042.345,29
Zeichnungen	215.650,34	77.688,43	1.600,00	0,00	8.298,16	25.084,00	641.763,00
Rücknahmen	108.210,61	1.758,83	7.600,00	1.259,39	2.872,40	16.170,00	278.525,15
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	924.735,92	140.398,66	48.400,00	8.992,63	40.416,78	167.329,01	2.405.583,14

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY
AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS
FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2024 BIS ZUM 30. JUNI 2024 IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	1.184.371.223,88
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	4.020.733,75
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	2.517.305,33
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	8.522.318,74
Bankzinsen (Erl. 2)	5.430.081,40
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	3.559.026,50
Summe Erträge	24.049.465,72
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	611.990,74
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	900.306,77
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	4.777.575,94
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	796.435,84
Performance Fee (Erl. 3)	12,56
Prüfungskosten	32.560,20
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	87.799,22
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	4.823.974,33
Transaktionskosten (Erl. 10)	372.479,60
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	545.677,01
Summe Aufwendungen	12.948.812,21
Nettogewinn/(-verlust)	11.100.653,51
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	931.433.618,54
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-1.002.305.149,98
Realisierter Nettoverlust	-59.770.877,93
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-213.481.312,16
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	215.540.632,95
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	-57.711.557,14
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	352.594.076,39
Rücknahme von Anteilen	-142.662.327,12
Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	1.336.591.416,01

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

Statistische Angaben

Teilfondsangaben in EUR

Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 30.06.2024	1.336.591.416,01
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 31.12.2023	1.184.371.223,88
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 31.12.2022	1.057.115.589,14

Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2024	31.12.2023	31.12.2022
I	1.053,08	1.101,54	1.096,96
I2 CHF	989,27	1.086,21	1.038,88
I2 SPEZ	924,72	963,45	951,80
I2 USD	878,43	885,11	–
I GBP	1.168,69	1.188,86	1.140,13
P	47,70	50,08	50,24
R	48,22	50,45	50,26

Umlaufende Anteile zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2024	31.12.2023	31.12.2022
I	924.735,92	817.296,19	745.648,11
I2 CHF	140.398,66	64.469,06	40.534,00
I2 SPEZ	48.400,00	54.400,00	71.010,00
I2 USD	8.992,63	10.252,02	–
I GBP	40.416,78	34.991,02	27.338,42
P	167.329,01	158.415,01	253.424,51
R	2.405.583,14	2.042.345,29	1.702.422,80

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
Deutschland					
DE0001102390	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,5 %, 15.02.2026	11.700.000	EUR	11.269.460,48	4,91
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	8.900.000	EUR	8.873.960,83	3,86
DE0001102382	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2025	17.000.000	EUR	16.612.429,75	7,23
DE0001104909	Bundesschatzanweisungen 2,2 %, 12.12.2024	6.000.000	EUR	5.970.375,00	2,60
DE000BU22007	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 13.03.2025	7.500.000	EUR	7.458.478,13	3,25
DE000BU22049	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 19.03.2026	17.100.000	EUR	16.989.224,66	7,40
DE000BU22015	Bundesschatzanweisungen 2,8 %, 12.06.2025	15.000.000	EUR	14.942.562,00	6,51
DE000BU22056	Bundesschatzanweisungen 2,9 %, 18.06.2026	6.500.000	EUR	6.509.385,16	2,83
DE000BU22031	Bundesschatzanweisungen 3,1 %, 12.12.2025	15.900.000	EUR	15.922.641,60	6,93
DE000BU22023	Bundesschatzanweisungen 3,1 %, 18.09.2025	15.000.000	EUR	15.003.337,50	6,53
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				119.551.855,11	52,05
Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.				119.551.855,11	52,05
Tagesgelder					
Kontrahent	Zinssatz		Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland					
	DekaBank 3,58 %, Tagesgeld		EUR	28.500.000,00	12,41
	DZ Bank AG 3,55 %, Tagesgeld		EUR	28.500.000,00	12,41
	Commerzbank 3,65 %, Tagesgeld		EUR	5.000.000,00	2,17
Summe Tagesgelder				62.000.000,00	26,99
Volatility Swaps					
		Nennbetrag		Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Kontrahent					
BNP Paribas S.A. (Paris)		324.125.000		400.816,21	0,18
Goldman Sachs Bank Europe SE		140.090.000		917.582,25	0,42
JP Morgan SE		170.475.500		1.447.552,80	0,57
Morgan Stanley Europe SE		65.835.000		670.191,60	0,31
UBS AG (London)		553.970.000		192.359,59	0,10
Summe Volatility Swaps				3.628.502,45	1,58

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2024 (FORTSETZUNG)

Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder und Volatility Swaps (Anschaffungskosten EUR 181.655.925,53)	185.180.357,56	80,62
Bankguthaben	43.161.500,78	18,79
Sonstige Vermögenswerte	1.733.772,63	0,76
Sonstige Verbindlichkeiten	-386.187,11	-0,17
Summe Nettoteilfondsvermögen	229.689.443,86	100,00

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.
 Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator für die Provenienz der Investments.

ASSENAGON ALPHA PREMIUM ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2024 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	119.551.855,11
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	3.628.502,45
Tagesgelder (Erl. 2)	62.000.000,00
Bankguthaben (Erl. 2) *	43.161.500,78
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	53.996,93
Zinsforderungen	1.679.611,71
Sonstige Forderungen	163,99
Summe Aktiva	230.075.630,97
Passiva	
Unrealisierte Verluste aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	10.205,74
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	119.380,72
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	8.751,31
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	8.636,31
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	6.911,59
Zinsverbindlichkeiten	121.020,27
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	111.281,17
Summe Passiva	386.187,11
Summe Nettoteilfondsvermögen	229.689.443,86

Anteilklassen	I	I2R	IS	P	R	RS
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	20.934,85	2.480,00	53.053,74	2.000,00	99.742,00	131.556,00
Zeichnungen	106.522,12	0,00	210,00	370,00	257.298,00	50.000,00
Rücknahmen	14.078,22	0,00	117,00	95,00	28.602,00	0,00
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	113.378,75	2.480,00	53.146,74	2.275,00	328.438,00	181.556,00

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

ASSENAGON ALPHA PREMIUM
AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS
FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2024 BIS ZUM 30. JUNI 2024 IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	98.307.667,58
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	1.247.122,69
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	790.396,00
Bankzinsen (Erl. 2)	286.401,46
Summe Erträge	2.323.920,15
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	60.045,99
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	170.882,35
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	512.099,63
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	67.329,62
Performance Fee (Erl. 3)	111.281,16
Prüfungskosten	6.654,60
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	13.968,14
Transaktionskosten (Erl. 10)	141,82
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	66.245,39
Summe Aufwendungen	1.008.648,70
Nettogewinn/(-verlust)	1.315.271,45
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	13.621.735,45
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-11.421.655,29
Realisierter Nettogewinn	3.515.351,61
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-888.936,89
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	2.990.824,79
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	5.617.239,51
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	144.408.520,36
Rücknahme von Anteilen	-18.643.983,59
Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	229.689.443,86

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

Statistische Angaben

Teilfondsangaben in EUR

Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 30.06.2024	229.689.443,86
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2023	98.307.667,58
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2022	72.732.452,15

Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2024	31.12.2023	31.12.2022
I	1.202,12	1.162,41	1.098,84
I2R	1.202,25	1.162,81	1.100,17
IS	1.121,67	1.083,89	1.062,50
P	58,50	56,74	53,94
R	59,94	57,98	54,87
RS	60,47	58,44	55,17

Umlaufende Anteile zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2024	31.12.2023	31.12.2022
I	113.378,75	20.934,85	16.085,00
I2R	2.480,00	2.480,00	1.030,00
IS	53.146,74	53.053,74	43.788,97
P	2.275,00	2.000,00	2.000,00
R	328.438,00	99.742,00	4.000,00
RS	181.556,00	131.556,00	128.181,00

Konsolidierte Darstellung

ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2024 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	503.043.878,23
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	222.109,77
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	3.628.502,45
Tagesgelder (Erl. 2)	532.094.112,00
Optionen (Erl. 2)	116.126.234,87
Bankguthaben (Erl. 2) *	444.205.980,39
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	51.180.939,94
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	596.394,51
Zinsforderungen	7.842.065,65
Sonstige Forderungen	163,99
Summe Aktiva	1.658.940.381,80
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	55.324.754,29
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	214.281,41
Unrealisierte Verluste aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	10.205,74
Unrealisierte Verluste aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	845.168,58
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	29.238.001,99
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	1.837.681,46
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	917.266,83
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	133.486,41
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	53.475,42
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	39.859,82
Zinsverbindlichkeiten	686.775,83
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	111.294,21
Gebühren für Differenzkontrakte	3.174.835,85
Sonstige Verbindlichkeiten	72.434,09
Summe Passiva	92.659.521,93
Summe Nettofondsvermögen	1.566.280.859,87

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2024 BIS ZUM 30. JUNI 2024 IN EUR

Nettofondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	1.282.678.891,46
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	5.267.856,44
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	2.517.305,33
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	9.312.714,74
Bankzinsen (Erl. 2)	5.716.482,86
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	3.559.026,50
Summe Erträge	26.373.385,87
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	672.036,73
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	1.071.189,12
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	5.289.675,57
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	863.765,46
Performance Fee (Erl. 3)	111.293,72
Prüfungskosten	39.214,80
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	101.767,36
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	4.823.974,33
Transaktionskosten (Erl. 10)	372.621,42
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	611.922,40
Summe Aufwendungen	13.957.460,91
Nettogewinn/(-verlust)	12.415.924,96
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	945.055.353,99
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-1.013.726.805,27
Realisierter Nettoverlust	-56.255.526,32
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-214.370.249,05
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	218.531.457,74
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	-52.094.317,63
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	497.002.596,75
Rücknahme von Anteilen	-161.306.310,71
Summe Nettofondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	1.566.280.859,87

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

Erläuterungen zum Halbjahresbericht

1. Der Fonds

Der Assenagon Alpha (der "Fonds") wurde am 7. Januar 2011 als ein "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" aufgelegt. Bei dem Fonds handelt es sich um ein Sondervermögen gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010, in der jeweils gültigen Fassung, welcher die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) erfüllt.

Der Fonds wird von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet. Die Assenagon Asset Management S.A. ist eine Société Anonyme gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 des Großherzogtums Luxemburg mit eingetragenem Sitz in Aerogolf Center, 1B Heienhaff, 1736 Senningerberg, Luxemburg. Sie ist am 3. Juli 2007 gegründet worden.

Der Fonds ist als Umbrella aufgelegt worden und die Verwaltungsgesellschaft beschließt, ob einer oder mehrere Teilfonds aufgelegt werden.

Gegenwärtig besteht der Teilfonds Assenagon Alpha Volatility aus den Anteilklassen:

Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum
I	25.01.2011	I GBP	17.12.2018	I2 SPEZ	17.11.2020
P	25.01.2011	R	01.08.2019	I2 CHF	13.08.2021
I2 USD	04.04.2023				

Gegenwärtig besteht der Teilfonds Assenagon Alpha Premium aus den Anteilklassen:

Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum
I	11.12.2019	IS	11.12.2019	R	11.12.2019
I2R	11.12.2019	P	11.12.2019	RS	11.12.2019

Das konsolidierte Nettobondsvermögen des Fonds besteht aus der Summe der Nettoteilfondsvermögen und wird in EUR ausgedrückt.

2. Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

Allgemeines

Die Erstellung des Halbjahresberichts erfolgt unter Aufsicht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft in Übereinstimmung mit den allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen in Luxemburg in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) unter der Annahme des Prinzips der Unternehmensfortführung.

Bewertung der Anlagen

Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
- Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.
- Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher und nachvollziehbarer Weise.
- Falls die unter vorstehend a) und b) genannten Kurse nicht marktgerecht sind oder sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in a) oder b) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, werden diese Vermögenswerte, ebenso wie alle anderen Vermögenswerte, zum jeweiligen Verkehrswert

bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Abschlussprüfern nachprüfbar, Bewertungsregeln festlegt.

- e) Die auf Vermögenswerte entfallenden anteiligen Zinsen werden miteinbezogen, soweit sie sich nicht im Kurswert ausdrücken.
- f) Der Liquidationswert von Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird gemäß den Richtlinien der Verwaltungsgesellschaft auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures oder Optionen vom jeweiligen Teilfonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettoinventarwert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- g) Swaps werden zum Barwert (Present Value) bewertet.
- h) Flüssige Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich anteiliger Zinsen bewertet. Festgelder können zum jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.
- i) Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Nettoinventarwert bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden die Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Veräußerungswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich errechenbaren Veräußerungswertes festlegt.
- j) Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten verfügbaren Devisenkurs in die betreffende Teilfondswährung umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisentransaktionen werden hinzugerechnet oder abgesetzt.
- k) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Veräußerungswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Teilfonds für angebracht hält.

Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Nettoinventarwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Nettoinventarwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Nettoinventarwert noch am selben Tag zu aktualisieren.

Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Nettoinventarwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Erträge

Dividenden werden an dem Datum, an dem die betreffenden Wertpapiere erstmals "Ex-Dividende" notiert werden, als Ertrag verbucht. Zinserträge laufen täglich auf.

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

3. Kosten

Alle Teilfonds

Laufende Kosten („Ongoing Charges or Management fees and other administrative or operation costs“)

Die Kosten der Teilfonds werden EU- und UK-weit nach den Vorschriften der Richtlinie CESR/10/674 bzw. der Verordnung EU 1286/2014 berechnet und in den entsprechenden Kundeninformationsdokumenten ausgewiesen. So werden die Laufenden Kosten gemäß der Richtlinie CESR/10/674 in den Wesentlichen Anlegerinformationen bzw. die Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten gemäß der Verordnung EU 1286/2014 in den Basisinformationsblättern veröffentlicht. Ein redundanter Ausweis der Berechnung der TER ("Total Expense Ratio") im Halbjahresbericht entfällt somit.

Für den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Verwaltungsgebühren

Für die Verwaltung des Teilfonds Assenagon Alpha Volatility erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung in Höhe von:

Anteilklasse	Vergütung p.a.	Anteilklasse	Vergütung p.a.	Anteilklasse	Vergütung p.a.
I, I2 CHF, I2 USD, I GBP, R	0,80 %	P	1,50 %	I2 SPEZ	0,00 %

Die Verwaltungsvergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögens ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Performance Fee für Anteilklassen I, I2 CHF, I2 SPEZ, I2 USD, I GBP, P und R

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Nettoteilfondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 15 % (Partizipationsrate) der Mehrperformance über einen sog. Hurdle-Index. Die Performance Fee wird bewertungstäglich berechnet und erstmals zum Geschäftsjahresende des ersten vollen Geschäftsjahres ausbezahlt. Bei Auflegung einer Anteilsklasse liegt der Hurdle-Index auf dem Erstausgabepreis der Anteilsklasse und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres mit einer kalkulatorischen Grundverzinsung von 3 % p. a.

Nach Abschluss eines Geschäftsjahres wird der Hurdle-Index zum Geschäftsjahresende auf den höchsten der an den fünf vergangenen Geschäftsjahresenden erreichten Anteilswerte (High Water Mark) angepasst, wobei der Anteilswert um Ausschüttungen angepasst wird. Existieren weniger als fünf vergangene Geschäftsjahresenden so werden für die Anpassung des Hurdle-Index alle vorangegangenen Geschäftsjahresenden berücksichtigt. An den beiden ersten Geschäftsjahresenden wird der Hurdle-Index auf den höheren Wert von a) dem für das jeweilige Geschäftsjahresende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilswert der jeweiligen Anteilsscheinklasse zum jeweiligen Geschäftsjahresende nach Anpassung um Ausschüttungen angepasst.

Um Verwässerungseffekte zu vermeiden, wird bei Anteilsrückgaben die Performance Fee für die zurückgegebenen Anteile, soweit positiv, aus dem Fondsvolumen zurückgestellt und am Jahresende ausbezahlt. Bei Zeichnungen wird die ggf. errechnete und abgegrenzte Performance Fee pro Anteil (ohne Berücksichtigung der Sonderposten für Rückgaben und Zuflüsse) multipliziert mit den zugeflossenen Anteilen, dem Fonds als positiver Korrekturposten angerechnet.

Die Performance Fee ergibt sich aus der Differenz des Anteilswertes (vor Abgrenzung der Performance Fee und nach Anpassung um Ausschüttungen und dem Hurdle-Index), multipliziert mit der Anzahl der aktuell umlaufenden Anteile abzüglich der Korrekturposten für Zuflüsse. Dazu kommen in jedem Fall die aufgrund von Rückflüssen zurückgestellten Performance Fee-Anteile. Am Geschäftsjahresende wird nach Auszahlung der so errechneten Performance Fee der Hurdle-Index wie beschrieben angepasst und die Rückstellungen und Korrekturposten auf null zurückgesetzt, unabhängig davon, ob eine Performance Fee ausbezahlt wurde oder nicht.

Für die abgelaufene Geschäftsperiode sind Performance Fees in Höhe von EUR 12,56 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Halbjahresberichts erläutert.

Verwahrstellen- und Administrationsgebühren und sonstige Kosten des Fonds

Die Verwahrstelle, die Zentralverwaltung, die Register- und Transferstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,15 % p.a., mindestens jedoch EUR 10.000 pro Monat, zu erhalten.

Zusätzliche fixe und transaktionsabhängige Gebühren werden von der Verwahrstelle entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet. Diese Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Kosten für die Gründung des Fonds und die Erstausgabe von Anteilen können über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben werden.

Sonstige Kosten im Sinne von Artikel 13 des Verwaltungsreglements können dem Teilfondsvermögen nach ihrem tatsächlichen Anfall belastet werden.

Für den Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Verwaltungsgebühren

Für die Verwaltung des Teilfonds Assenagon Alpha Premium erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung in Höhe von:

Anteilklasse	Vergütung p.a.	Anteilklasse	Vergütung p.a.	Anteilklasse	Vergütung p.a.
IS, RS	0,55 %	I, R	0,75 %	I2R	0,95 %
P	1,40 %				

Die Verwaltungsvergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Teilfondsvermögens ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Performance Fee für Anteilklassen I, IS, P,R und RS

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Nettofondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 15 % (Partizipationsrate) der Mehrperformance über einen sog. Hurdle-Index. Eine Performance Fee kann auch dann ausbezahlt werden, wenn sich der Fonds besser als der Hurdle-Index entwickelt hat, aber dennoch eine negative Wertentwicklung aufweist. Die Performance Fee wird bewertungstäglich abgegrenzt und zum Geschäftsjahresende ausbezahlt.

Der Hurdle-Index liegt bei Auflegung einer Anteilklasse auf dem Erstausgabepreis der jeweiligen Anteilklasse und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres auf Basis des 1-Monats-Euribor (bzw. auf Basis des 1-Monats-SARON, des SONIA, des 30-Tages-TONA oder des 30-Tages-SOFR für alle CHF, GBP, JPY oder USD Anteilsklassen) zuzüglich 2 % p. a. Der 1-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist der Zinssatz für in Euro denominiertes Termingeld im Interbankengeschäft zwischen Banken hoher Bonität. Zum Datum dieses Prospekts ist die Bank of England (als Verwalter von SONIA), die Bank of Japan (als Verwalter von TONA) und die Federal Reserve Bank of New York (als Verwalter von SOFR) nicht im Register der Verwalter der ESMA gemäß Artikel 36 der EU-Benchmarks-Verordnung aufgeführt. SONIA, TONA und SOFR fallen nicht in den Anwendungsbereich der EU-Benchmark-Verordnung gemäß Artikel 2 der EU-Benchmark-Verordnung. Ist der Hurdle-Index nicht mehr verfügbar bzw. nicht mehr existent, wird die Verwaltungsgesellschaft diesen durch einen gleichwertigen anderen Hurdle-Index ersetzen. Nach Abschluss eines Geschäftsjahres wird der Hurdle-Index zum Geschäftsjahresende auf den höchsten der an den fünf vergangenen Geschäftsjahresenden erreichten Anteilswerte (High Water Mark) angepasst, wobei der Anteilswert um Ausschüttungen angepasst wird. Existieren weniger als fünf vergangene Geschäftsjahresenden so werden für die Anpassung des Hurdle-Index alle vorangegangenen Geschäftsjahresenden berücksichtigt.

An den beiden ersten Geschäftsjahresenden wird der Hurdle-Index auf den höheren Wert von a) dem für das jeweilige Geschäftsjahresende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilswert der jeweiligen Anteilscheinklasse zum jeweiligen Geschäftsjahresende nach Anpassung um Ausschüttungen angepasst.

Die Performance Fee ergibt sich aus der Differenz des Anteilswertes (vor Abgrenzung der Performance Fee und nach Anpassung um Ausschüttungen) und dem Hurdle-Index, multipliziert mit der Anzahl der aktuell umlaufenden Anteile multipliziert mit der Vergütung von 15 % abzüglich der Korrekturposten für Zuflüsse.

Um Verwässerungseffekte zu vermeiden, wird bei Anteilsrückgaben die Performance Fee für die zurückgegebenen Anteile, soweit positiv, aus dem Fondsvolumen entnommen. Bei Zeichnungen wird die abgegrenzte Performance Fee pro Anteil multipliziert mit den zugeflossenen Anteilen, dem Fonds als Korrekturposten angerechnet.

Am Geschäftsjahresende wird nach Auszahlung der so errechneten Performance Fee der Hurdle-Index wie beschrieben angepasst und sämtliche Rückstellungen auf null zurückgesetzt, unabhängig davon, ob eine Performance Fee ausbezahlt wurde oder nicht.

Für die abgelaufene Geschäftsperiode sind Performance Fees in Höhe von EUR 111.281,16 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Halbjahresberichts erläutert.

Verwahrstellen- und Administrationsgebühren und sonstige Kosten des Fonds

Die Verwahrstelle ist berechtigt ein Entgelt im Durchschnitt zwischen 0,02 % und 0,05 % p. a. auf das verwahrte Nettoteilfondsvermögen zu erhalten, abhängig vom Land in welchem die Wertpapiere verwahrt werden. Das jährliche Minimum beträgt EUR 12.000. Daneben 0,008 % p.a. des Nettofondsvermögens.

Zusätzliche ereignisbezogene und transaktionsabhängige Gebühren werden entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet.

Die Zentralverwaltung ist berechtigt ein Entgelt für die Fondsbuchhaltungs- und Administrationsgebühren zu erhalten in Höhe von 0,04 % p. a. auf das Nettoteilfondsvermögen; mindestens jedoch EUR 28.020 p. a.

Zusätzlichen Gebühren für anteilklassenspezifische Aufstellungen und sonstiges Reporting wie z.B. Steuerkennzahlen sowie transaktionsabhängige Gebühren werden entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet.

Register- und Transferstellenvergütung: Fixe und transaktionsabhängige Gebühren sind abhängig von der Anzahl an Anteilsklassen, Investoren und Transaktionen.

Die Kosten für die Gründung des Fonds und die Erstaussgabe von Anteilen wurden über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben.

Sonstige Kosten im Sinne von Artikel 13 des Verwaltungsreglements können dem Teilfondsvermögen nach ihrem tatsächlichen Anfall belastet werden.

Verwässerungsabgabe

Unter bestimmten Umständen können Ausgaben, Rücknahmen und Umtausche in einem Teilfonds beziehungsweise einer Anteilsklasse negative Auswirkungen auf den Nettoinventarwert pro Anteil haben.

Wenn Ausgaben, Rücknahmen und Umtausche in einem Teilfonds die Verwaltungsgesellschaft veranlassen, zugrundeliegende Anlagen dieses Teilfonds zu kaufen und/oder zu verkaufen, kann der Wert dieser Anlagen durch Geld-/Briefspannen, Handelskosten und damit verbundene Aufwendungen einschließlich Transaktionsgebühren, Brokerggebühren und Steuern beeinflusst werden. Diese Investitionstätigkeit kann sich negativ auf den Nettoinventarwert pro Anteil auswirken, der als "Verwässerung" bezeichnet wird. Es ist jedoch nicht möglich, genau vorherzusagen, ob eine Verwässerung zu irgendeinem Zeitpunkt eintreten wird. Um bestehende oder verbleibende Anteilinhaber vor den möglichen Auswirkungen einer Verwässerung zu schützen, kann die Verwaltungsgesellschaft eine Verwässerungsabgabe anwenden.

Die Notwendigkeit, die Verwässerungsabgabe zu erheben, hängt vom Volumen der Netto-Ausgabe, -Rücknahme oder Umtausch von Anteilen ab und wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt.

Falls erhoben, wird die Verwässerungsabgabe zusätzlich zum (aber nicht als Teil vom) Preis der Anteile bei deren Ausgabe oder als Abzug bei deren Rücknahme ausgewiesen. Die Verwässerungsabgabe wird entweder im Falle einer Ausgabe oder Umwandlung von Anteilen in den jeweiligen Teilfonds/Anteilsklasse eingezahlt oder im Falle einer Rücknahme oder Umwandlung von Anteilen in dem Teilfonds/Anteilsklasse einbehalten.

Die Verwaltungsgesellschaft kann bei der Ausgabe, Rücknahme oder Umtausch von Anteilen eine Verwässerungsabgabe von bis zu zwei (2) Prozent des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteile erheben, wenn ihrer Meinung nach die bestehenden Anteilinhaber (bei Ausgaben und Umtausch) oder die verbleibenden Anteilinhaber (bei Rücknahmen und Umtausch) nachteilig beeinträchtigt werden könnten.

Die Verwässerungsabgabe wird nach alleinigem und absolutem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ohne Haftung, wohl aber mit dem Ziel der Gleichbehandlung der Anteilinhaber, erhoben.

Der Prozentsatz der Verwässerungsabgabe (falls erhoben) wird für alle Anleger, die am selben Bewertungstag Anteile eines Teilfonds/einer Anteilsklasse kaufen/verkaufen/umwandeln, gleich angesetzt.

Da ein Umtausch von Anteilen von einem Teilfonds in Anteile eines anderen Teilfonds praktisch eine Rücknahme vom ursprünglichen Teilfonds und eine Ausgabe von Anteilen des neuen Teilfonds ist, wird der Umtausch in die oben genannten Nettoausgaben und Nettorücknahmen einbezogen. Daher ist es möglich, dass sowohl auf die Rückzahlung des ursprünglichen Teilfonds als auch auf die Anlage in den neuen Teilfonds eine Verwässerungsabgabe erhoben wird. Der Prozentsatz der Verwässerungsabgabe ist gleich für alle Anteilinhaber, die Anteile eines Teilfonds am selben Bewertungstag umtauschen.

Da die Verwässerung in direktem Zusammenhang mit den Zu- und Abflüssen von Geldern in beziehungsweise aus einem Teilfonds/einer Anteilsklasse steht, ist es nicht möglich, genau vorherzusagen, wann die Verwässerung eintreten wird. Daher ist es auch nicht möglich, genau vorherzusagen, wie oft die Verwaltungsgesellschaft eine solche Verwässerungsabgabe anwenden muss.

In der abgelaufenen Geschäftsperiode wurde keine Verwässerungsabgabe angewendet.

4. Finanzterminkontrakte

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 30. Juni 2024 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
EURO/CHF Future	CHF	16.09.2024	-25	-64,90	0,00
EURO FX Currency Future	USD	16.09.2024	30	-16.885,93	0,00
Euro Stoxx 50® Index Future	EUR	20.09.2024	-2.807	44.550,21	0,00
Euro Stoxx® Banks Future	EUR	20.09.2024	1.821	-59.272,20	0,00
FTSE 100 Index Future	GBP	20.09.2024	-99	51.377,83	0,00
Nasdaq 100 E-Mini Future	USD	20.09.2024	-17	-58.952,18	0,00
S&P 500 E-Mini Future	USD	20.09.2024	318	-84.223,77	-0,01
Swiss Market Index Future	CHF	20.09.2024	-241	345.580,71	0,03
				222.109,77	0,02

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Die am 30. Juni 2024 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
EURO FX Currency Future	USD	16.09.2024	16	-10.205,74	0,00
				-10.205,74	0,00

5. Devisentermingeschäfte

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 30. Juni 2024 ausstehenden Devisengeschäfte des Investmentportfolios werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/ (Verlust) EUR	Nettoteilfondsvermögen (%)
10.979.289,92	EUR	10.500.000,00	CHF	20.09.2024	12.029,80	0,00
81.527.000,72	EUR	88.000.000,00	USD	20.09.2024	-259.818,22	-0,02
					-247.788,42	-0,02

Die am 30. Juni 2024 ausstehenden Devisentermingeschäfte für währungsgesicherte Anteilklassen werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) EUR	Nettoteilfondsvermögen (%)
969.846,80	EUR	821.500,00	GBP	23.07.2024	1.765,78	0,00
40.349.260,00	GBP	46.915.388,36	EUR	23.07.2024	633.428,14	0,05
56.780,00	GBP	65.810,06	EUR	23.07.2024	1.101,25	0,00
132.820.250,00	CHF	139.999.464,54	EUR	25.09.2024	-1.221.475,47	-0,09
8.497.050,00	USD	7.932.383,30	EUR	23.07.2024	-12.199,86	0,00
					-597.380,16	-0,04

6. Besteuerung

Taxe d'Abonnement

Der jeweilige Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'Abonnement) in Höhe von 0,05 % p. a., welche vierteljährlich auf der Grundlage des Nettoteilfondsvermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird. Für Anteilklassen, die ausschließlich institutionellen Anlegern zugänglich sind, gilt ein ermäßigter Steuersatz von 0,01 % p. a.

7. Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestands

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während der Berichtsperiode getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

8. Gewinnverwendung

Es werden thesaurierende (I2 CHF, I2R, I2 SPEZ, I2 USD) und ausschüttende (I, I GBP, IS, P, R und RS) Anteile ausgegeben.

In der Geschäftsperiode vom 1. Januar 2024 bis zum 30. Juni 2024 erfolgte keine Ausschüttung für den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility und Teilfonds Assenagon Alpha Premium.

9. Umrechnung von Fremdwährungen

Die Vermögenswerte des Fonds sind auf der Grundlage der nachstehenden Kurse per 30. Juni 2024 umgerechnet:

Australischer Dollar	1,604777	= 1 Euro
Britische Pfund	0,847836	= 1 Euro
Hong Kong Dollar	8,367581	= 1 Euro
Japanische Yen	172,401708	= 1 Euro
Schweizer Franken	0,963075	= 1 Euro
US-Dollar	1,071750	= 1 Euro

10. Transaktionskosten

Die Transaktionskosten resultierend aus den Käufen und Verkäufen der Wertpapiere und Derivate für die am 30. Juni 2024 endende Geschäftsperiode werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Transaktionskosten (EUR)
Assenagon Alpha Volatility	2.323.920,31
Assenagon Alpha Premium	283,64
Summe	2.324.203,95

Die Transaktionskosten, die in der Aufwands- und Ertragsrechnung ausgewiesen werden, sind in dem oben genannten Betrag enthalten. Sie stehen im direkten Zusammenhang mit den Käufen und Verkäufen von Wertpapieren. Darüber hinaus wurden hier auch jene Transaktionskosten ausgewiesen, die auf Grund verschiedener buchungstechnischer Restriktionen den Anschaffungskosten der verschiedenen Wertpapiere zugerechnet wurden und daher bereits in den unrealisierten und realisierten Gewinnen/Verlusten enthalten sind.

11. Besicherung der Derivate

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Zum Stichtag stellte der Teilfonds folgende Sicherheiten ("Collateral") für die im Halbjahresbericht ausgewiesenen Derivate. Die gestellten Sicherheiten sind im Bankguthaben in der Bilanz enthalten.

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BofA Securities Europe SA	Barmittel	25.150.000,00
Citigroup Global Markets Europe AG	Barmittel	1.740.000,00
Credit Suisse Bank (Europe)	Barmittel	320.000,00
Goldman Sachs Bank Europe SE	Barmittel	7.710.000,00
JP Morgan AG	Barmittel	20.760.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	27.660.000,00
Société Générale (Paris)	Barmittel	17.620.000,00
UBS AG	Barmittel	43.680.000,00

Zum Stichtag wurden dem Teilfonds folgende Sicherheiten ("Collateral") für die im Halbjahresbericht ausgewiesenen Derivate zur Reduzierung des Kontrahentenrisikos gestellt:

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BNP Paribas S.A. Paris	Barmittel	23.570.000,00
HSBC Continental Europe	Barmittel	5.500.000,00

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Zum Stichtag wurden dem Teilfonds folgende Sicherheiten ("Collateral") für die im Halbjahresbericht ausgewiesenen Derivate zur Reduzierung des Kontrahentenrisikos gestellt:

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
Goldman Sachs Bank Europe SE	Barmittel	630.000,00
JP Morgan AG	Barmittel	1.110.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	550.000,00
UBS AG	Barmittel	480.000,00

12. Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Der Teilfonds hat in der Geschäftsperiode Derivategeschäfte mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

Kontrahent
Bank of America
BNP Paribas S.A.
BofA Securities Europe SA
Brown Brothers Harriman & Co
Citigroup Global Markets Europe AG
Credit Suisse Bank (Europe)
Goldman Sachs Bank Europe SE
HSBC Continental Europe
HSBC Bank PLC
JP Morgan SE
JP Morgan Securities PLC.
Morgan Stanley Bank AG
Morgan Stanley & Co. International
Morgan Stanley Europe SE
Société Générale (Paris)
UBS AG (London)

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Der Teilfonds hat in der Geschäftsperiode Derivategeschäfte mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

Kontrahent
BNP Paribas S.A.
Goldman Sachs Bank Europe SE
HSBC Bank PLC
JP Morgan Securities PLC
Morgan Stanley Bank AG
Morgan Stanley & Co. International
Morgan Stanley Europe SE
UBS AG (London)

13. Wesentliche Ereignisse im Laufe der Geschäftsperiode

Mit Wirkung zum 1. Januar 2024 werden der bisherige Vertreter in der Schweiz Carnegie Fund Services S.A. 11, rue du Général-Dufour 1204 Genf, Schweiz und die bisherige Zahlstelle Banque Cantonale de Genève 17, Quai de l'Île 1204 Genf, Schweiz durch Reyl & Cie S.A. 4, rue du Rhône, 1204 Genf, Schweiz ersetzt.

Ab dem 1. Januar 2024 ist Reyl & Cie S.A der neue Vertreter und die Zahlstelle in der Schweiz.

Ab dem 1. Januar 2024 ist die Zweigniederlassung München unter folgender Adresse registriert:

Assenagon Asset Management S.A.
 Zweigniederlassung München
 Landsberger Straße 346
 80687 München

14. Wesentliche Ereignisse nach Bilanzstichtag 30. Juni 2024

Mit Wirkung zum 8. Juli 2024 trat der neue Verkaufsprospekt des Assenagon Alpha in Kraft, der hauptsächlich folgende Änderungen beinhaltet:

- Streichung der Verwässerungsabgabe beim Teilfonds Assenagon Alpha Premium (bisher "bis zu 2%");
- Schuldverschreibungen müssen in beiden Teilfonds zumindest ein Rating von BBB- nach Standard & Poor's oder Fitch bzw. Baa3 nach Moody's aufweisen (bisher B- nach Standard & Poor's oder Fitch bzw. B3 nach Moody's);
- Anteilsklasse I (ISIN: LU0575255335) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "I" auf "I2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse I2 (ISIN: LU2001392757) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "I2" auf "I" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse I GBP (ISIN: LU1864491771) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "I GBP" auf "I2 GBP" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse I2 GBP (ISIN: LU2001392831) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "I2 GBP" auf "I GBP" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse P (ISIN: LU0575268312) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "P" auf "P2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse P2 (ISIN: LU2001393052) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "P2" auf "P" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse R (ISIN: LU2001393136) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "R" auf "R2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse R2 (ISIN: LU2001393219) des Assenagon Alpha Volatility; Änderung des Namens von "R2" auf "R" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse I (ISIN: LU2053560707) des Assenagon Alpha Premium; Änderung des Namens von "I" auf "I2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse I2 (ISIN: LU2053560889) des Assenagon Alpha Premium; Änderung des Namens von "I2" auf "I" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";

- Anteilsklasse P (ISIN: LU2053561937) des Assenagon Alpha Premium: Änderung des Namens von "P" auf "P2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse P2 (ISIN: LU2053562075) des Assenagon Alpha Premium: Änderung des Namens von "P2" auf "P" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse R (ISIN: LU2053562158) des Assenagon Alpha Premium: Änderung des Namens von "R" auf "R2" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- Anteilsklasse R2 (ISIN: LU2053562232) des Assenagon Alpha Premium: Änderung des Namens von "R2" auf "P" und Änderung der Ertragsverwendung von "Thesaurierend" auf "Ausschüttend";
- Anteilsklasse RS (ISIN: LU2078663007) des Assenagon Alpha Premium: Änderung des Namens von "RS" auf "R2S" und Änderung der Ertragsverwendung von "Ausschüttend" auf "Thesaurierend";
- grundsätzlich Streichung des Mindestanlagebetrages für institutionelle Anteilklassen im Assenagon Alpha Premium und Assenagon Alpha Volatility;
- sonstige formale Aktualisierungen.

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Allgemein

Assenagon Alpha ist ein Investmentfonds nach luxemburgischem Recht, der als „Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples“ aufgelegt wurde.

Vertreter in der Schweiz ist:

Reyl & Cie S.A.
4, rue du Rhône
1204 Genf
Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz ist:

Reyl & Cie S.A.
4, rue du Rhône
1204 Genf
Schweiz

Bezugsort für maßgebliche Dokumente

Das Verwaltungsreglement sowie der Prospekt und die „Wesentlichen Informationen für die Anleger“, die Liste über die Aufstellung der Käufe und Verkäufe sowie der Jahres- und Halbjahresbericht des Fonds können in der Schweiz kostenlos bei den oben genannten Vertreter bezogen werden. Die Veröffentlichungen der Anteilpreise in der Schweiz erfolgen auf der elektronischen Plattform der Gesellschaft fundinfo AG (www.fundinfo.com).

Total Expense Ratio

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio oder „TER“), drückt das Verhältnis der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme der Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens innerhalb einer 12 Monats-Periode aus.

	Anteilklasse	Total Expense Ratio per 30. Juni 2024 (inkl. Performance Fee)	Performance Fee per 30. Juni 2024
Assenagon Alpha Volatility	I	1,03 %	-
	I2 CHF	1,03 %	-
	I2 SPEZ	0,23 %	-
	I2 USD	1,03 %	-
	I GBP	1,03 %	0,00 %
Assenagon Alpha Premium	P	1,77 %	-
	R	1,07 %	-
	I	0,95 %	0,00 %
	I2R	1,16 %	-
	IS	0,80 %	0,03 %
	P	1,69 %	0,03 %
	R	1,04 %	0,06 %
	RS	0,82 %	0,01 %

Hinweis: Die nach Asset Management Association Switzerland ermittelten Kostenausweise können sich u.a. in methodischen Details, Betrachtungszeiträumen von Ausweisen in anderen Berichten unterscheiden.

Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäß den Richtlinien der Asset Management Association Switzerland in der aktuell gültigen Fassung berechnet. Gemäß Ziffer 8. dieser Richtlinie wird bei neu gegründeten kollektiven Kapitalanlagen der Betriebsaufwand annualisiert, um vergleichbare Ergebnisse zu erhalten.

Risikomanagementverfahren (ungeprüft)

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die Verwaltungsgesellschaft ermittelt die Bestimmung des Gesamtrisikos auf der Grundlage des Ansatzes des absoluten Value-at-Risk (VaR).

Aufgrund der Anlagestrategie des Teilfonds wird erwartet, dass die Hebelwirkung aus dem Einsatz von Derivaten nach Summe der Nennwerte nicht mehr als das 19-fache des Nettoteilfondsvermögens beträgt. Die erwartete Hebelwirkung kann unter besonderen Umständen aber auch höher sein. Bei währungsgesicherten Anteilsklassen erhöht sich die erwartete Hebelwirkung nach Summe der Nennwerte durch den Einsatz von Devisentermingeschäften um ungefähr 100 %.

Auslastung des VaR Limits von 12,5 %*	
Maximum	47,08 % ⁽¹⁾
Minimum	12,90 % ⁽¹⁾
Durchschnitt	29,66 % ⁽¹⁾
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	1.157,40 % ⁽²⁾

* Das VaR Limit wird entsprechend des Risikoprofils und der Assenagon Risk Management Policy definiert.

⁽¹⁾ Das Risikomaß gibt an, welchen Wert der Verlust des Portfolios mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % bei einer Haltedauer von 20 Tagen nicht überschreitet.

⁽²⁾ Es handelt sich um die durchschnittliche Hebelwirkung in der abgelaufenen Geschäftsperiode.

Das VaR wird mit dem Modell der historischen Simulation über einen Beobachtungszeitraum von einem Jahr, einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von 20 Arbeitstagen berechnet.

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Die Verwaltungsgesellschaft ermittelt die Bestimmung des Gesamtrisikos auf der Grundlage des Ansatzes des absoluten Value-at-Risk (VaR).

Aufgrund der Anlagestrategie des Teilfonds wird erwartet, dass die Hebelwirkung aus dem Einsatz von Derivaten nach Summe der Nennwerte nicht mehr als das 15-fache des Nettoteilfondsvermögens beträgt. Die erwartete Hebelwirkung kann unter besonderen Umständen (wie z.B. für Absicherungszwecke, um das bestehende Risiko Exposure im Falle von ungewöhnlichen Marktbewegungen oder Anteilsrücknahmen beizubehalten) aber auch höher sein. Bei währungsgesicherten Anteilsklassen erhöht sich die erwartete Hebelwirkung nach Summe der Nennwerte durch den Einsatz von Devisentermingeschäften um ungefähr 100 %.

Auslastung des VaR Limits von 12,5 %*	
Maximum	51,36 % ⁽¹⁾
Minimum	17,61 % ⁽¹⁾
Durchschnitt	32,88 % ⁽¹⁾
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	379,01 % ⁽²⁾

* Das VaR Limit wird entsprechend des Risikoprofils und der Assenagon Risk Management Policy definiert.

⁽¹⁾ Das Risikomaß gibt an, welchen Wert der Verlust des Portfolios mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % bei einer Haltedauer von 20 Tagen nicht überschreitet.

⁽²⁾ Es handelt sich um die durchschnittliche Hebelwirkung in der abgelaufenen Geschäftsperiode.

Das VaR wird mit dem Modell der historischen Simulation über einen Beobachtungszeitraum von einem Jahr, einem Konfidenzniveau von 99 % und einer Haltedauer von 20 Arbeitstagen berechnet.

Angaben zur Mitarbeitervergütung (ungeprüft)

Der Verwaltungsrat bildet den Vergütungsausschuss der Assenagon Asset Management S.A. Dieses Gremium entscheidet über die Leitsätze des Vergütungssystems sowie deren Umsetzung.

Das innerhalb von Assenagon Asset Management S.A. angewandte Vergütungssystem orientiert sich an der Unternehmensstrategie und trägt dazu bei, dass die Geschäftsziele erreicht werden, korrektes Verhalten belohnt sowie Mehrwert für Aktionäre und Investoren geschaffen und den geltenden aufsichtsrechtlichen Empfehlungen entsprochen wird. Ein Eingehen von überhöhten Risiken wird dabei nicht belohnt sondern klar abgelehnt.

Die Zielsetzungen der Vergütungsstruktur basieren auf den folgenden Grundsätzen:

- Betonung der langfristigen und strategischen Unternehmensziele
- Maximierung der Leistung der Mitarbeiter und des Unternehmens
- Gewinnung und Bindung der besten Mitarbeiterpotenziale
- Einfache und transparente Vergütungsstruktur
- Ausrichtung der Vergütung an individueller Leistung des Mitarbeiters, den Ergebnisbeiträgen der Geschäftsbereiche und dem Unternehmensergebnis
- Berücksichtigung verschiedener Aufgabenbereiche und Verantwortungsebenen
- Möglichkeit des Einsatzes variabler Vergütungselemente im Falle eines positiven Unternehmensergebnisses
- Ausdrückliche Berücksichtigung und Bewertung von Leistungen im Zusammenhang mit Nachhaltigkeit und ESG

Die Leitsätze des Vergütungssystems berücksichtigen, dass:

- im Falle von Bonuszahlungen die Gesamtvergütung des Mitarbeiters in einem ausgewogenen Verhältnis von variablen und fixen Zahlungen steht, wobei die Vergütungskomponenten und deren Höhe je Mitarbeiter und Position variieren.
- es nur im Falle von Neueinstellung von Mitarbeitern aus bestehenden Arbeitsverhältnissen in Ausnahmefällen zur Zahlung von garantierten Boni kommen kann.
- die variable Vergütung für die Mitarbeiter ein wirksamer Verhaltensanreiz ist, die Geschäfte im Sinne der Firma zu gestalten, es jedoch dafür Sorge getragen wird, dass keine signifikante Abhängigkeit von der variablen Vergütung besteht.

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr 2023

Assenagon Asset Management S.A.	Angaben in Euro
Personalbestand Jahresdurchschnitt	83
Gesamtvergütung	13,033 Mio.
- davon feste Vergütung	9,0 – 9,5 Mio.
- davon variable Vergütung	3,5 – 4,0 Mio.
Gesamtvergütung an die Geschäftsführer	1,5 – 2,0 Mio.
Gesamtvergütung an weitere Risikoträger	5,5 – 6,0 Mio.

Die Leitsätze des Vergütungssystems werden mindestens einmal jährlich einer Überprüfung unterzogen. Die Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik, darunter eine Beschreibung, wie die Vergütung und die sonstigen Zuwendungen berechnet werden, sind über die Website www.assenagon.com/anlegerinformationen zugänglich. Auf Anfrage wird dem Anleger eine Papierversion dieser Vergütungspolitik kostenlos zur Verfügung gestellt.

Sonstige Angaben (ungeprüft)

Aufgelaufene Performance Fee innerhalb der Berichtsperiode

Die europäische Wertpapier- und Kapitalmarktaufsicht ESMA (European Securities and Markets Authority) fordert in Ihrer "Leitlinie zur erfolgsabhängigen Vergütung in OGAW und bestimmten Arten von AIF" [esma34-39-992] in Leitlinie Nr. 5 Punkt 49 die tatsächlichen Beträge der berechneten erfolgsabhängigen Vergütung (Performance Fee) und den prozentualen Anteil auf Grundlage des Nettoinventarwerts der Anteilklasse in den Rechenschaftsberichten der Fonds (Halbjahresberichte und Jahresberichte) für die jeweilige Berichtsperiode darzulegen.

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee in %*
I	0,00	0,00 %
I2 CHF	0,00	0,00 %
I2 SPEZ	0,00	0,00 %
I2 USD	0,00	0,00 %
I GBP	12,56	0,00 %
P	0,00	0,00 %
R	0,00	0,00 %
insgesamt	12,56	

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee in %*
I	37.284,11	0,03 %
I2R	0,00	0,00 %
IS	62.885,04	0,11 %
P	35,30	0,03 %
R	445,38	0,00 %
RS	10.631,33	0,10 %
insgesamt	111.281,16	

* Die relative Performance Fee ergibt sich als Summe aus

a) der Summe der täglichen Kristallisierungen aus Anteilscheinrückgaben relativ zum Nettovermögen der Anteilklasse des Vortages und

b) der aufgelaufenen Performance Fee Abgrenzung zum Geschäftsjahresende relativ zum Nettovermögen der Anteilklasse am Geschäftsjahresende

Die ausgewiesenen Performance-Fee-Anteile lassen keinen Rückschluss auf die erzielte Wertentwicklung des Fondsinvestments eines einzelnen Investors zu.

Pflichten im Hinblick auf Wertpapierfinanzierungsgeschäfte - Verordnung zur Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR).

Am 23. Dezember 2015 wurde die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (SFTR) im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlicht.

Die SFTR regelt im Wesentlichen Verpflichtungen im Hinblick auf sogenannte „Wertpapierfinanzierungsgeschäfte“ (WFG). Durch die SFTR werden für den Abschluss, die Änderung oder Beendigung von WFG neben den nach EMIR bereits bestehenden Reportingverpflichtungen (die aber für WFG grundsätzlich nicht anwendbar sind) zusätzliche Meldepflichten begründet.

Der Assenagon Alpha unterhielt keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamtrendite-Swaps in der Geschäftsperiode zum 30. Juni 2024. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannten Regulierung finden daher keine Anwendung.

Pflichten im Hinblick auf Offenlegungsverordnung - Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR).

Assenagon Alpha Volatility

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Assenagon Alpha Premium

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

assenagon

Assenagon Asset Management S.A.

Aerogolf Center

1B Heienhaff

1736 Senningerberg

Luxemburg

Telefon +352 27049-100

Telefax +352 27049-111

www.assenagon.com

© 2024