assenagon

Halbjahres-bericht

Assenagon Alpha

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2021

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

Inhalt

Verwaltung und Administration

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

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

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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

Konsolidierte Darstellung

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

Erläuterungen zum Halbjahresbericht

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Risikomanagementverfahren

Sonstige Angaben

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 und des aktuellen ausführlichen Verkaufsprospekts erfolgen, ergänzt durch den jeweiligen letzten Jahresbericht, inklusive geprüftem Jahresabschluss, erfolgen. 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 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 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: Carnegie Fund Services S.A., 11, rue du Général-Dufour, 1204 Genf, Schweiz, Tel.: + 41 22 7051177, Fax: + 41 22 7051179, Web: www.carnegie-fund-services.ch. Zahlstelle in der Schweiz ist Banque Cantonale de Genève, 17, Quai de l'Ile, 1204 Genf. Die aktuellen Anteilpreise können unter www.fundinfo.com abgerufen werden.

Verwaltung und Administration

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

VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT
Hans Günther Bonk (Vorsitzender)
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig
KoppaKontor GmbH, vertreten durch Dr. Immo Querner
(ab 1. Februar 2021)

GESCHÄFTSFÜHRER DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT
Holger Herber
Michael Hünseler (bis 17. März 2021)
Matthias Kunze
Dr. Dr. Heimo Plössnig
Thomas Romig
Philip Seegerer

VERWAHRSTELLE, ZENTRALVERWALTUNG, ZAHL-, REGISTER- UND TRANSFERSTELLE IN LUXEMBURG
Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, Route d'Esch, BP.403
1470 Luxemburg
Luxemburg

VERTRIEBS- UND INFORMATIONS-STELLE IN DEUTSCHLAND
Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Prannerstraße 8
80333 München
Deutschland

ZAHL-, VERTRIEBS- UND INFORMATIONS-STELLE IN ÖSTERREICH
Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Am Belvedere 1
1100 Wien
Österreich

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

ABSCHLUSSPRÜFER DES FONDS UND DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT
Deloitte Audit, *Société à responsabilité limitée*
20 Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg
Luxemburg

ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ
Banque Cantonale de Genève
17, Quai de l'Ile
1204 Genf
Schweiz

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
	Deutschland				
DE0001135473	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 04.07.2022	26.000.000	EUR	26.639.613,00	2,78
DE0001104834	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.03.2023	40.000.000	EUR	40.455.367,60	4,23
DE0001104800	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.06.2022	30.000.000	EUR	30.186.096,00	3,15
DE0001104784	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.12.2021	20.000.000	EUR	20.058.260,00	2,10
DE0001104842	Bundesschatzanweisungen 0 %, 16.06.2023	15.000.000	EUR	15.196.935,00	1,59
				132.536.271,60	**13,85**
	Vereinigte Staaten				
US912828YF19	U.S. Treasury Note 1,5 %, 15.09.2022	15.000.000	USD	12.859.102,20	1,34
				12.859.102,20	**1,34**
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				**145.395.373,80**	**15,19**
Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.				**145.395.373,80**	**15,19**

Tagesgelder

Kontrahent	Zinssatz	Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
	Deutschland			
Bayerische Landesbank	0,00 %	USD	25.297.242,60	2,64
Bayerische Landesbank	(0,62) %	EUR	85.000.000,00	8,88
DekaBank	(0,70) %	EUR	115.000.000,00	12,02
DZ Bank AG	(0,65) %	EUR	80.000.000,00	8,36
Landesbank Baden Württemberg	(0,70) %	EUR	115.000.000,00	12,02
			420.297.242,60	**43,92**
Summe Tagesgelder			**420.297.242,60**	**43,92**

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
DAX Index	Sep 2021 (call, strike 15.447,00)	110	EUR	54.643,11	0,01
DAX Index	Sep 2021 (put, strike 15.447,00)	-110	EUR	-46.008,54	0,00
DAX Index	Sep 2021 (call, strike 15.600,00)	100	EUR	40.175,39	0,00
DAX Index	Sep 2021 (put, strike 15.600,00)	-100	EUR	-47.640,41	0,00
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.300,00)	1.100	EUR	64.969,65	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.300,00)	-1.100	EUR	-64.969,65	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.500,00)	1.450	EUR	93.652,19	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.500,00)	1.400	EUR	90.422,81	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.500,00)	-1.400	EUR	-90.422,81	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 10.500,00)	-1.450	EUR	-93.652,19	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	1.900	EUR	152.798,38	0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	1.400	EUR	112.588,28	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	1.200	EUR	96.504,24	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	1.100	EUR	88.462,22	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	-1.100	EUR	-88.462,22	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	-1.200	EUR	-96.504,24	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	-1.400	EUR	-112.588,28	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.000,00)	-1.900	EUR	-152.798,38	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	2.800	EUR	281.701,12	0,03
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	2.750	EUR	276.670,75	0,03
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	2.100	EUR	211.275,84	0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	1.700	EUR	171.032,82	0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-900	EUR	-90.546,79	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.150	EUR	-115.698,68	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.200	EUR	-120.729,05	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.300	EUR	-130.789,81	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.500	EUR	-150.911,32	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.600	EUR	-160.972,07	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.500,00)	-1.700	EUR	-171.032,82	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.600,00)	1.200	EUR	126.205,93	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.600,00)	-1.200	EUR	-126.205,93	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 11.800,00)	900	EUR	3.436.770,13	0,36
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 11.800,00)	-900	EUR	-3.436.770,13	-0,36
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.800,00)	900	EUR	103.487,46	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 11.800,00)	-900	EUR	-103.487,46	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	2.350	EUR	296.519,71	0,03
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	1.900	EUR	239.739,34	0,03
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	1.400	EUR	176.650,04	0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	1.400	EUR	176.650,04	0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	-1.000	EUR	-126.178,60	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	-1.350	EUR	-170.341,11	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	-1.400	EUR	-176.650,04	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	-1.400	EUR	-176.650,04	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.000,00)	-1.900	EUR	-239.739,34	-0,02
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	760	EUR	2.402.323,49	0,25
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	560	EUR	1.770.133,10	0,19
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	470	EUR	1.485.647,42	0,16
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	450	EUR	1.422.428,38	0,15
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	-650	EUR	-2.054.618,78	-0,21
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	-650	EUR	-2.054.618,78	-0,21
DAX Index	Dez 2021 (call, strike 12.500,00)	-940	EUR	-2.971.294,85	-0,31
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	760	EUR	120.861,14	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	560	EUR	89.055,58	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	470	EUR	74.743,07	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	450	EUR	71.562,52	0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	-650	EUR	-103.368,08	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	-650	EUR	-103.368,08	-0,01
DAX Index	Dez 2021 (put, strike 12.500,00)	-940	EUR	-149.486,15	-0,02
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 10.400,00)	1.250	EUR	207.310,20	0,02
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 10.400,00)	-1.250	EUR	-207.310,20	-0,02
DAX Index	Jun 2022 (call, strike 12.000,00)	530	EUR	2.019.964,78	0,21
DAX Index	Jun 2022 (call, strike 12.000,00)	-530	EUR	-2.019.964,78	-0,21
DAX Index	Jun 2022 (call, strike 12.000,00)	-700	EUR	-2.667.878,01	-0,28
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	1.500	EUR	453.536,17	0,05
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	530	EUR	160.249,45	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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	-530	EUR	-160.249,45	-0,02
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	-700	EUR	-211.650,21	-0,02
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	-1.150	EUR	-347.711,07	-0,04
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	-1.200	EUR	-362.828,94	-0,04
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.000,00)	-1.500	EUR	-453.536,17	-0,05
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.500,00)	-1.250	EUR	-454.334,13	-0,05
DAX Index	Jun 2022 (call, strike 12.800,00)	-750	EUR	-2.333.116,80	-0,24
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 12.800,00)	-750	EUR	-304.401,90	-0,03
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.350	EUR	-589.531,70	-0,06
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.700	EUR	-742.373,26	-0,08
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 14.000,00)	1.100	EUR	691.794,82	0,07
DAX Index	Jun 2022 (put, strike 14.000,00)	-1.100	EUR	-691.794,82	-0,07
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.000,00)	-1.300	EUR	-594.491,25	-0,06
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.000,00)	-2.200	EUR	-1.006.062,11	-0,11
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.200,00)	-600	EUR	-292.858,25	-0,03
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.200,00)	-900	EUR	-439.287,37	-0,05
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.500,00)	-1.100	EUR	-591.261,73	-0,06
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.500,00)	-1.300	EUR	-698.763,86	-0,07
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.500,00)	-1.400	EUR	-752.514,93	-0,08
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.500,00)	-1.600	EUR	-860.017,06	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 12.700,00)	-1.800	EUR	-1.031.876,94	-0,11
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	1.100	EUR	694.068,22	0,07
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.000	EUR	-630.971,11	-0,07
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.100	EUR	-694.068,22	-0,07
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.250	EUR	-788.713,89	-0,08
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.400	EUR	-883.359,56	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.400	EUR	-883.359,56	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.000,00)	-1.800	EUR	-1.135.748,00	-0,12
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.200,00)	-1.350	EUR	-907.404,21	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (call, strike 13.500,00)	-800	EUR	-2.157.845,92	-0,23
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.500,00)	-800	EUR	-591.508,27	-0,06
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 13.500,00)	-2.200	EUR	-1.626.647,74	-0,17
DAX Index	Dez 2022 (call, strike 14.500,00)	-550	EUR	-1.080.964,08	-0,11
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 14.500,00)	-550	EUR	-558.082,56	-0,06
DAX Index	Dez 2022 (call, strike 14.800,00)	-500	EUR	-882.073,46	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 14.800,00)	-500	EUR	-557.810,88	-0,06
DAX Index	Dez 2022 (call, strike 15.000,00)	-500	EUR	-817.501,92	-0,09
DAX Index	Dez 2022 (put, strike 15.000,00)	-500	EUR	-593.962,19	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Sep 2021 (call, strike 4.112,00)	520	EUR	41.898,98	0,00
Euro Stoxx 50® Index	Sep 2021 (put, strike 4.112,00)	-520	EUR	-71.506,51	-0,01
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-4.500	EUR	-551.905,55	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-7.600	EUR	-932.107,15	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2022 (call, strike 3.700,00)	-4.000	EUR	-1.739.058,59	-0,18
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2022 (put, strike 3.700,00)	-4.000	EUR	-761.409,44	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.250,00)	-6.800	EUR	-1.003.707,79	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.300,00)	-4.500	EUR	-707.434,97	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.300,00)	-5.000	EUR	-786.038,85	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.300,00)	-5.000	EUR	-786.038,85	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.400,00)	-4.000	EUR	-714.321,97	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.400,00)	-6.500	EUR	-1.160.773,20	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.200	EUR	-1.197.201,70	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.300	EUR	-1.220.224,81	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.700	EUR	-1.312.317,25	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-7.500	EUR	-1.726.733,23	-0,18
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.000	EUR	-1.567.035,73	-0,16

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.000	EUR	-819.748,42	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.000	EUR	-592.930,45	-0,06
FTSE 100 Index	Sep 2021 (call, strike 6.990,00)	310	GBP	61.248,23	0,01
FTSE 100 Index	Sep 2021 (put, strike 6.990,00)	-310	GBP	-68.301,18	-0,01
FTSE 100 Index	Sep 2021 (call, strike 7.028,00)	-740	GBP	-127.725,69	-0,01
FTSE 100 Index	Sep 2021 (put, strike 7.028,00)	740	GBP	177.313,38	0,02
FTSE 100 Index	Sep 2021 (call, strike 7.087,00)	-500	GBP	-68.499,94	-0,01
FTSE 100 Index	Sep 2021 (put, strike 7.087,00)	500	GBP	136.364,05	0,01
FTSE 100 Index	Dez 2021 (call, strike 5.600,00)	1.500	GBP	2.430.648,53	0,25
FTSE 100 Index	Dez 2021 (call, strike 5.600,00)	-1.500	GBP	-2.430.648,53	-0,25
FTSE 100 Index	Dez 2021 (put, strike 5.600,00)	1.500	GBP	96.161,58	0,01
FTSE 100 Index	Dez 2021 (put, strike 5.600,00)	-1.500	GBP	-96.161,58	-0,01
FTSE 100 Index	Dez 2021 (put, strike 6.400,00)	1.500	GBP	243.992,90	0,03
FTSE 100 Index	Dez 2021 (put, strike 6.400,00)	-1.500	GBP	-243.992,90	-0,03
FTSE 100 Index	Jun 2022 (put, strike 5.000,00)	-7.000	GBP	-673.476,94	-0,07
FTSE 100 Index	Jun 2022 (put, strike 5.900,00)	-1.900	GBP	-406.280,99	-0,04
FTSE 100 Index	Jun 2022 (call, strike 6.000,00)	1.700	GBP	2.020.402,03	0,21
FTSE 100 Index	Jun 2022 (call, strike 6.000,00)	-1.700	GBP	-2.020.402,03	-0,21
FTSE 100 Index	Jun 2022 (put, strike 6.000,00)	1.700	GBP	397.634,60	0,04
FTSE 100 Index	Jun 2022 (put, strike 6.000,00)	-1.700	GBP	-397.634,60	-0,04
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.500,00)	-3.800	GBP	-893.034,75	-0,09
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.500,00)	-5.000	GBP	-1.175.045,73	-0,12
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.600,00)	-3.100	GBP	-788.484,89	-0,08
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-1.800	GBP	-537.443,43	-0,06
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-2.000	GBP	-597.159,37	-0,06
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-2.500	GBP	-746.449,23	-0,08
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-2.500	GBP	-746.449,23	-0,08
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-2.700	GBP	-806.165,16	-0,08
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 5.800,00)	-3.000	GBP	-895.739,07	-0,09
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 6.000,00)	-2.650	GBP	-928.218,03	-0,10
FTSE 100 Index	Dez 2022 (call, strike 6.300,00)	-1.700	GBP	-1.580.532,70	-0,17
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 6.300,00)	-1.700	GBP	-758.065,86	-0,08
FTSE 100 Index	Dez 2022 (call, strike 6.400,00)	-1.100	GBP	-935.745,12	-0,10
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 6.400,00)	-1.100	GBP	-531.169,84	-0,06
FTSE 100 Index	Dez 2022 (put, strike 6.500,00)	-2.000	GBP	-1.046.685,24	-0,11
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (put, strike 9.000,00)	38.000	HKD	447.889,58	0,05
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (put, strike 9.000,00)	-38.000	HKD	-447.889,58	-0,05
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (call, strike 9.500,00)	7.000	HKD	942.369,14	0,10
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (put, strike 9.500,00)	7.000	HKD	138.682,33	0,01
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (put, strike 9.500,00)	-7.000	HKD	-138.682,33	-0,01
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (call, strike 9.600,00)	10.000	HKD	1.375.336,76	0,14
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (call, strike 9.600,00)	-10.000	HKD	-1.375.336,76	-0,14
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (put, strike 9.600,00)	10.000	HKD	472.572,14	0,05
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (put, strike 9.600,00)	-10.000	HKD	-472.572,14	-0,05
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (put, strike 10.000,00)	17.000	HKD	1.070.101,05	0,11
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (put, strike 10.000,00)	12.000	HKD	755.365,44	0,08
Hang Seng China Enterprises Index	Jun 2022 (put, strike 10.000,00)	-29.000	HKD	-1.825.466,49	-0,19
MetLife, Inc.	Jan 2022 (put, strike 56,00)	160.000	USD	462.824,86	0,05
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (call, strike 11.900,00)	1.500	USD	3.584.302,45	0,37
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (call, strike 11.900,00)	-1.500	USD	-3.584.302,45	-0,37
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (put, strike 11.900,00)	1.500	USD	255.699,06	0,03
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (put, strike 11.900,00)	-1.500	USD	-255.699,06	-0,03
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (put, strike 12.300,00)	2.000	USD	419.440,76	0,04
NASDAQ 100 Index	Dez 2021 (put, strike 12.300,00)	-2.000	USD	-419.440,76	-0,04
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.174,00)	-1.765	USD	-282.033,40	-0,03

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.174,00)	1.765	USD	111.229,80	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.202,00)	2.000	USD	282.901,00	0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.202,00)	-2.000	USD	-136.563,51	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.205,00)	-2.187	USD	-305.133,71	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.205,00)	2.187	USD	150.644,56	0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.214,00)	-1.792	USD	-239.840,95	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.214,00)	-1.920	USD	-256.972,44	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.214,00)	1.920	USD	135.911,04	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.214,00)	1.792	USD	126.850,30	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.219,00)	2.064	USD	269.801,24	0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.219,00)	-1.830	USD	-239.213,31	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.219,00)	1.830	USD	131.540,05	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.219,00)	-2.064	USD	-148.359,93	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.220,00)	800	USD	104.076,71	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.220,00)	-1.680	USD	-218.561,09	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.220,00)	-2.000	USD	-260.191,78	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.220,00)	2.000	USD	144.202,08	0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.220,00)	1.680	USD	121.129,75	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.220,00)	-800	USD	-57.680,83	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.228,00)	840	USD	105.129,77	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.228,00)	-1.680	USD	-210.259,55	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.228,00)	1.680	USD	124.158,04	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.228,00)	-840	USD	-62.079,02	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.235,00)	-3.938	USD	-476.024,15	-0,05
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.235,00)	3.938	USD	297.436,09	0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.240,00)	-3.510	USD	-413.671,21	-0,04
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.240,00)	3.510	USD	269.287,46	0,03
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.255,00)	-1.200	USD	-130.717,60	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.255,00)	1.200	USD	96.529,52	0,01
S&P 500 Index	Sep 2021 (call, strike 4.288,00)	-7.700	USD	-694.223,95	-0,07
S&P 500 Index	Sep 2021 (put, strike 4.288,00)	7.700	USD	689.055,26	0,07
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.600,00)	4.900	USD	44.847,62	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.600,00)	-4.900	USD	-44.847,62	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	13.000	USD	138.714,90	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	9.000	USD	96.033,39	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	7.500	USD	80.027,83	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	6.400	USD	68.290,41	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	5.800	USD	61.888,19	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	4.800	USD	51.217,81	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	-5.800	USD	-61.888,19	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	-6.400	USD	-68.290,41	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	-7.500	USD	-80.027,83	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.700,00)	-26.800	USD	-285.966,10	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.800,00)	8.000	USD	99.142,52	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.800,00)	5.000	USD	61.964,08	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.800,00)	-5.000	USD	-61.964,08	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.800,00)	-8.000	USD	-99.142,52	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 2.900,00)	3.000	USD	3.528.182,43	0,37
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 2.900,00)	-3.000	USD	-3.528.182,43	-0,37
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 2.900,00)	-4.000	USD	-4.704.243,23	-0,49
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.900,00)	3.000	USD	43.514,26	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.900,00)	-3.000	USD	-43.514,26	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 2.900,00)	-4.000	USD	-58.019,01	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	10.300	USD	174.242,82	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	8.500	USD	143.792,62	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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	6.500	USD	109.959,06	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	6.500	USD	109.959,06	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	6.200	USD	104.884,03	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	6.000	USD	101.500,67	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-4.500	USD	-76.125,51	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-5.800	USD	-98.117,32	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-6.000	USD	-101.500,67	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-6.200	USD	-104.884,03	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-8.500	USD	-143.792,62	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.000,00)	-13.000	USD	-219.918,12	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	4.200	USD	4.254.278,75	0,44
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	3.300	USD	3.342.647,58	0,35
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	2.700	USD	2.734.893,48	0,29
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	2.200	USD	2.228.431,72	0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	2.000	USD	2.025.847,02	0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	2.000	USD	2.025.847,02	0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-1.100	USD	-1.114.215,86	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-2.000	USD	-2.025.847,02	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-2.000	USD	-2.025.847,02	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-2.900	USD	-2.937.478,19	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-2.900	USD	-2.937.478,19	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-3.100	USD	-3.140.062,89	-0,33
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-3.100	USD	-3.140.062,89	-0,33
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.100,00)	-3.300	USD	-3.342.647,58	-0,35
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	10.400	USD	206.971,54	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	10.000	USD	199.011,10	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	8.600	USD	171.149,54	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	7.500	USD	149.258,33	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	7.000	USD	139.307,77	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	6.500	USD	129.357,21	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	6.500	USD	129.357,21	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	6.000	USD	119.406,66	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	4.200	USD	83.584,66	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	3.300	USD	65.673,67	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	2.700	USD	53.733,00	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	2.200	USD	43.782,44	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	2.000	USD	39.802,22	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	2.000	USD	39.802,22	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-2.000	USD	-39.802,22	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-2.000	USD	-39.802,22	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-2.900	USD	-57.713,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-2.900	USD	-57.713,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-3.100	USD	-61.693,44	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-3.100	USD	-61.693,44	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-3.300	USD	-65.673,67	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-6.000	USD	-119.406,66	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-6.500	USD	-129.357,21	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.000	USD	-139.307,77	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.100	USD	-141.297,88	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.500	USD	-149.258,33	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.500	USD	-149.258,33	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.500	USD	-149.258,33	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-7.500	USD	-149.258,33	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.100,00)	-13.000	USD	-258.714,43	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	3.700	USD	3.448.882,11	0,36

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	3.500	USD	3.262.456,04	0,34
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	3.000	USD	2.796.390,89	0,29
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	3.000	USD	2.796.390,89	0,29
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	2.600	USD	2.423.538,77	0,25
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	2.500	USD	2.330.325,74	0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	-2.500	USD	-2.330.325,74	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	-2.700	USD	-2.516.751,81	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	-3.000	USD	-2.796.390,89	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	-3.000	USD	-2.796.390,89	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.200,00)	-9.600	USD	-8.948.450,86	-0,93
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	9.000	USD	210.372,52	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	7.200	USD	168.298,01	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	4.300	USD	100.511,32	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	3.700	USD	86.486,47	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	3.500	USD	81.811,54	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	3.000	USD	70.124,18	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	3.000	USD	70.124,18	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	2.600	USD	60.774,28	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	2.500	USD	58.436,81	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-2.500	USD	-58.436,81	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-2.700	USD	-63.111,75	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-3.000	USD	-70.124,18	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-3.000	USD	-70.124,18	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-3.800	USD	-88.823,95	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-4.300	USD	-100.511,32	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-5.200	USD	-121.548,56	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-7.000	USD	-163.623,07	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-7.200	USD	-168.298,01	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.200,00)	-9.600	USD	-224.397,35	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	3.200	USD	2.854.445,59	0,30
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	3.000	USD	2.676.042,74	0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	2.500	USD	2.230.035,63	0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	2.400	USD	2.140.834,20	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	2.400	USD	2.140.834,20	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	2.400	USD	2.140.834,20	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	-2.500	USD	-2.230.035,63	-0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	-6.200	USD	-5.530.488,35	-0,58
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.250,00)	-7.200	USD	-6.422.502,60	-0,67
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	3.200	USD	81.254,68	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	3.000	USD	76.176,26	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	2.500	USD	63.480,22	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	2.400	USD	60.941,01	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	2.400	USD	60.941,01	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	2.400	USD	60.941,01	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	-2.500	USD	-63.480,22	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	-6.200	USD	-157.430,95	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.250,00)	-7.200	USD	-182.823,03	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	3.500	USD	2.982.391,76	0,31
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	3.100	USD	2.641.546,99	0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	2.900	USD	2.471.124,61	0,26
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	2.700	USD	2.300.702,22	0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	2.500	USD	2.130.279,83	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	1.700	USD	1.448.590,29	0,15
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-1.000	USD	-852.111,93	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-1.700	USD	-1.448.590,29	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-1.750	USD	-1.491.195,88	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.600	USD	-2.215.491,02	-0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-2.300.702,22	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-2.300.702,22	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-2.300.702,22	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.800	USD	-2.385.913,41	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.800	USD	-2.385.913,41	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-2.900	USD	-2.471.124,61	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-2.556.335,80	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-2.556.335,80	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-2.556.335,80	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.100	USD	-2.641.546,99	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.200	USD	-2.726.758,18	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.300,00)	-3.500	USD	-2.982.391,76	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	7.400	USD	204.411,57	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	7.400	USD	204.411,57	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	5.600	USD	154.689,84	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	5.300	USD	146.402,88	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	3.500	USD	96.681,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	3.100	USD	85.631,87	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	2.900	USD	80.107,24	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	2.700	USD	74.582,60	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	2.500	USD	69.057,96	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	1.700	USD	46.959,41	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-1.000	USD	-27.623,19	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-1.700	USD	-46.959,41	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-1.750	USD	-48.340,58	0,00
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.600	USD	-71.820,28	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-74.582,60	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-74.582,60	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.700	USD	-74.582,60	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.800	USD	-77.344,92	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.800	USD	-77.344,92	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-2.900	USD	-80.107,24	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-82.869,56	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-82.869,56	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.000	USD	-82.869,56	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.100	USD	-85.631,87	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.200	USD	-88.394,19	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-3.500	USD	-96.681,15	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-5.300	USD	-146.402,88	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-5.300	USD	-146.402,88	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-5.600	USD	-154.689,84	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-6.800	USD	-187.837,66	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-7.400	USD	-204.411,57	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.300,00)	-7.400	USD	-204.411,57	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	3.200	USD	2.599.678,29	0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	2.800	USD	2.274.718,50	0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	2.600	USD	2.112.238,61	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	2.500	USD	2.030.998,67	0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	2.000	USD	1.624.798,93	0,17
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	1.700	USD	1.381.079,09	0,14
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	1.700	USD	1.381.079,09	0,14
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	-2.500	USD	-2.030.998,67	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	-2.500	USD	-2.030.998,67	-0,21

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	-2.600	USD	-2.112.238,61	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	-3.200	USD	-2.599.678,29	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.350,00)	-6.000	USD	-4.874.396,80	-0,51
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	3.200	USD	96.141,23	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	2.800	USD	84.123,57	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	2.600	USD	78.114,74	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	2.500	USD	75.110,33	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	2.000	USD	60.088,26	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	1.700	USD	51.075,02	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	1.700	USD	51.075,02	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	-2.500	USD	-75.110,33	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	-2.500	USD	-75.110,33	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	-2.600	USD	-78.114,74	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	-3.200	USD	-96.141,23	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.350,00)	-6.000	USD	-180.264,79	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	3.500	USD	2.705.135,63	0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	3.000	USD	2.318.687,68	0,24
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	2.900	USD	2.241.398,09	0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	2.600	USD	2.009.529,33	0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	2.600	USD	2.009.529,33	0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	2.500	USD	1.932.239,73	0,20
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	2.000	USD	1.545.791,79	0,16
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	1.800	USD	1.391.212,61	0,15
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	1.800	USD	1.391.212,61	0,15
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-2.500	USD	-1.932.239,73	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-2.600	USD	-2.009.529,33	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-2.900	USD	-2.241.398,09	-0,23
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-3.400	USD	-2.627.846,04	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-3.500	USD	-2.705.135,63	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-5.200	USD	-4.019.058,65	-0,42
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.400,00)	-6.000	USD	-4.637.375,37	-0,48
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	9.000	USD	294.065,76	0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	3.500	USD	114.358,91	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	3.000	USD	98.021,92	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	2.900	USD	94.754,52	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	2.600	USD	84.952,33	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	2.600	USD	84.952,33	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	2.500	USD	81.684,94	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	2.000	USD	65.347,95	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	1.800	USD	58.813,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	1.800	USD	58.813,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-2.500	USD	-81.684,94	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-2.600	USD	-84.952,33	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-2.900	USD	-94.754,52	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-3.400	USD	-111.091,51	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-3.500	USD	-114.358,91	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-4.500	USD	-147.032,89	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-5.200	USD	-169.904,66	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-5.500	USD	-179.706,86	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-6.000	USD	-196.043,85	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.400,00)	-6.500	USD	-212.380,83	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.450,00)	-2.800	USD	-2.054.161,19	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.450,00)	-2.800	USD	-99.513,37	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.500,00)	3.000	USD	2.083.893,55	0,22
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.500,00)	-3.000	USD	-2.083.893,55	-0,22

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	6.000	USD	232.056,54	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	5.500	USD	212.718,49	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	4.600	USD	177.910,02	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	3.000	USD	116.028,27	0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	-3.000	USD	-116.028,27	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	-4.600	USD	-177.910,02	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	-5.500	USD	-212.718,49	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.500,00)	-6.000	USD	-232.056,54	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	6.000	USD	274.999,48	0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	5.500	USD	252.082,86	0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	5.500	USD	252.082,86	0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	5.000	USD	229.166,24	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-5.000	USD	-229.166,24	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-5.500	USD	-252.082,86	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-5.500	USD	-252.082,86	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-6.000	USD	-274.999,48	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-6.000	USD	-274.999,48	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-6.000	USD	-274.999,48	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.600,00)	-6.500	USD	-297.916,11	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.700,00)	3.000	USD	1.625.286,04	0,17
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-1.625.286,04	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-1.625.286,04	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.700,00)	3.000	USD	163.021,73	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-163.021,73	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-163.021,73	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.800,00)	3.000	USD	1.403.049,07	0,15
S&P 500 Index	Dez 2021 (call, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-1.403.049,07	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.800,00)	3.000	USD	193.585,24	0,02
S&P 500 Index	Dez 2021 (put, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-193.585,24	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.200,00)	-5.000	USD	-4.792.615,14	-0,50
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.200,00)	-5.000	USD	-321.740,42	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.200,00)	-6.800	USD	-437.566,96	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.300,00)	-12.900	USD	-951.903,27	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.300,00)	-14.000	USD	-1.033.073,32	-0,11
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-5.500	USD	-464.224,75	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-5.500	USD	-464.224,75	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-7.600	USD	-641.474,21	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.400,00)	-12.000	USD	-1.012.854,00	-0,11
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.450,00)	-10.000	USD	-901.886,53	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.500,00)	-2.100	USD	-1.549.683,02	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-2.100	USD	-202.243,56	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-4.500	USD	-433.379,07	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-481.532,30	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-5.500	USD	-529.685,53	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-5.500	USD	-529.685,53	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.500,00)	-6.500	USD	-625.991,99	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.550,00)	-16.200	USD	-1.665.300,56	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.600,00)	-3.000	USD	-2.001.425,06	-0,21
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.600,00)	-3.100	USD	-2.068.139,23	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.600,00)	-4.000	USD	-2.668.566,74	-0,28
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-3.000	USD	-329.048,67	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-3.100	USD	-340.016,97	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-4.000	USD	-438.731,56	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.000	USD	-548.414,46	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.300	USD	-581.319,33	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.500	USD	-603.255,91	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.500	USD	-603.255,91	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.800	USD	-636.160,77	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.800	USD	-636.160,77	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-6.400	USD	-701.970,50	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-6.500	USD	-712.938,80	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-6.600	USD	-723.907,08	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-6.700	USD	-734.875,37	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-7.000	USD	-767.780,24	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-8.000	USD	-877.463,13	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-8.000	USD	-877.463,13	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.600,00)	-8.000	USD	-877.463,13	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.650,00)	-7.200	USD	-842.292,39	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.700,00)	-4.000	USD	-2.391.298,56	-0,25
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.700,00)	-4.000	USD	-498.179,53	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.100	USD	-759.723,78	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.500	USD	-809.541,73	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-1.590.612,95	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-1.590.612,95	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.100	USD	-1.643.633,38	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-1.696.653,82	-0,18
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-1.855.715,11	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-1.855.715,11	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.700	USD	-1.961.755,97	-0,20
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.900	USD	-2.067.796,84	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-4.000	USD	-2.120.817,27	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-4.000	USD	-2.120.817,27	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.800,00)	-4.200	USD	-2.226.858,13	-0,23
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-423.310,79	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-423.310,79	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.100	USD	-437.421,16	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-451.531,51	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-493.862,59	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-493.862,59	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.700	USD	-522.083,31	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.900	USD	-550.304,03	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-4.000	USD	-564.414,39	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-4.000	USD	-564.414,39	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-4.200	USD	-592.635,11	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.800,00)	-4.700	USD	-663.186,91	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.850,00)	-2.700	USD	-1.342.396,29	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.850,00)	-2.700	USD	-405.466,05	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-1.114.986,97	-0,12
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 3.900,00)	-2.900	USD	-1.347.275,92	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-383.174,93	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 3.900,00)	-2.900	USD	-463.003,04	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-2.300	USD	-922.020,30	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-2.400	USD	-962.108,14	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-2.700	USD	-1.082.371,65	-0,11
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-3.000	USD	-1.202.635,17	-0,13
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-3.200	USD	-1.282.810,84	-0,13
S&P 500 Index	Jun 2022 (call, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-2.405.270,33	-0,25
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-2.300	USD	-414.312,22	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-2.400	USD	-432.325,79	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-2.700	USD	-486.366,51	-0,05

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen

Indexoptionen

Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-3.000	USD	-540.407,24	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-3.200	USD	-576.434,39	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2022 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-1.080.814,48	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.300,00)	-7.500	USD	-848.834,65	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.400,00)	8.000	USD	1.020.340,48	0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.400,00)	-14.000	USD	-1.785.595,83	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.500,00)	-5.500	USD	-787.336,23	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.500,00)	-6.500	USD	-930.488,27	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.500,00)	-8.000	USD	-1.145.216,33	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.500,00)	-9.800	USD	-1.402.890,01	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.500,00)	-16.000	USD	-2.290.432,67	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.600,00)	-1.800	USD	-1.262.535,44	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.600,00)	-2.000	USD	-1.402.817,15	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-1.800	USD	-288.376,27	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-2.000	USD	-320.418,08	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-5.500	USD	-881.149,73	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-7.000	USD	-1.121.463,29	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-7.000	USD	-1.121.463,29	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-9.500	USD	-1.521.985,89	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.600,00)	-10.500	USD	-1.682.194,93	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.700,00)	-2.400	USD	-1.526.466,35	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.700,00)	-2.900	USD	-1.844.480,18	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.700,00)	-4.600	USD	-2.925.727,18	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-2.400	USD	-429.236,86	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-2.900	USD	-518.661,20	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-4.600	USD	-822.703,98	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-5.200	USD	-930.013,19	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.000	USD	-1.073.092,14	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.000	USD	-1.073.092,14	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.000	USD	-1.073.092,14	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-6.000	USD	-1.073.092,14	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-7.500	USD	-1.341.365,18	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.700,00)	-15.000	USD	-2.682.730,36	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.750,00)	-6.400	USD	-1.208.318,53	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.400	USD	-1.373.744,99	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.400	USD	-1.373.744,99	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.600	USD	-1.488.223,74	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.700	USD	-1.545.463,11	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.800	USD	-1.602.702,49	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-1.659.941,86	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-1.831.659,98	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-1.831.659,98	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.400	USD	-478.164,88	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.400	USD	-478.164,88	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.600	USD	-518.011,95	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.700	USD	-537.935,48	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.800	USD	-557.859,02	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-577.782,56	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-637.553,17	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-3.200	USD	-637.553,17	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-7.000	USD	-1.394.647,55	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.800,00)	-7.500	USD	-1.494.265,23	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-1.276.747,90	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-2.600	USD	-1.327.817,82	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-2.700	USD	-1.378.887,73	-0,14

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 2021 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-3.000	USD	-1.532.097,48	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-1.583.167,39	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-3.900	USD	-1.991.726,72	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 3.900,00)	-6.000	USD	-3.064.194,96	-0,32
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-553.903,39	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-2.600	USD	-576.059,52	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-2.700	USD	-598.215,67	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-3.000	USD	-664.684,07	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-686.840,21	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-3.900	USD	-864.089,29	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-4.000	USD	-886.245,43	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-6.000	USD	-1.329.368,14	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-6.000	USD	-1.329.368,14	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-6.500	USD	-1.440.148,82	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 3.900,00)	-7.500	USD	-1.661.710,18	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 4.000,00)	-2.400	USD	-1.082.466,15	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 4.000,00)	-2.900	USD	-1.307.979,93	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 4.000,00)	-3.750	USD	-1.691.353,36	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2022 (call, strike 4.000,00)	-6.600	USD	-2.976.781,91	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 4.000,00)	-2.400	USD	-590.184,81	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 4.000,00)	-2.900	USD	-713.139,98	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 4.000,00)	-3.750	USD	-922.163,77	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2022 (put, strike 4.000,00)	-6.600	USD	-1.623.008,23	-0,17
				-275.720.175,16	**-28,81**
Summe Indexoptionen				**-275.720.175,16**	**-28,81**
Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
ABB Ltd.	Dez 2021 (put, strike 18,00)	9.000	CHF	37.308,34	0,00
Allianz SE	Dez 2021 (put, strike 135,00)	1.000	EUR	86.742,00	0,01
Allianz SE	Dez 2021 (put, strike 160,00)	1.000	EUR	168.651,00	0,02
Allianz SE	Jun 2022 (put, strike 150,00)	1.200	EUR	444.290,52	0,05
Allianz SE	Jun 2022 (put, strike 160,00)	2.900	EUR	1.444.921,81	0,15
Allianz SE	Jun 2022 (put, strike 170,00)	2.150	EUR	1.461.554,95	0,15
Allianz SE	Jun 2022 (put, strike 180,00)	4.550	EUR	4.196.355,35	0,44
Allianz SE	Dez 2022 (put, strike 160,00)	3.200	EUR	2.372.620,16	0,25
Allianz SE	Dez 2022 (put, strike 170,00)	4.700	EUR	4.557.420,33	0,48
Allianz SE	Dez 2022 (call, strike 180,00)	3.000	EUR	9.752.206,80	1,02
Allianz SE	Dez 2022 (put, strike 180,00)	3.550	EUR	4.470.024,75	0,47
Allianz SE	Dez 2022 (put, strike 180,00)	-3.000	EUR	-3.778.390,80	-0,39
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 2.500,00)	8.500	USD	242.176,13	0,03
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 2.500,00)	-8.500	USD	-242.176,13	-0,03
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 2.800,00)	6.000	USD	351.358,43	0,04
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 2.800,00)	-6.000	USD	-351.358,43	-0,04
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (call, strike 3.100,00)	3.000	USD	1.239.805,03	0,13
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (call, strike 3.100,00)	-3.000	USD	-1.239.805,03	-0,13
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 3.100,00)	3.000	USD	354.347,19	0,04
Amazon.com, Inc.	Jan 2022 (put, strike 3.100,00)	-3.000	USD	-354.347,19	-0,04
Amazon.com, Inc.	Jun 2022 (put, strike 2.800,00)	7.000	USD	754.998,92	0,08
Amazon.com, Inc.	Jun 2022 (call, strike 2.900,00)	3.100	USD	1.863.979,24	0,19
Amazon.com, Inc.	Jun 2022 (put, strike 2.900,00)	3.100	USD	406.669,55	0,04
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 2.900,00)	2.500	USD	1.697.321,28	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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 2.900,00)	7.000	USD	1.389.404,69	0,15
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 2.900,00)	2.500	USD	496.215,96	0,05
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.000,00)	4.500	USD	2.820.154,74	0,29
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.000,00)	4.000	USD	2.506.804,22	0,26
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.000,00)	3.600	USD	2.256.123,80	0,24
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.000,00)	3.000	USD	1.880.103,16	0,20
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.000,00)	3.000	USD	1.880.103,16	0,20
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	8.500	USD	1.958.439,78	0,20
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	8.000	USD	1.843.237,44	0,19
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	4.500	USD	1.036.821,06	0,11
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	4.000	USD	921.618,72	0,10
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	3.600	USD	829.456,85	0,09
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	3.000	USD	691.214,04	0,07
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.000,00)	3.000	USD	691.214,04	0,07
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.100,00)	3.000	USD	1.732.210,67	0,18
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.100,00)	2.900	USD	1.674.470,31	0,18
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.100,00)	3.000	USD	795.831,44	0,08
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.100,00)	2.900	USD	769.303,73	0,08
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (call, strike 3.200,00)	3.600	USD	1.910.831,66	0,20
Amazon.com, Inc.	Jan 2023 (put, strike 3.200,00)	3.600	USD	1.090.271,55	0,11
American Express Co.	Jun 2022 (put, strike 120,00)	150.000	USD	395.740,58	0,04
American Express Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	270.000	USD	1.103.826,44	0,12
American Express Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	150.000	USD	613.236,91	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2022 (put, strike 110,00)	250.000	USD	1.030.010,33	0,11
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2022 (put, strike 110,00)	200.000	USD	824.008,26	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 110,00)	80.000	USD	2.354.191,82	0,25
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 110,00)	80.000	USD	528.626,36	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 115,00)	100.000	USD	2.655.673,24	0,28
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 115,00)	200.000	USD	1.588.402,06	0,17
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 115,00)	100.000	USD	794.201,03	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 120,00)	100.000	USD	2.391.027,15	0,25
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 120,00)	75.000	USD	1.793.270,37	0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 120,00)	100.000	USD	950.065,44	0,10
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 120,00)	75.000	USD	712.549,08	0,07
AXA S.A.	Jun 2022 (put, strike 15,00)	13.000	EUR	608.357,10	0,06
AXA S.A.	Jun 2022 (put, strike 16,00)	46.000	EUR	2.817.242,40	0,29
AXA S.A.	Jun 2022 (put, strike 18,00)	7.000	EUR	741.853,70	0,08
AXA S.A.	Dez 2022 (put, strike 16,00)	37.000	EUR	3.255.119,40	0,34
AXA S.A.	Dez 2022 (put, strike 17,00)	32.000	EUR	3.606.627,20	0,38
AXA S.A.	Dez 2022 (put, strike 18,00)	66.000	EUR	9.416.701,80	0,98
AXA S.A.	Dez 2022 (call, strike 22,00)	31.000	EUR	3.839.086,50	0,40
AXA S.A.	Dez 2022 (put, strike 22,00)	-31.000	EUR	-10.195.723,30	-1,07
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 21,00)	850.000	USD	31.608,19	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 21,00)	850.000	USD	31.608,19	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 21,00)	-850.000	USD	-31.608,19	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 22,00)	750.000	USD	43.611,18	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 22,00)	420.000	USD	24.422,26	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 22,00)	-420.000	USD	-24.422,26	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 23,00)	800.000	USD	70.043,68	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 23,00)	600.000	USD	52.532,76	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 23,00)	600.000	USD	52.532,76	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 23,00)	350.000	USD	30.644,11	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 23,00)	-350.000	USD	-30.644,11	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	800.000	USD	101.984,32	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	800.000	USD	101.984,32	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	650.000	USD	82.862,26	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	500.000	USD	63.740,20	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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	250.000	USD	31.870,10	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 24,00)	250.000	USD	31.870,10	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 25,00)	700.000	USD	114.035,25	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (call, strike 26,00)	250.000	USD	3.238.516,32	0,34
Bank of America Corp.	Jan 2022 (call, strike 26,00)	-250.000	USD	-3.238.516,32	-0,34
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 26,00)	250.000	USD	45.844,72	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 26,00)	-250.000	USD	-45.844,72	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 27,00)	850.000	USD	178.877,73	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 27,00)	-850.000	USD	-178.877,73	-0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (call, strike 28,00)	350.000	USD	3.960.204,99	0,41
Bank of America Corp.	Jan 2022 (call, strike 28,00)	-350.000	USD	-3.960.204,99	-0,41
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 28,00)	850.000	USD	211.131,00	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 28,00)	800.000	USD	198.711,53	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 28,00)	350.000	USD	86.936,29	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 28,00)	-350.000	USD	-86.936,29	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 28,00)	-1.650.000	USD	-409.842,52	-0,04
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 29,00)	600.000	USD	177.809,76	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 29,00)	-600.000	USD	-177.809,76	-0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	850.000	USD	306.386,33	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	800.000	USD	288.363,61	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	700.000	USD	252.318,15	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	600.000	USD	216.272,70	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	-600.000	USD	-216.272,70	-0,02
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 30,00)	-2.350.000	USD	-847.068,09	-0,09
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 32,00)	900.000	USD	482.814,82	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 32,00)	800.000	USD	429.168,73	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 32,00)	800.000	USD	429.168,73	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 32,00)	600.000	USD	321.876,55	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2022 (put, strike 32,00)	-1.400.000	USD	-751.045,28	-0,08
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 32,00)	1.300.000	USD	1.440.243,02	0,15
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 32,00)	550.000	USD	609.333,59	0,06
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 34,00)	350.000	USD	2.533.477,32	0,27
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 34,00)	350.000	USD	521.727,84	0,05
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 35,00)	700.000	USD	1.200.896,96	0,13
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 35,00)	700.000	USD	1.200.896,96	0,13
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 35,00)	500.000	USD	857.783,54	0,09
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 36,00)	320.000	USD	1.923.574,80	0,20
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 36,00)	320.000	USD	630.413,49	0,07
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 37,00)	400.000	USD	2.174.853,19	0,23
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 37,00)	400.000	USD	2.174.853,19	0,23
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 37,00)	700.000	USD	1.573.763,39	0,16
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 37,00)	480.000	USD	1.079.152,04	0,11
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 37,00)	400.000	USD	899.293,36	0,09
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 37,00)	400.000	USD	899.293,36	0,09
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 38,00)	350.000	USD	1.710.394,43	0,18
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 38,00)	350.000	USD	1.710.394,43	0,18
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 38,00)	350.000	USD	892.001,81	0,09
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 38,00)	350.000	USD	892.001,81	0,09
Bank of America Corp.	Jun 2022 (call, strike 40,00)	400.000	USD	1.589.108,69	0,17
Bank of America Corp.	Jun 2022 (put, strike 40,00)	400.000	USD	1.334.038,96	0,14
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 34,00)	850.000	USD	2.015.920,61	0,21
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 35,00)	400.000	USD	2.914.638,33	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 35,00)	1.000.000	USD	2.633.978,41	0,27
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 35,00)	400.000	USD	1.053.591,37	0,11
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 37,00)	400.000	USD	2.494.635,64	0,26
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	600.000	USD	1.971.769,29	0,21
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	400.000	USD	1.314.512,86	0,14

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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Bayer AG	Dez 2022 (call, strike 48,00)	3.300	EUR	2.447.300,79	0,26
Bayer AG	Dez 2022 (put, strike 48,00)	3.300	EUR	1.888.571,85	0,20
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2022 (put, strike 72,00)	3.000	EUR	1.616.295,90	0,17
BNP Paribas S.A.	Dez 2022 (put, strike 48,00)	4.000	EUR	2.498.659,60	0,26
Caterpillar, Inc.	Jun 2022 (put, strike 200,00)	100.000	USD	1.424.730,25	0,15
Caterpillar, Inc.	Jun 2022 (put, strike 200,00)	100.000	USD	1.424.730,25	0,15
Caterpillar, Inc.	Jun 2022 (put, strike 200,00)	90.000	USD	1.282.257,22	0,13
Caterpillar, Inc.	Jun 2022 (call, strike 210,00)	65.000	USD	1.461.412,83	0,15
Caterpillar, Inc.	Jun 2022 (put, strike 210,00)	65.000	USD	1.148.445,64	0,12
Chevron Corp.	Jun 2022 (call, strike 90,00)	150.000	USD	2.238.106,37	0,23
Chevron Corp.	Jun 2022 (put, strike 90,00)	150.000	USD	739.604,98	0,08
Chevron Corp.	Jun 2022 (call, strike 100,00)	110.000	USD	1.064.901,57	0,11
Chevron Corp.	Jun 2022 (put, strike 100,00)	110.000	USD	930.597,68	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 39,00)	250.000	USD	45.404,55	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 39,00)	-250.000	USD	-45.404,55	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 41,00)	200.000	USD	54.975,46	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 41,00)	-200.000	USD	-54.975,46	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 42,00)	500.000	USD	163.212,33	0,02
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 42,00)	260.000	USD	84.870,41	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 42,00)	-260.000	USD	-84.870,41	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 42,00)	-500.000	USD	-163.212,33	-0,02
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (call, strike 50,00)	170.000	USD	3.018.581,01	0,32
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (call, strike 50,00)	-170.000	USD	-3.018.581,01	-0,32
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 50,00)	170.000	USD	110.993,70	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 50,00)	-170.000	USD	-110.993,70	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 52,50)	170.000	USD	140.599,99	0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 52,50)	-170.000	USD	-140.599,99	-0,01
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 54,00)	350.000	USD	339.386,67	0,04
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 54,00)	320.000	USD	310.296,38	0,03
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 54,00)	-320.000	USD	-310.296,38	-0,03
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 54,00)	-350.000	USD	-339.386,67	-0,04
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 56,00)	300.000	USD	358.228,94	0,04
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 56,00)	-300.000	USD	-358.228,94	-0,04
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 62,00)	350.000	USD	787.286,62	0,08
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 62,00)	-350.000	USD	-787.286,62	-0,08
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 62,50)	250.000	USD	591.122,14	0,06
Citigroup, Inc.	Jan 2022 (put, strike 62,50)	-250.000	USD	-591.122,14	-0,06
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 57,50)	310.000	USD	806.195,01	0,08
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 60,00)	300.000	USD	950.578,55	0,10
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 64,00)	400.000	USD	1.729.890,21	0,18
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (call, strike 65,00)	180.000	USD	1.527.269,42	0,16
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 65,00)	180.000	USD	841.417,20	0,09
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (call, strike 67,50)	170.000	USD	1.245.436,14	0,13
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 67,50)	350.000	USD	1.975.721,81	0,21
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 67,50)	170.000	USD	959.636,31	0,10
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (call, strike 68,00)	170.000	USD	1.207.582,01	0,13
Citigroup, Inc.	Jun 2022 (put, strike 68,00)	170.000	USD	994.117,68	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (put, strike 70,00)	400.000	USD	3.574.024,45	0,37
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (put, strike 70,00)	300.000	USD	2.680.518,34	0,28
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 75,00)	120.000	USD	743.529,98	0,08
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (put, strike 75,00)	120.000	USD	1.375.712,22	0,14
Credit Suisse Group AG	Dez 2022 (put, strike 8,00)	20.000	CHF	1.305.752,05	0,14
Credit Suisse Group AG	Dez 2022 (put, strike 8,50)	25.000	CHF	2.055.361,59	0,21
Facebook, Inc.	Jun 2022 (put, strike 280,00)	85.000	USD	1.147.788,35	0,12
Facebook, Inc.	Jun 2022 (put, strike 280,00)	70.000	USD	945.237,47	0,10
Facebook, Inc.	Jan 2023 (call, strike 310,00)	37.000	USD	2.428.352,96	0,25
Facebook, Inc.	Jan 2023 (put, strike 310,00)	37.000	USD	1.140.864,09	0,12

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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 170,00)	100.000	USD	8.315,54	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 170,00)	-100.000	USD	-8.315,54	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 180,00)	130.000	USD	20.116,84	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 180,00)	-130.000	USD	-20.116,84	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 190,00)	50.000	USD	13.539,46	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 190,00)	-50.000	USD	-13.539,46	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 200,00)	120.000	USD	53.902,45	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 200,00)	90.000	USD	40.426,84	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 200,00)	60.000	USD	26.951,23	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 200,00)	-120.000	USD	-53.902,45	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 200,00)	-150.000	USD	-67.378,07	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 220,00)	80.000	USD	86.429,41	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 240,00)	70.000	USD	112.957,00	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 240,00)	-70.000	USD	-112.957,00	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 250,00)	130.000	USD	253.691,84	0,03
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 250,00)	100.000	USD	195.147,57	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 250,00)	-230.000	USD	-448.839,40	-0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 260,00)	80.000	USD	189.612,82	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (call, strike 290,00)	60.000	USD	4.733.628,33	0,49
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 290,00)	60.000	USD	261.337,72	0,03
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 300,00)	100.000	USD	535.944,43	0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2022 (put, strike 300,00)	-100.000	USD	-535.944,43	-0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2022 (put, strike 290,00)	60.000	USD	588.521,17	0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2022 (put, strike 300,00)	100.000	USD	1.145.534,70	0,12
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2022 (call, strike 340,00)	40.000	USD	2.040.793,29	0,21
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2022 (put, strike 340,00)	40.000	USD	828.677,26	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 320,00)	80.000	USD	1.990.392,92	0,21
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 340,00)	85.000	USD	2.655.638,04	0,28
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 340,00)	70.000	USD	2.186.996,03	0,23
Hang Seng China Enterprises Index	Dez 2021 (call, strike 9.500,00)	-7.000	HKD	-942.369,14	-0,10
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 250,00)	120.000	USD	367.601,11	0,04
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 250,00)	90.000	USD	275.700,83	0,03
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 250,00)	40.000	USD	122.533,70	0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 250,00)	-80.000	USD	-245.067,41	-0,03
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 250,00)	-80.000	USD	-245.067,41	-0,03
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 260,00)	40.000	USD	2.103.946,84	0,22
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 260,00)	35.000	USD	1.840.953,49	0,19
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 260,00)	30.000	USD	1.577.960,13	0,17
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 260,00)	-30.000	USD	-1.577.960,13	-0,16
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 260,00)	-35.000	USD	-1.840.953,49	-0,19
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	80.000	USD	318.369,58	0,03
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	70.000	USD	278.573,38	0,03
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	40.000	USD	159.184,79	0,02
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	35.000	USD	139.286,69	0,02
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	30.000	USD	119.388,59	0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	-30.000	USD	-119.388,59	-0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 260,00)	-35.000	USD	-139.286,69	-0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 270,00)	40.000	USD	1.807.918,58	0,19
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (call, strike 270,00)	-40.000	USD	-1.807.918,58	-0,19
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 270,00)	40.000	USD	205.285,54	0,02
Home Depot, Inc./The	Jan 2022 (put, strike 270,00)	-40.000	USD	-205.285,54	-0,02
Home Depot, Inc./The	Jun 2022 (call, strike 310,00)	30.000	USD	787.215,41	0,08
Home Depot, Inc./The	Jun 2022 (put, strike 310,00)	30.000	USD	660.609,99	0,07
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 250,00)	80.000	USD	905.630,83	0,09
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (call, strike 280,00)	60.000	USD	2.818.952,90	0,29
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (call, strike 280,00)	35.000	USD	1.644.389,19	0,17
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	60.000	USD	1.120.403,95	0,12

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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	35.000	USD	653.568,97	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	350.000	USD	148.081,67	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	250.000	USD	105.772,62	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	170.000	USD	71.925,38	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	150.000	USD	63.463,57	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	60.000	USD	25.385,43	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	-200.000	USD	-84.618,10	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	-260.000	USD	-110.003,52	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	-370.000	USD	-156.543,48	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 95,00)	250.000	USD	146.902,77	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 95,00)	60.000	USD	35.256,67	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 95,00)	-310.000	USD	-182.159,44	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (call, strike 100,00)	100.000	USD	4.685.917,03	0,49
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (call, strike 100,00)	-100.000	USD	-4.685.917,03	-0,49
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	260.000	USD	180.876,60	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	230.000	USD	160.006,22	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	100.000	USD	69.567,92	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	-100.000	USD	-69.567,92	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	-230.000	USD	-160.006,22	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	-260.000	USD	-180.876,60	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (call, strike 110,00)	110.000	USD	4.248.056,32	0,44
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (call, strike 110,00)	-110.000	USD	-4.248.056,32	-0,44
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	200.000	USD	207.152,04	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	200.000	USD	207.152,04	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	170.000	USD	176.079,23	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	160.000	USD	165.721,63	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	150.000	USD	155.364,03	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	150.000	USD	155.364,03	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	110.000	USD	113.933,62	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	-110.000	USD	-113.933,62	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	-150.000	USD	-155.364,03	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 110,00)	-170.000	USD	-176.079,23	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 115,00)	180.000	USD	238.824,29	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 115,00)	40.000	USD	53.072,06	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 120,00)	200.000	USD	337.164,01	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 120,00)	200.000	USD	337.164,01	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 120,00)	140.000	USD	236.014,81	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 120,00)	130.000	USD	219.156,61	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 125,00)	170.000	USD	363.030,78	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 130,00)	150.000	USD	405.876,17	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (call, strike 140,00)	200.000	USD	3.301.636,23	0,35
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2022 (put, strike 140,00)	150.000	USD	692.288,14	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 120,00)	350.000	USD	1.144.198,96	0,12
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 120,00)	150.000	USD	490.370,98	0,05
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	200.000	USD	999.815,50	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	200.000	USD	999.815,50	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	180.000	USD	899.833,95	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	150.000	USD	749.861,62	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 130,00)	110.000	USD	549.898,52	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 140,00)	110.000	USD	2.065.090,60	0,22
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 140,00)	100.000	USD	1.877.355,09	0,20
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 140,00)	80.000	USD	1.501.884,07	0,16
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 140,00)	110.000	USD	838.713,22	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 140,00)	100.000	USD	762.466,57	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 140,00)	80.000	USD	609.973,25	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 150,00)	100.000	USD	1.336.034,83	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 150,00)	100.000	USD	1.336.034,83	0,14

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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (call, strike 150,00)	90.000	USD	1.202.431,34	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 150,00)	100.000	USD	1.073.120,25	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 150,00)	100.000	USD	1.073.120,25	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2022 (put, strike 150,00)	90.000	USD	965.808,22	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	290.000	USD	2.547.068,61	0,27
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	170.000	USD	1.493.109,18	0,16
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 135,00)	180.000	USD	1.815.444,27	0,19
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	120.000	USD	1.384.339,89	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 145,00)	70.000	USD	1.326.746,97	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 145,00)	70.000	USD	928.290,90	0,10
MetLife, Inc.	Jan 2022 (put, strike 48,00)	400.000	USD	455.008,69	0,05
MetLife, Inc.	Jan 2022 (put, strike 48,00)	-400.000	USD	-455.008,69	-0,05
MetLife, Inc.	Jan 2022 (call, strike 56,00)	160.000	USD	882.193,64	0,09
MetLife, Inc.	Jan 2023 (put, strike 52,50)	400.000	USD	2.109.908,76	0,22
Netflix, Inc.	Jan 2023 (call, strike 480,00)	20.000	USD	1.939.101,81	0,20
Netflix, Inc.	Jan 2023 (call, strike 480,00)	19.000	USD	1.842.146,72	0,19
Netflix, Inc.	Jan 2023 (put, strike 480,00)	20.000	USD	1.037.250,86	0,11
Netflix, Inc.	Jan 2023 (put, strike 480,00)	19.000	USD	985.388,32	0,10
Netflix, Inc.	Jan 2023 (call, strike 490,00)	18.000	USD	1.665.227,58	0,17
Netflix, Inc.	Jan 2023 (put, strike 490,00)	18.000	USD	1.005.119,62	0,11
Netflix, Inc.	Jan 2023 (call, strike 510,00)	17.000	USD	1.429.800,71	0,15
Netflix, Inc.	Jan 2023 (put, strike 510,00)	17.000	USD	1.092.758,56	0,11
Oracle Corp.	Jan 2022 (call, strike 58,00)	150.000	USD	2.569.152,92	0,27
Oracle Corp.	Jan 2022 (call, strike 58,00)	-150.000	USD	-2.569.152,92	-0,27
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 58,00)	300.000	USD	204.048,32	0,02
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 58,00)	150.000	USD	102.024,16	0,01
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 58,00)	-150.000	USD	-102.024,16	-0,01
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 58,00)	-300.000	USD	-204.048,32	-0,02
Oracle Corp.	Jan 2022 (call, strike 60,00)	180.000	USD	2.803.253,28	0,29
Oracle Corp.	Jan 2022 (call, strike 60,00)	-180.000	USD	-2.803.253,28	-0,29
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 60,00)	180.000	USD	148.604,96	0,02
Oracle Corp.	Jan 2022 (put, strike 60,00)	-180.000	USD	-148.604,96	-0,02
Oracle Corp.	Jan 2023 (call, strike 72,50)	150.000	USD	1.470.922,08	0,15
Oracle Corp.	Jan 2023 (put, strike 72,50)	150.000	USD	902.657,35	0,09
Schneider Electric SE	Jun 2022 (put, strike 110,00)	1.500	EUR	780.932,70	0,08
Schneider Electric SE	Jun 2022 (call, strike 120,00)	750	EUR	1.417.546,13	0,15
Schneider Electric SE	Jun 2022 (put, strike 120,00)	750	EUR	617.343,38	0,06
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 82,50)	120.000	USD	3.040.635,26	0,32
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 82,50)	-120.000	USD	-3.040.635,26	-0,32
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 82,50)	120.000	USD	101.029,19	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 82,50)	-120.000	USD	-101.029,19	-0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	120.000	USD	2.803.209,92	0,29
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	100.000	USD	2.336.008,26	0,24
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	90.000	USD	2.102.407,44	0,22
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	-90.000	USD	-2.102.407,44	-0,22
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	-100.000	USD	-2.336.008,26	-0,24
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	-100.000	USD	-2.336.008,26	-0,24
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 85,00)	-120.000	USD	-2.803.209,92	-0,29
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	120.000	USD	119.449,23	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	100.000	USD	99.541,02	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	100.000	USD	99.541,02	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	90.000	USD	89.586,92	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	-90.000	USD	-89.586,92	-0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	-100.000	USD	-99.541,02	-0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 85,00)	-120.000	USD	-119.449,23	-0,01
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 87,50)	130.000	USD	2.783.633,25	0,29
Starbucks Corp.	Jan 2022 (call, strike 87,50)	-130.000	USD	-2.783.633,25	-0,29

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 2021 (FORTSETZUNG)

Aktienoptionen					
Underlying		**Kontrakte**	**Währung**	**Marktwert (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 87,50)	130.000	USD	153.187,77	0,02
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 87,50)	-130.000	USD	-153.187,77	-0,02
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	200.000	USD	278.564,30	0,03
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	185.000	USD	257.671,98	0,03
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	-185.000	USD	-257.671,98	-0,03
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 90,00)	-200.000	USD	-278.564,30	-0,03
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	220.000	USD	632.572,81	0,07
Starbucks Corp.	Jan 2022 (put, strike 100,00)	-220.000	USD	-632.572,81	-0,07
Starbucks Corp.	Jun 2022 (put, strike 95,00)	300.000	USD	1.067.997,72	0,11
Starbucks Corp.	Jun 2022 (put, strike 95,00)	200.000	USD	711.998,48	0,07
Starbucks Corp.	Jun 2022 (call, strike 100,00)	160.000	USD	2.379.123,64	0,25
Starbucks Corp.	Jun 2022 (put, strike 100,00)	160.000	USD	872.566,12	0,09
Starbucks Corp.	Jun 2022 (call, strike 105,00)	90.000	USD	1.062.104,88	0,11
Starbucks Corp.	Jun 2022 (put, strike 105,00)	90.000	USD	594.578,14	0,06
Starbucks Corp.	Jun 2022 (call, strike 110,00)	100.000	USD	969.399,87	0,10
Starbucks Corp.	Jun 2022 (put, strike 110,00)	100.000	USD	872.115,69	0,09
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 100,00)	100.000	USD	1.661.531,92	0,17
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 100,00)	100.000	USD	1.661.531,92	0,17
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	185.000	USD	1.403.312,75	0,15
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	100.000	USD	758.547,43	0,08
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	100.000	USD	758.547,43	0,08
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 105,00)	120.000	USD	1.653.900,53	0,17
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 105,00)	100.000	USD	1.378.250,44	0,14
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 105,00)	120.000	USD	1.077.318,69	0,11
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 105,00)	100.000	USD	897.765,58	0,09
Swiss Life Holding AG	Dez 2022 (put, strike 380,00)	500	CHF	1.120.860,64	0,12
UBS Group AG	Dez 2022 (put, strike 11,00)	20.000	CHF	1.203.623,46	0,13
UBS Group AG	Dez 2022 (put, strike 12,00)	143.000	CHF	12.310.242,36	1,29
UBS Group AG	Dez 2022 (call, strike 13,00)	19.000	CHF	3.728.933,10	0,39
UBS Group AG	Dez 2022 (put, strike 13,00)	32.000	CHF	3.860.913,18	0,40
UBS Group AG	Dez 2022 (call, strike 14,00)	20.000	CHF	2.838.521,99	0,30
UBS Group AG	Dez 2022 (call, strike 14,00)	10.000	CHF	1.448.131,08	0,15
UBS Group AG	Dez 2022 (put, strike 14,00)	10.000	CHF	1.630.433,97	0,17
UBS Group AG	Dez 2022 (put, strike 14,00)	-20.000	CHF	-3.261.844,05	-0,34
Zurich Insurance Group AG	Jun 2022 (put, strike 320,00)	7.000	CHF	954.273,54	0,10
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 290,00)	8.000	CHF	946.373,62	0,10
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 310,00)	12.000	CHF	1.979.590,23	0,21
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 320,00)	37.100	CHF	7.177.813,93	0,75
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 330,00)	13.600	CHF	3.074.498,99	0,32
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 340,00)	5.200	CHF	1.362.461,00	0,14
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (call, strike 350,00)	17.000	CHF	5.379.721,88	0,56
Zurich Insurance Group AG	Dez 2022 (put, strike 350,00)	-17.000	CHF	-5.110.063,28	-0,53
				326.484.956,08	**34,11**
Summe Aktienoptionen				**326.484.956,08**	**34,11**
Summe Optionen				**50.764.780,92**	**5,30**

Volatility Swaps	**Fälligkeit**	**Nennbetrag (000)**	**Währung**	**Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
3M Co. 28,60 %	21.01.2022	1.500	USD	-93.232,99	-0,01
3M Co. 28,66 %	21.01.2022	926	USD	-63.443,37	-0,01
3M Co. 28,79 %	21.01.2022	2.000	USD	-128.071,51	-0,01
3M Co. 26,46 %	17.06.2022	2.500	USD	-75.343,62	-0,01
3M Co. 29,64 %	21.01.2022	1.500	USD	-106.855,55	-0,01
3M Co. 28,55 %	21.01.2022	1.800	USD	-110.088,54	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
3M Co. 30,25 %	21.01.2022	1.700	USD	-117.160,80	-0,01
ABB Ltd. 22,34 %	17.12.2021	2.709	CHF	-38.059,34	0,00
ABB Ltd. 22,79 %	17.12.2021	3.780	CHF	-77.173,35	-0,01
ABB Ltd. 25,58 %	17.12.2021	2.702	CHF	-127.598,88	-0,01
ABB Ltd. 23,95 %	17.06.2022	1.752	CHF	-47.005,06	-0,01
ABB Ltd. 25,40 %	17.12.2021	2.151	CHF	-91.707,36	-0,01
ABB Ltd. 26,80 %	17.12.2021	2.703	CHF	-156.550,66	-0,02
ABB Ltd. 24,58 %	17.12.2021	2.476	CHF	-88.056,33	-0,01
AbbVie, Inc. 30,91 %	21.01.2022	1.536	USD	-91.064,65	-0,01
AbbVie, Inc. 28,22 %	21.01.2022	834	USD	-37.831,48	0,00
AbbVie, Inc. 33,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-105.944,85	-0,01
AbbVie, Inc. 30,30 %	21.01.2022	1.700	USD	-98.353,15	-0,01
AbbVie, Inc. 31,85 %	21.01.2022	1.700	USD	-103.829,16	-0,01
Accenture PLC 32,73 %	21.01.2022	2.000	USD	-165.325,91	-0,02
Activision Blizzard, Inc. 39,07 %	21.01.2022	4.000	USD	-288.017,54	-0,03
Adecco Group AG 30,30 %	17.12.2021	2.151	CHF	-138.483,22	-0,01
Adobe, Inc. 31,43 %	17.06.2022	1.250	USD	-21.850,50	0,00
Adobe, Inc. 37,90 %	21.01.2022	2.500	USD	-200.881,19	-0,02
Adobe, Inc. 31,36 %	17.06.2022	2.500	USD	-34.109,12	0,00
Adobe, Inc. 32,17 %	17.06.2022	2.500	USD	-58.352,31	-0,01
Adobe, Inc. 39,06 %	21.01.2022	1.500	USD	-138.198,84	-0,01
Adobe, Inc. 38,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-182.544,90	-0,02
Adobe, Inc. 32,86 %	20.01.2023	2.500	USD	-3.583,78	0,00
Adobe, Inc. 32,55 %	20.01.2023	2.500	USD	2.867,02	0,00
Adobe, Inc. 36,15 %	21.01.2022	1.800	USD	-124.993,68	-0,01
Adobe, Inc. 36,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-113.913,48	-0,01
Adobe, Inc. 31,86 %	21.01.2022	834	USD	-32.327,57	0,00
Adobe, Inc. 31,40 %	17.06.2022	2.500	USD	-34.931,28	0,00
Adobe, Inc. 37,40 %	21.01.2022	1.000	USD	-77.046,97	-0,01
Adobe, Inc. 33,21 %	17.06.2022	2.500	USD	-71.022,01	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 39,54 %	20.01.2023	2.500	USD	25.887,51	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 40,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-24.538,33	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 41,76 %	20.01.2023	2.500	USD	-20.343,20	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 42,68 %	21.01.2022	1.666	USD	-62.339,32	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 40,10 %	20.01.2023	2.200	USD	11.353,41	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 40,70 %	20.01.2023	1.429	USD	289,12	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 42,35 %	17.06.2022	2.500	USD	-60.671,22	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 42,47 %	17.06.2022	2.000	USD	-48.149,09	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 45,97 %	21.01.2022	1.852	USD	-123.312,80	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 41,82 %	17.06.2022	2.000	USD	-42.381,31	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 41,98 %	17.06.2022	2.500	USD	-47.137,20	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 40,15 %	20.01.2023	2.500	USD	13.470,78	0,00
Aflac, Inc. 26,29 %	17.06.2022	2.000	USD	-34.050,09	0,00
Aflac, Inc. 26,69 %	17.06.2022	2.000	USD	-44.472,55	0,00
Air Liquide S.A. 20,21 %	16.12.2022	1.500	EUR	-8.580,00	0,00
Air Products and Chemicals, Inc. 26,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-77.826,97	-0,01
Air Products and Chemicals, Inc. 33,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.227,68	-0,01
Akzo Nobel NV 24,14 %	17.06.2022	1.600	EUR	-60.144,00	-0,01
Allianz SE 22,64 %	16.12.2022	1.500	EUR	-17.565,00	0,00
Allianz SE 22,44 %	17.06.2022	2.000	EUR	-32.300,00	0,00
Allianz SE 25,50 %	17.12.2021	3.500	EUR	-197.890,00	-0,02
Allianz SE 26,35 %	17.12.2021	1.900	EUR	-125.153,00	-0,01
Allianz SE 25,85 %	17.12.2021	7.000	EUR	-188.720,00	-0,02
Allianz SE 26,77 %	17.12.2021	2.500	EUR	-200.375,00	-0,02
Allianz SE 29,13 %	17.12.2021	2.500	EUR	-261.900,00	-0,03
Allianz SE 28,44 %	17.12.2021	7.000	EUR	-370.160,00	-0,04
Allianz SE 26,29 %	17.06.2022	2.500	EUR	-143.475,00	-0,02
Allianz SE 24,21 %	17.06.2022	1.600	EUR	-53.616,00	-0,01
Allianz SE 26,83 %	17.12.2021	500	EUR	-18.540,00	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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Allianz SE 22,89 %	17.06.2022	2.200	EUR	-43.626,00	0,00
Allstate Corp./The 24,32 %	17.06.2022	1.250	USD	-3.204,32	0,00
Allstate Corp./The 24,25 %	17.06.2022	2.000	USD	-1.079,35	0,00
Allstate Corp./The 34,45 %	21.01.2022	1.400	USD	-134.380,64	-0,01
Allstate Corp./The 25,37 %	17.06.2022	2.500	USD	-23.842,65	0,00
Alphabet, Inc. 32,47 %	21.01.2022	1.500	USD	-81.887,17	-0,01
Alphabet, Inc. 31,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-80.263,10	-0,01
Alphabet, Inc. 33,69 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.522,39	-0,01
Alphabet, Inc. 32,98 %	21.01.2022	4.000	USD	-167.062,99	-0,02
Alphabet, Inc. 31,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-96.508,98	-0,01
Alphabet, Inc. 30,85 %	17.06.2022	2.500	USD	-87.064,68	-0,01
Alphabet, Inc. 29,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-57.213,93	-0,01
Alphabet, Inc. 31,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-110.865,17	-0,01
Alphabet, Inc. 33,02 %	21.01.2022	1.500	USD	-71.831,52	-0,01
Alphabet, Inc. 32,10 %	21.01.2022	2.500	USD	-125.980,27	-0,01
Amazon.com, Inc. 32,00 %	17.06.2022	2.500	USD	-64.782,02	-0,01
Amazon.com, Inc. 31,67 %	21.01.2022	834	USD	-35.933,58	0,00
Amazon.com, Inc. 37,07 %	21.01.2022	2.000	USD	-174.820,81	-0,02
Amazon.com, Inc. 31,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-53.630,15	-0,01
Amazon.com, Inc. 31,80 %	17.06.2022	1.200	USD	-28.262,08	0,00
Amazon.com, Inc. 31,51 %	17.06.2022	1.250	USD	-30.578,05	0,00
Amazon.com, Inc. 32,66 %	17.06.2022	2.000	USD	-70.393,79	-0,01
Amazon.com, Inc. 31,49 %	17.06.2022	2.500	USD	-59.005,82	-0,01
Amazon.com, Inc. 30,40 %	20.01.2023	2.500	USD	-14.967,54	0,00
Amazon.com, Inc. 32,85 %	17.06.2022	2.000	USD	-68.943,42	-0,01
Amazon.com, Inc. 37,36 %	21.01.2022	2.500	USD	-232.144,36	-0,02
Amazon.com, Inc. 31,19 %	17.06.2022	2.500	USD	-48.865,84	-0,01
Amazon.com, Inc. 37,60 %	21.01.2022	2.000	USD	-183.725,44	-0,02
Amazon.com, Inc. 32,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-71.485,79	-0,01
Amazon.com, Inc. 34,50 %	21.01.2022	2.500	USD	-174.023,95	-0,02
Amazon.com, Inc. 31,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-49.435,03	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 22,29 %	17.06.2022	2.500	USD	-76.756,05	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 25,20 %	21.01.2022	1.800	USD	-106.111,82	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 25,40 %	21.01.2022	1.800	USD	-109.208,20	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 25,70 %	21.01.2022	1.000	USD	-64.373,05	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 22,20 %	21.01.2022	1.864	USD	-77.772,77	-0,01
American Express Co. 32,90 %	17.06.2022	1.200	USD	-61.998,48	-0,01
American Express Co. 30,28 %	17.06.2022	2.500	USD	-75.238,22	-0,01
American Express Co. 31,04 %	21.01.2022	834	USD	-33.107,82	0,00
American Express Co. 35,82 %	21.01.2022	1.537	USD	-106.566,42	-0,01
American Express Co. 36,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-133.948,90	-0,01
American Express Co. 32,44 %	17.06.2022	2.500	USD	-120.941,90	-0,01
American International Group, Inc. 36,70 %	21.01.2022	1.540	USD	-94.745,26	-0,01
Amgen, Inc. 29,10 %	21.01.2022	668	USD	-37.204,99	0,00
Analog Devices, Inc. 37,15 %	21.01.2022	1.700	USD	-121.203,30	-0,01
Analog Devices, Inc. 35,15 %	21.01.2022	1.500	USD	-80.672,91	-0,01
Anthem, Inc. 35,20 %	21.01.2022	745	USD	-60.587,62	-0,01
Aon Corp. 32,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.851,25	-0,01
Apollo Global Management LLC 34,55 %	17.06.2022	2.500	USD	-55.780,42	-0,01
Apollo Global Management LLC 35,82 %	17.06.2022	2.500	USD	-81.098,74	-0,01
Apollo Global Management LLC 35,39 %	17.06.2022	2.500	USD	-73.867,95	-0,01
Apollo Global Management LLC 34,04 %	17.06.2022	2.000	USD	-37.456,78	0,00
Apple, Inc. 31,26 %	20.01.2023	2.500	USD	-25.149,68	0,00
Apple, Inc. 36,45 %	21.01.2022	1.500	USD	-53.668,10	-0,01
Apple, Inc. 33,00 %	17.06.2022	1.200	USD	-43.177,33	0,00
Apple, Inc. 34,03 %	17.06.2022	2.000	USD	-93.886,50	-0,01
Apple, Inc. 33,64 %	17.06.2022	2.500	USD	-102.348,43	-0,01
Apple, Inc. 32,18 %	17.06.2022	2.500	USD	-74.036,60	-0,01
Apple, Inc. 31,26 %	17.06.2022	2.500	USD	-54.852,85	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Apple, Inc. 32,03 %	20.01.2023	2.500	USD	-41.171,26	0,00
Apple, Inc. 35,03 %	21.01.2022	834	USD	-65.133,13	-0,01
Apple, Inc. 37,50 %	21.01.2022	2.500	USD	-200.101,19	-0,02
Apple, Inc. 36,79 %	21.01.2022	4.000	USD	-157.180,20	-0,02
Apple, Inc. 33,00 %	17.06.2022	2.500	USD	-88.983,05	-0,01
Apple, Inc. 34,22 %	17.06.2022	2.500	USD	-117.126,23	-0,01
Apple, Inc. 40,12 %	21.01.2022	2.500	USD	-274.327,51	-0,03
Applied Materials, Inc. 42,30 %	21.01.2022	3.000	USD	26.992,16	0,00
Applied Materials, Inc. 42,26 %	21.01.2022	3.000	USD	17.657,48	0,00
Applied Materials, Inc. 42,09 %	21.01.2022	1.500	USD	14.824,18	0,00
Applied Materials, Inc. 39,70 %	21.01.2022	1.700	USD	47.492,20	0,00
Applied Materials, Inc. 41,43 %	21.01.2022	1.500	USD	23.830,00	0,00
ASML Holding NV 33,66 %	17.12.2021	1.900	EUR	-36.746,00	0,00
Assicurazioni Generali SpA 24,41 %	16.12.2021	2.300	EUR	-151.708,00	-0,02
Assicurazioni Generali SpA 22,43 %	17.06.2022	1.600	EUR	-31.184,00	0,00
Assicurazioni Generali SpA 22,35 %	17.06.2022	2.200	EUR	-43.934,00	0,00
Assicurazioni Generali SpA 23,64 %	17.12.2021	1.900	EUR	-102.638,00	-0,01
Assicurazioni Generali SpA 26,93 %	16.12.2021	2.000	EUR	-136.680,00	-0,01
Assicurazioni Generali SpA 25,50 %	17.12.2021	2.000	EUR	-152.860,00	-0,02
Assicurazioni Generali SpA 20,83 %	16.06.2022	2.000	EUR	-11.900,00	0,00
Assicurazioni Generali SpA 23,76 %	16.12.2021	2.500	EUR	-152.075,00	-0,02
AT&T, Inc. 28,54 %	21.01.2022	2.000	USD	-129.977,23	-0,01
AT&T, Inc. 26,24 %	21.01.2022	1.700	USD	-75.875,70	-0,01
AT&T, Inc. 27,44 %	21.01.2022	3.000	USD	-154.566,15	-0,02
AXA S.A. 27,40 %	17.12.2021	1.900	EUR	-123.120,00	-0,01
AXA S.A. 28,63 %	17.06.2022	2.500	EUR	-165.700,00	-0,02
AXA S.A. 29,16 %	17.12.2021	2.300	EUR	-194.465,00	-0,02
AXA S.A. 23,25 %	17.06.2022	2.000	EUR	-13.120,00	0,00
AXA S.A. 28,80 %	17.12.2021	2.500	EUR	-206.800,00	-0,02
AXA S.A. 30,70 %	17.12.2021	2.000	EUR	-199.500,00	-0,02
AXA S.A. 27,01 %	17.12.2021	3.500	EUR	-215.425,00	-0,02
AXA S.A. 23,84 %	17.06.2022	3.300	EUR	-38.445,00	0,00
AXA S.A. 25,09 %	17.06.2022	1.600	EUR	-36.880,00	0,00
AXA S.A. 26,82 %	17.06.2022	2.500	EUR	-114.175,00	-0,01
AXA S.A. 27,55 %	17.12.2021	2.000	EUR	-64.040,00	-0,01
AXA S.A. 27,35 %	17.12.2021	7.000	EUR	-202.020,00	-0,02
AXA S.A. 23,61 %	16.12.2022	1.500	EUR	-12.825,00	0,00
AXA S.A. 29,02 %	17.12.2021	2.500	EUR	-205.450,00	-0,02
AXA S.A. 31,00 %	17.12.2021	2.500	EUR	-162.900,00	-0,02
AXA S.A. 23,73 %	16.12.2022	2.500	EUR	-23.975,00	0,00
Ball Corp. 29,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-26.203,73	0,00
Ball Corp. 27,88 %	17.06.2022	2.000	USD	-33,73	0,00
Bank of America Corp. 34,80 %	17.06.2022	1.200	USD	-69.284,08	-0,01
Bank of America Corp. 36,10 %	21.01.2022	1.700	USD	-120.271,52	-0,01
Bank of America Corp. 35,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-99.038,70	-0,01
Bank of America Corp. 37,90 %	21.01.2022	3.000	USD	-183.480,90	-0,02
Bank of America Corp. 33,07 %	17.06.2022	2.500	USD	-111.286,79	-0,01
Bank of America Corp. 32,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-70.693,14	-0,01
Bank of America Corp. 37,10 %	21.01.2022	2.500	USD	-194.409,31	-0,02
Bank of America Corp. 37,00 %	21.01.2022	2.500	USD	-190.446,07	-0,02
Bank of America Corp. 38,52 %	21.01.2022	2.000	USD	-193.945,53	-0,02
Bank of America Corp. 36,20 %	21.01.2022	1.000	USD	-74.196,81	-0,01
Bank of America Corp. 38,76 %	21.01.2022	1.500	USD	-146.812,55	-0,02
Bank of America Corp. 32,24 %	20.01.2023	2.500	USD	-67.817,69	-0,01
Bank of America Corp. 36,77 %	21.01.2022	745	USD	-59.275,00	-0,01
Bank of America Corp. 41,22 %	21.01.2022	3.000	USD	-264.558,56	-0,03
Bank of America Corp. 36,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-160.317,06	-0,02
Bank of America Corp. 37,83 %	21.01.2022	1.400	USD	-126.718,95	-0,01
Bank of America Corp. 32,60 %	17.06.2022	2.000	USD	-85.858,84	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Bank of America Corp. 37,50 %	21.01.2022	2.000	USD	-176.760,27	-0,02
Bank of New York Mellon Corp./The 30,32 %	20.01.2023	2.500	USD	-102.812,21	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 35,50 %	21.01.2022	1.000	USD	-89.442,62	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 36,39 %	21.01.2022	1.500	USD	-149.089,30	-0,02
Bank of New York Mellon Corp./The 29,80 %	17.06.2022	1.200	USD	-38.279,78	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 32,96 %	21.01.2022	1.500	USD	-81.988,36	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 27,40 %	20.01.2023	2.500	USD	-35.985,33	0,00
BASF SE 23,80 %	16.12.2022	1.500	EUR	-4.365,00	0,00
BASF SE 30,20 %	17.12.2021	2.500	EUR	-98.625,00	-0,01
BASF SE 24,53 %	16.12.2022	2.500	EUR	-25.825,00	0,00
BASF SE 25,06 %	17.06.2022	3.300	EUR	-56.199,00	-0,01
BASF SE 23,98 %	17.06.2022	2.000	EUR	-15.160,00	0,00
Bayerische Motoren Werke AG 30,82 %	17.06.2022	2.500	EUR	-73.750,00	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 29,10 %	17.12.2021	1.900	EUR	-42.085,00	0,00
Bayerische Motoren Werke AG 29,19 %	17.06.2022	1.100	EUR	-24.959,00	0,00
Beiersdorf AG 21,16 %	16.12.2022	1.500	EUR	-17.400,00	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 25,18 %	21.01.2022	1.852	USD	-123.671,94	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 23,75 %	20.01.2023	2.500	USD	-77.030,10	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 22,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-62.560,08	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 27,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.713,38	-0,01
Best Buy Co., Inc. 35,85 %	20.01.2023	2.500	USD	-65.540,94	-0,01
Best Buy Co., Inc. 37,00 %	20.01.2023	2.500	USD	-91.807,91	-0,01
BHP Group Ltd. 37,05 %	21.01.2022	2.000	USD	-115.928,83	-0,01
BHP Group Ltd. 37,74 %	21.01.2022	1.700	USD	-107.513,28	-0,01
Biogen, Inc. 36,90 %	20.01.2023	1.429	USD	-13.058,45	0,00
BlackRock, Inc. 28,29 %	17.06.2022	2.000	USD	-64.491,10	-0,01
BlackRock, Inc. 32,29 %	21.01.2022	3.000	USD	-193.878,07	-0,02
BlackRock, Inc. 25,55 %	17.06.2022	1.800	USD	-12.992,67	0,00
BlackRock, Inc. 32,37 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.758,92	-0,01
BlackRock, Inc. 33,78 %	21.01.2022	1.400	USD	-117.746,86	-0,01
BlackRock, Inc. 33,79 %	21.01.2022	1.500	USD	-124.082,97	-0,01
BlackRock, Inc. 31,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-84.138,63	-0,01
BlackRock, Inc. 26,20 %	20.01.2023	1.429	USD	-14.925,67	0,00
BlackRock, Inc. 35,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-155.831,01	-0,02
BlackRock, Inc. 29,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-133.421,87	-0,01
BlackRock, Inc. 31,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.196,31	-0,01
BlackRock, Inc. 24,88 %	17.06.2022	2.500	USD	-4.574,58	0,00
BlackRock, Inc. 32,70 %	21.01.2022	4.000	USD	-276.380,81	-0,03
BlackRock, Inc. 27,48 %	17.06.2022	1.250	USD	-30.377,78	0,00
BlackRock, Inc. 31,70 %	17.06.2022	1.200	USD	-70.043,00	-0,01
BlackRock, Inc. 29,05 %	21.01.2022	1.864	USD	-87.093,55	-0,01
BlackRock, Inc. 30,84 %	21.01.2022	1.700	USD	-84.964,16	-0,01
BlackRock, Inc. 32,91 %	21.01.2022	4.000	USD	-281.912,47	-0,03
BlackRock, Inc. 29,04 %	17.06.2022	2.500	USD	-88.940,89	-0,01
BlackRock, Inc. 32,60 %	21.01.2022	2.000	USD	-139.505,86	-0,01
BNP Paribas S.A. 31,13 %	17.06.2022	2.000	EUR	-58.560,00	-0,01
Booking Holdings, Inc. 32,46 %	20.01.2023	2.500	USD	14.335,10	0,00
Booking Holdings, Inc. 33,38 %	20.01.2023	2.500	USD	-4.553,50	0,00
Boston Scientific Corp. 28,75 %	21.01.2022	1.500	USD	-49.810,27	-0,01
Boston Scientific Corp. 35,64 %	21.01.2022	2.000	USD	-142.035,58	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 24,91 %	17.06.2022	2.500	USD	-72.265,79	-0,01
Broadcom, Inc. 41,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-131.887,17	-0,01
Broadcom, Inc. 37,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-104.717,94	-0,01
Broadcom, Inc. 37,38 %	21.01.2022	1.700	USD	-89.995,78	-0,01
Broadcom, Inc. 33,56 %	20.01.2023	2.500	USD	-63.791,21	-0,01
Broadcom, Inc. 34,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-108.841,39	-0,01
Broadcom, Inc. 38,04 %	21.01.2022	2.000	USD	-143.266,72	-0,02
Broadcom, Inc. 34,75 %	17.06.2022	2.500	USD	-114.217,05	-0,01
Broadcom, Inc. 37,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-141.285,10	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Broadcom, Inc. 32,70 %	20.01.2023	2.200	USD	-37.844,67	0,00
Broadcom, Inc. 33,05 %	17.06.2022	2.500	USD	-78.337,13	-0,01
Broadcom, Inc. 40,07 %	21.01.2022	3.000	USD	-230.609,66	-0,02
Broadcom, Inc. 37,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-185.850,41	-0,02
Broadcom, Inc. 37,27 %	21.01.2022	926	USD	-61.670,86	-0,01
Broadcom, Inc. 33,30 %	20.01.2023	1.429	USD	-32.140,19	0,00
Broadcom, Inc. 40,02 %	21.01.2022	2.500	USD	-178.893,67	-0,02
Broadcom, Inc. 33,54 %	17.06.2022	2.500	USD	-91.217,64	-0,01
Broadcom, Inc. 35,59 %	17.06.2022	1.250	USD	-66.658,24	-0,01
Broadcom, Inc. 37,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-82.051,61	-0,01
Broadcom, Inc. 39,00 %	21.01.2022	2.000	USD	-142.356,02	-0,01
Broadcom, Inc. 38,01 %	21.01.2022	1.536	USD	-81.645,95	-0,01
Broadcom, Inc. 41,84 %	21.01.2022	4.000	USD	-383.135,17	-0,04
Broadcom, Inc. 36,67 %	17.06.2022	2.500	USD	-159.077,49	-0,02
Broadcom, Inc. 37,70 %	17.06.2022	1.200	USD	-86.637,99	-0,01
Broadcom, Inc. 37,80 %	21.01.2022	3.000	USD	-176.397,67	-0,02
Broadcom, Inc. 39,12 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.499,87	-0,01
Broadcom, Inc. 43,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-252.487,56	-0,03
Broadcom, Inc. 33,10 %	20.01.2023	2.500	USD	-57.572,31	-0,01
Broadcom, Inc. 34,72 %	21.01.2022	834	USD	-44.024,26	0,00
Broadcom, Inc. 32,64 %	17.06.2022	1.800	USD	-50.346,58	-0,01
Broadcom, Inc. 32,87 %	20.01.2023	2.500	USD	-49.940,97	0,00
Broadcom, Inc. 36,61 %	17.06.2022	2.500	USD	-157.665,06	-0,02
Caterpillar, Inc. 33,70 %	17.06.2022	1.200	USD	-45.585,63	0,00
Caterpillar, Inc. 36,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-90.032,89	-0,01
Caterpillar, Inc. 36,67 %	21.01.2022	3.000	USD	-186.364,79	-0,02
Caterpillar, Inc. 36,71 %	21.01.2022	4.000	USD	-247.643,14	-0,03
Caterpillar, Inc. 34,12 %	21.01.2022	1.700	USD	-67.088,28	-0,01
Caterpillar, Inc. 35,96 %	21.01.2022	2.000	USD	-111.965,60	-0,01
Caterpillar, Inc. 34,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-142.233,75	-0,01
Caterpillar, Inc. 33,22 %	17.06.2022	2.500	USD	-81.436,04	-0,01
Caterpillar, Inc. 35,90 %	21.01.2022	4.000	USD	-214.689,27	-0,02
Charles Schwab Corp./The 37,10 %	21.01.2022	1.000	USD	-42.069,31	0,00
Charles Schwab Corp./The 38,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-61.826,46	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,99 %	21.01.2022	745	USD	-24.280,27	0,00
Cheniere Energy, Inc. 41,80 %	21.01.2022	1.800	USD	-177.419,69	-0,02
Chevron Corp. 32,00 %	17.06.2022	1.200	USD	-49.501,64	-0,01
Chevron Corp. 31,47 %	17.06.2022	2.500	USD	-87.296,57	-0,01
Chevron Corp. 30,99 %	17.06.2022	1.250	USD	-38.430,73	0,00
Chevron Corp. 28,70 %	20.01.2023	1.429	USD	-24.273,79	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 39,01 %	21.01.2022	2.000	USD	-157.534,36	-0,02
Chipotle Mexican Grill, Inc. 33,63 %	17.06.2022	2.000	USD	-46.142,17	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 38,50 %	21.01.2022	2.000	USD	-148.933,30	-0,02
Chipotle Mexican Grill, Inc. 38,26 %	21.01.2022	2.000	USD	-154.802,26	-0,02
Chipotle Mexican Grill, Inc. 42,91 %	21.01.2022	1.500	USD	-161.092,84	-0,02
Chipotle Mexican Grill, Inc. 40,06 %	21.01.2022	745	USD	-67.445,88	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 38,25 %	21.01.2022	1.400	USD	-101.290,16	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 38,20 %	21.01.2022	1.800	USD	-136.529,22	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 37,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.561,60	-0,01
Cie de Saint-Gobain 31,90 %	17.12.2021	2.500	EUR	-121.425,00	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 29,80 %	17.12.2021	2.151	CHF	-79.993,78	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 25,72 %	17.12.2021	2.047	CHF	616,26	0,00
Cie Financiere Richemont S.A. 25,69 %	17.12.2021	3.780	CHF	34,49	0,00
Cie Financiere Richemont S.A. 28,65 %	17.06.2022	1.752	CHF	-45.342,87	0,00
Cie Financiere Richemont S.A. 29,50 %	17.12.2021	2.703	CHF	-20.906,29	0,00
Cie Financiere Richemont S.A. 28,79 %	17.12.2021	2.709	CHF	-72.090,32	-0,01
Cigna Corp. 32,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-107.424,74	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,40 %	21.01.2022	2.000	USD	-171.430,98	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-105.540,10	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Cisco Systems, Inc. 30,44 %	21.01.2022	745	USD	-50.570,28	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,86 %	21.01.2022	1.500	USD	-112.231,22	-0,01
Cisco Systems, Inc. 34,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-154.616,75	-0,02
Cisco Systems, Inc. 33,39 %	21.01.2022	2.000	USD	-188.110,30	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,63 %	21.01.2022	926	USD	-67.433,47	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-122.894,00	-0,01
Cisco Systems, Inc. 28,78 %	20.01.2023	2.500	USD	-92.103,04	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,42 %	21.01.2022	1.700	USD	-144.641,20	-0,02
Cisco Systems, Inc. 31,60 %	21.01.2022	2.500	USD	-195.779,58	-0,02
Cisco Systems, Inc. 29,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-161.396,41	-0,02
Cisco Systems, Inc. 33,68 %	21.01.2022	2.000	USD	-193.608,23	-0,02
Cisco Systems, Inc. 26,64 %	20.01.2023	2.500	USD	-50.046,38	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,10 %	21.01.2022	2.000	USD	-134.497,01	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,98 %	21.01.2022	2.000	USD	-152.373,72	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-153.503,67	-0,02
Cisco Systems, Inc. 33,54 %	21.01.2022	3.000	USD	-286.111,81	-0,03
Cisco Systems, Inc. 36,31 %	21.01.2022	4.000	USD	-366.236,61	-0,04
Citigroup, Inc. 39,50 %	21.01.2022	2.500	USD	-234.990,30	-0,02
Citigroup, Inc. 35,50 %	17.06.2022	1.200	USD	-71.813,81	-0,01
Citigroup, Inc. 41,02 %	21.01.2022	2.000	USD	-143.502,82	-0,02
Citigroup, Inc. 40,97 %	21.01.2022	2.000	USD	-179.239,40	-0,02
Citigroup, Inc. 39,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-252.192,43	-0,03
Citigroup, Inc. 33,46 %	17.06.2022	2.500	USD	-112.741,38	-0,01
Citigroup, Inc. 36,99 %	21.01.2022	1.700	USD	-63.533,18	-0,01
CME Group, Inc. 28,13 %	17.06.2022	2.000	USD	-92.115,69	-0,01
Coca-Cola Co./The 22,15 %	21.01.2022	834	USD	-38.246,21	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 34,44 %	21.01.2022	1.700	USD	-133.388,14	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 29,47 %	17.06.2022	2.500	USD	-77.873,35	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 34,90 %	21.01.2022	2.500	USD	-206.151,45	-0,02
Comcast Corp. 32,05 %	21.01.2022	1.800	USD	-102.711,87	-0,01
Comcast Corp. 31,61 %	21.01.2022	1.500	USD	-77.257,78	-0,01
Comcast Corp. 32,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-168.985,58	-0,02
Comcast Corp. 30,19 %	21.01.2022	1.500	USD	-59.258,79	-0,01
Comcast Corp. 32,30 %	21.01.2022	2.000	USD	-131.798,63	-0,01
Comcast Corp. 30,62 %	21.01.2022	2.000	USD	-86.752,68	-0,01
Comcast Corp. 34,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.144,19	-0,01
Comcast Corp. 32,67 %	17.06.2022	2.000	USD	-96.804,11	-0,01
Comcast Corp. 30,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-102.538,16	-0,01
Comcast Corp. 32,07 %	21.01.2022	3.000	USD	-151.631,67	-0,02
Comcast Corp. 33,16 %	21.01.2022	4.000	USD	-233.139,39	-0,02
Comcast Corp. 33,15 %	17.06.2022	2.000	USD	-106.046,04	-0,01
Comcast Corp. 32,30 %	21.01.2022	1.800	USD	-108.616,24	-0,01
Comcast Corp. 32,46 %	21.01.2022	2.000	USD	-116.299,86	-0,01
Comcast Corp. 28,49 %	17.06.2022	2.500	USD	-28.775,61	0,00
Comcast Corp. 32,31 %	21.01.2022	2.000	USD	-131.950,42	-0,01
Comcast Corp. 30,86 %	21.01.2022	1.852	USD	-101.232,98	-0,01
Comcast Corp. 33,60 %	21.01.2022	1.700	USD	-107.025,88	-0,01
Comcast Corp. 30,81 %	21.01.2022	1.400	USD	-73.618,35	-0,01
Comcast Corp. 31,65 %	21.01.2022	2.000	USD	-120.145,04	-0,01
Comcast Corp. 31,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-122.501,90	-0,01
Constellation Brands, Inc. 29,69 %	17.06.2022	1.800	USD	-44.427,02	0,00
Corning, Inc. 38,90 %	21.01.2022	1.000	USD	-75.360,49	-0,01
Corning, Inc. 39,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-122.021,25	-0,01
Corning, Inc. 37,60 %	21.01.2022	2.500	USD	-170.672,06	-0,02
Corning, Inc. 38,18 %	21.01.2022	1.700	USD	-115.583,94	-0,01
Corning, Inc. 35,03 %	17.06.2022	2.500	USD	-131.208,36	-0,01
Corning, Inc. 41,32 %	21.01.2022	1.500	USD	-151.201,62	-0,02
Corning, Inc. 36,80 %	21.01.2022	1.800	USD	-107.204,66	-0,01
Costco Wholesale Corp. 27,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-99.974,70	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Costco Wholesale Corp. 24,45 %	17.06.2022	2.500	USD	-85.462,52	-0,01
Costco Wholesale Corp. 24,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-70.984,06	-0,01
Costco Wholesale Corp. 24,90 %	17.06.2022	1.200	USD	-44.998,73	0,00
Credit Agricole S.A. 31,62 %	17.06.2022	1.600	EUR	-55.152,00	-0,01
Credit Suisse Group AG 34,80 %	17.12.2021	2.151	CHF	-66.573,18	-0,01
Credit Suisse Group AG 33,43 %	17.12.2021	2.476	CHF	-47.190,79	-0,01
CSX Corp. 38,50 %	21.01.2022	1.000	USD	-129.766,42	-0,01
CSX Corp. 29,63 %	17.06.2022	2.000	USD	22.295,30	0,00
Cummins, Inc. 31,23 %	17.06.2022	2.500	USD	-81.499,28	-0,01
Cummins, Inc. 31,12 %	17.06.2022	2.500	USD	-77.114,43	-0,01
Cummins, Inc. 34,60 %	21.01.2022	1.800	USD	-128.423,99	-0,01
Cummins, Inc. 34,55 %	21.01.2022	1.700	USD	-119.640,78	-0,01
Cummins, Inc. 30,86 %	17.06.2022	2.000	USD	-61.185,60	-0,01
Cummins, Inc. 30,21 %	17.06.2022	2.000	USD	-46.749,30	-0,01
Cummins, Inc. 31,22 %	17.06.2022	2.500	USD	-79.981,45	-0,01
Cummins, Inc. 35,43 %	21.01.2022	1.500	USD	-126.979,51	-0,01
Cummins, Inc. 35,41 %	21.01.2022	1.400	USD	-117.829,50	-0,01
Cummins, Inc. 36,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-137.692,89	-0,01
Cummins, Inc. 31,29 %	20.01.2023	2.500	USD	-55.696,10	-0,01
Cummins, Inc. 36,60 %	21.01.2022	1.000	USD	-91.727,80	-0,01
Cummins, Inc. 32,72 %	21.01.2022	1.500	USD	-80.318,75	-0,01
Cummins, Inc. 35,78 %	21.01.2022	3.000	USD	-244.472,55	-0,03
Cummins, Inc. 29,84 %	17.06.2022	2.500	USD	-50.425,84	-0,01
Cummins, Inc. 31,41 %	17.06.2022	1.250	USD	-46.040,99	0,00
CVS Health Corp. 26,15 %	21.01.2022	1.500	USD	-31.583,61	0,00
CVS Health Corp. 26,75 %	21.01.2022	834	USD	-20.391,89	0,00
Daimler AG 33,74 %	17.12.2021	2.500	EUR	-84.225,00	-0,01
Danone S.A. 24,10 %	17.12.2021	2.000	EUR	-107.960,00	-0,01
DAX Index 23,75 %	17.12.2021	7.000	EUR	387.653,00	0,04
DAX Index 24,90 %	17.12.2021	7.000	EUR	474.705,00	0,05
DAX Index 23,45 %	17.12.2021	11.000	EUR	779.141,00	0,08
DAX Index 21,80 %	17.12.2021	11.250	EUR	622.080,00	0,06
DAX Index 24,75 %	17.12.2021	27.500	EUR	1.775.812,50	0,19
DAX Index 22,19 %	17.12.2021	10.450	EUR	593.424,15	0,06
DAX Index 20,15 %	17.06.2022	9.600	EUR	163.238,40	0,02
DAX Index 22,72 %	17.12.2021	10.000	EUR	645.040,00	0,07
DAX Index 19,39 %	17.06.2022	9.600	EUR	80.630,40	0,01
DAX Index 21,31 %	17.12.2021	10.500	EUR	510.888,00	0,05
DAX Index 23,00 %	17.12.2021	7.000	EUR	333.599,00	0,03
DAX Index 20,37 %	17.06.2022	11.000	EUR	189.200,00	0,02
DAX Index 22,70 %	17.12.2021	10.350	EUR	658.663,65	0,07
Deere & Co. 37,40 %	21.01.2022	3.000	USD	-200.101,19	-0,02
Deere & Co. 36,93 %	21.01.2022	1.500	USD	-96.761,95	-0,01
Deere & Co. 35,25 %	21.01.2022	1.800	USD	-81.796,11	-0,01
Deere & Co. 36,11 %	21.01.2022	1.500	USD	-82.759,93	-0,01
Deere & Co. 36,33 %	21.01.2022	1.700	USD	-99.643,30	-0,01
Deere & Co. 38,30 %	21.01.2022	1.000	USD	-70.174,55	-0,01
Deutsche Bank AG 42,94 %	17.12.2021	2.500	EUR	-164.700,00	-0,02
Deutsche Bank AG 45,00 %	17.12.2021	2.500	EUR	-214.775,00	-0,02
Deutsche Telekom AG 23,23 %	17.12.2021	1.900	EUR	-80.123,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 23,79 %	17.06.2022	2.500	EUR	-75.975,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 22,17 %	17.06.2022	2.500	EUR	-46.800,00	-0,01
Deutsche Telekom AG 20,00 %	16.12.2022	1.500	EUR	20.415,00	0,00
Deutsche Telekom AG 23,10 %	17.06.2022	2.904	EUR	-77.334,77	-0,01
Dollar General Corp. 27,09 %	21.01.2022	745	USD	-20.694,12	0,00
Dollar General Corp. 27,60 %	21.01.2022	1.700	USD	-58.573,23	-0,01
Dollar General Corp. 27,32 %	21.01.2022	1.500	USD	-41.866,94	0,00
Dollar General Corp. 27,20 %	20.01.2023	1.429	USD	-27.960,04	0,00
Dollar General Corp. 28,80 %	21.01.2022	1.000	USD	-41.403,15	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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Dominion Energy, Inc. 23,00 %	20.01.2023	1.429	USD	-32.381,12	0,00
Dominion Energy, Inc. 27,54 %	21.01.2022	1.500	USD	-101.859,35	-0,01
Dominion Energy, Inc. 28,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-109.941,82	-0,01
Dominion Energy, Inc. 22,85 %	21.01.2022	1.500	USD	-56.754,36	-0,01
Dow, Inc. 40,28 %	21.01.2022	1.500	USD	-104.920,31	-0,01
Dow, Inc. 36,51 %	17.06.2022	1.250	USD	-56.960,96	-0,01
Dow, Inc. 42,34 %	21.01.2022	1.500	USD	-135.694,41	-0,01
Dow, Inc. 35,66 %	17.06.2022	1.800	USD	-79.352,39	-0,01
Dow, Inc. 43,01 %	21.01.2022	1.400	USD	-136.895,19	-0,01
Dow, Inc. 41,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-109.144,95	-0,01
Dow, Inc. 40,40 %	21.01.2022	1.000	USD	-71.768,28	-0,01
Dow, Inc. 36,03 %	17.06.2022	2.000	USD	-84.863,82	-0,01
Dow, Inc. 40,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-102.706,80	-0,01
Dow, Inc. 37,20 %	17.06.2022	1.200	USD	-67.877,56	-0,01
Dow, Inc. 39,95 %	21.01.2022	1.500	USD	-97.723,25	-0,01
Dow, Inc. 39,98 %	21.01.2022	1.700	USD	-92.131,71	-0,01
Dow, Inc. 39,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-121.241,25	-0,01
Dow, Inc. 35,89 %	17.06.2022	2.500	USD	-114.617,59	-0,01
Dow, Inc. 39,80 %	21.01.2022	1.864	USD	-145.218,79	-0,02
Duke Energy Corp. 27,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.607,13	-0,01
Duke Energy Corp. 26,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-90.070,83	-0,01
Duke Energy Corp. 22,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-41.879,59	0,00
Duke Energy Corp. 20,66 %	21.01.2022	834	USD	-12.146,57	0,00
DuPont de Nemours, Inc. 29,78 %	17.06.2022	2.500	USD	-53.271,78	-0,01
DuPont de Nemours, Inc. 32,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-81.937,77	-0,01
E.ON SE 24,20 %	17.06.2022	1.600	EUR	-58.656,00	-0,01
E.ON SE 21,12 %	16.12.2022	1.500	EUR	-5.430,00	0,00
E.ON SE 21,89 %	17.06.2022	2.000	EUR	-30.940,00	0,00
E.ON SE 22,03 %	16.12.2022	2.500	EUR	-31.675,00	0,00
Electronic Arts, Inc. 32,30 %	20.01.2023	2.500	USD	-27.363,18	0,00
Electronic Arts, Inc. 34,20 %	20.01.2023	2.200	USD	-53.984,31	-0,01
Electronic Arts, Inc. 37,60 %	21.01.2022	1.500	USD	-159.726,79	-0,02
Electronic Arts, Inc. 37,50 %	21.01.2022	2.000	USD	-193.675,69	-0,02
Eli Lilly and Co. 32,30 %	21.01.2022	1.700	USD	-13.976,72	0,00
Emerson Electric Co. 28,79 %	17.06.2022	2.000	USD	-34.269,33	0,00
Emerson Electric Co. 28,42 %	17.06.2022	2.500	USD	-30.799,39	0,00
Emerson Electric Co. 27,79 %	17.06.2022	2.500	USD	-23.252,38	0,00
Emerson Electric Co. 28,49 %	17.06.2022	2.500	USD	-32.001,01	0,00
Emerson Electric Co. 27,66 %	17.06.2022	1.800	USD	-13.888,19	0,00
Emerson Electric Co. 28,20 %	20.01.2023	2.500	USD	47.031,79	0,00
Emerson Electric Co. 28,60 %	17.06.2022	1.200	USD	-16.149,76	0,00
Engie SA 25,70 %	17.06.2022	2.904	EUR	-90.112,58	-0,01
Engie SA 27,33 %	17.06.2022	2.500	EUR	-121.450,00	-0,01
Engie SA 24,90 %	17.06.2022	2.000	EUR	-41.620,00	0,00
Enterprise Products Partners LP 26,90 %	20.01.2023	1.429	USD	13.757,16	0,00
Estee Lauder Companies, Inc. 29,50 %	17.06.2022	1.250	USD	-14.946,46	0,00
EURO STOXX Banks EUR Price Index 33,20 %	17.12.2021	20.000	EUR	492.300,00	0,05
Exelon Corp. 28,20 %	21.01.2022	1.000	USD	-53.216,97	-0,01
Facebook, Inc. 34,2 %	17.06.2022	2.500	USD	-41.571,80	-0,01
Facebook, Inc. 37,11 %	21.01.2022	1.500	USD	-30.369,34	0,00
Facebook, Inc. 33,70 %	20.01.2023	2.200	USD	12.058,36	0,00
Facebook, Inc. 37,65 %	21.01.2022	4.000	USD	-90.328,02	-0,01
Facebook, Inc. 34,20 %	17.06.2022	2.500	USD	-41.571,80	0,00
Facebook, Inc. 33,99 %	20.01.2023	2.500	USD	5.923,77	0,00
Facebook, Inc. 38,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-97.457,63	-0,01
FedEx Corp. 39,35 %	21.01.2022	1.500	USD	-57.892,74	-0,01
FirstEnergy Corp. 25,74 %	17.06.2022	2.000	USD	-75.807,40	-0,01
FTSE 100 Index 20,68 %	17.12.2021	8.769	GBP	597.606,47	0,06
FTSE 100 Index 19,70 %	17.06.2022	17.500	GBP	677.864,51	0,07

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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
FTSE 100 Index 21,25 %	17.12.2021	9.795	GBP	755.040,75	0,08
FTSE 100 Index 21,38 %	17.06.2022	12.975	GBP	799.588,50	0,08
FTSE 100 Index 17,74 %	16.12.2022	12.990	GBP	107.724,68	0,01
FTSE 100 Index 18,78 %	17.06.2022	19.193	GBP	543.661,56	0,06
FTSE 100 Index 18,02 %	17.06.2022	9.567	GBP	161.747,04	0,02
FTSE 100 Index 20,74 %	17.12.2021	9.200	GBP	657.572,67	0,07
FTSE 100 Index 19,75 %	17.12.2021	9.515	GBP	520.055,20	0,05
FTSE 100 Index 18,10 %	17.06.2022	8.275	GBP	159.981,22	0,02
FTSE 100 Index 18,74 %	17.12.2021	9.576	GBP	426.245,32	0,04
FTSE 100 Index 20,13 %	17.12.2021	10.135	GBP	655.050,91	0,07
FTSE 100 Index 17,13 %	16.12.2022	16.868	GBP	35.053,60	0,00
FTSE 100 Index 17,29 %	17.06.2022	12.528	GBP	120.690,85	0,01
Garmin Ltd. 32,20 %	21.01.2022	2.500	USD	-197.297,41	-0,02
Gilead Sciences, Inc. 33,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-140.614,72	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 36,80 %	21.01.2022	1.000	USD	-82.797,88	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 31,06 %	21.01.2022	834	USD	-28.412,27	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 37,82 %	21.01.2022	1.500	USD	-137.971,16	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 37,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-111.763,22	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-118.603,60	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,30 %	21.01.2022	2.000	USD	-125.255,08	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,00 %	21.01.2022	2.500	USD	-177.818,53	-0,02
Goldman Sachs Group, Inc. 34,10 %	21.01.2022	1.800	USD	-96.898,56	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,01 %	21.01.2022	1.852	USD	-133.743,71	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,97 %	21.01.2022	1.700	USD	-110.007,59	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 37,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.865,17	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 37,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-116.797,37	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,15 %	21.01.2022	1.500	USD	-93.840,12	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,38 %	21.01.2022	1.500	USD	-84.973,44	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-111.788,52	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,66 %	21.01.2022	1.500	USD	-91.145,97	-0,01
Henkel AG & Co. KGaA 20,47 %	16.12.2022	1.500	EUR	-720,00	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 40,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-130.192,26	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 40,10 %	21.01.2022	1.000	USD	-72.518,76	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,40 %	21.01.2022	1.800	USD	-120.713,39	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,70 %	21.01.2022	1.000	USD	-65.452,40	-0,01
Home Depot, Inc./The 32,55 %	21.01.2022	2.000	USD	-179.947,72	-0,02
Home Depot, Inc./The 28,21 %	17.06.2022	2.000	USD	-88.658,40	-0,01
Home Depot, Inc./The 28,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-106.885,91	-0,01
Home Depot, Inc./The 31,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-124.057,68	-0,01
Home Depot, Inc./The 26,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-60.789,27	-0,01
Home Depot, Inc./The 31,51 %	21.01.2022	1.700	USD	-134.878,99	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-171.641,79	-0,02
Home Depot, Inc./The 28,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.977,74	-0,01
Home Depot, Inc./The 32,30 %	21.01.2022	2.000	USD	-175.613,46	-0,02
Home Depot, Inc./The 26,98 %	17.06.2022	1.250	USD	-41.223,97	0,00
Home Depot, Inc./The 30,52 %	21.01.2022	2.000	USD	-156.606,80	-0,02
Home Depot, Inc./The 28,90 %	21.01.2022	2.500	USD	-157.201,28	-0,02
Home Depot, Inc./The 29,82 %	17.06.2022	2.500	USD	-138.312,67	-0,01
Home Depot, Inc./The 33,14 %	21.01.2022	3.000	USD	-289.198,08	-0,03
Home Depot, Inc./The 30,73 %	21.01.2022	2.000	USD	-159.962,90	-0,02
Home Depot, Inc./The 27,19 %	20.01.2023	2.500	USD	-49.940,97	-0,01
Home Depot, Inc./The 27,71 %	17.06.2022	1.800	USD	-68.302,56	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,43 %	21.01.2022	1.500	USD	-94.801,42	-0,01
Home Depot, Inc./The 28,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-157.159,12	-0,02
Home Depot, Inc./The 26,60 %	21.01.2022	1.864	USD	-84.751,57	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,30 %	21.01.2022	2.000	USD	-129.049,67	-0,01
Home Depot, Inc./The 26,52 %	17.06.2022	2.500	USD	-71.127,41	-0,01
Home Depot, Inc./The 31,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-117.682,77	-0,01
Home Depot, Inc./The 28,90 %	21.01.2022	2.000	USD	-115.085,59	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Home Depot, Inc./The 25,64 %	21.01.2022	834	USD	-30.127,42	0,00
Honeywell International, Inc. 27,96 %	17.06.2022	2.000	USD	-88.843,92	-0,01
Honeywell International, Inc. 25,70 %	17.06.2022	1.250	USD	-31.073,45	0,00
Honeywell International, Inc. 24,89 %	17.06.2022	2.500	USD	-42.583,69	0,00
Honeywell International, Inc. 28,50 %	17.06.2022	1.200	USD	-57.070,58	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,07 %	17.06.2022	2.500	USD	-102.474,91	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,90 %	20.01.2023	2.500	USD	-44.249,09	0,00
Honeywell International, Inc. 26,24 %	17.06.2022	2.000	USD	-56.834,47	0,00
Honeywell International, Inc. 29,10 %	20.01.2023	2.200	USD	-41.332,32	0,00
Honeywell International, Inc. 24,74 %	17.06.2022	1.800	USD	-28.155,83	0,00
HP, Inc. 37,50 %	21.01.2022	1.864	USD	-110.309,07	-0,01
Humana, Inc. 39,30 %	21.01.2022	4.000	USD	-448.031,03	-0,05
Humana, Inc. 30,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-126.802,43	-0,01
Humana, Inc. 29,98 %	17.06.2022	2.500	USD	-112.699,22	-0,01
ING Groep NV 38,36 %	17.12.2021	2.000	EUR	-36.780,00	0,00
Intel Corp. 40,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-74.146,22	-0,01
Intel Corp. 34,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-9.144,95	0,00
Intel Corp. 35,60 %	21.01.2022	4.000	USD	-35.416,14	0,00
Intel Corp. 37,67 %	21.01.2022	1.500	USD	-30.369,34	-0,01
Intel Corp. 36,63 %	21.01.2022	1.500	USD	-43.093,85	0,00
Intel Corp. 35,50 %	21.01.2022	2.500	USD	-41.445,32	0,00
Intel Corp. 35,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-6.982,04	0,00
Intel Corp. 34,36 %	21.01.2022	2.000	USD	-11.737,92	0,00
Intel Corp. 33,40 %	20.01.2023	1.429	USD	-32.405,21	0,00
Intel Corp. 36,00 %	21.01.2022	1.700	USD	-29.472,97	0,00
Intel Corp. 35,60 %	21.01.2022	3.000	USD	-24.108,27	0,00
Intel Corp. 34,90 %	21.01.2022	1.800	USD	-15.997,98	0,00
Intel Corp. 34,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-14.377,27	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 25,07 %	17.06.2022	2.500	USD	-71.991,74	-0,01
Intercontinental Exchange, Inc. 30,72 %	21.01.2022	2.000	USD	-169.086,77	-0,02
Intercontinental Exchange, Inc. 26,13 %	17.06.2022	1.800	USD	-69.759,68	-0,01
Intercontinental Exchange, Inc. 29,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-117.758,66	-0,01
Intercontinental Exchange, Inc. 27,10 %	20.01.2023	2.200	USD	-69.252,04	-0,01
International Business Machines Corp. 32,50 %	21.01.2022	3.000	USD	-178.750,32	-0,02
International Business Machines Corp. 32,52 %	21.01.2022	3.000	USD	-177.864,91	-0,02
International Business Machines Corp. 27,20 %	17.06.2022	1.200	USD	-37.551,22	0,00
International Business Machines Corp. 26,86 %	17.06.2022	2.500	USD	-72.244,71	-0,01
International Business Machines Corp. 29,10 %	21.01.2022	1.700	USD	-71.732,86	-0,01
International Business Machines Corp. 27,78 %	21.01.2022	1.700	USD	-31.938,61	0,00
International Business Machines Corp. 31,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-80.559,07	-0,01
International Business Machines Corp. 26,60 %	17.06.2022	2.500	USD	-67.016,61	-0,01
International Business Machines Corp. 28,72 %	21.01.2022	926	USD	-52.097,74	-0,01
International Paper 33,02 %	17.06.2022	2.500	USD	-103.128,43	-0,01
International Paper 30,70 %	20.01.2023	1.429	USD	-12.974,13	0,00
Intesa Sanpaolo SpA 33,29 %	17.12.2021	2.500	EUR	-203.350,00	-0,02
Intesa Sanpaolo SpA 31,50 %	17.12.2021	2.500	EUR	-92.925,00	-0,01
Intesa Sanpaolo SpA 30,65 %	16.12.2021	2.300	EUR	-113.206,00	-0,01
Intesa Sanpaolo SpA 30,90 %	17.12.2021	2.000	EUR	-102.320,00	-0,01
Intesa Sanpaolo SpA 30,38 %	16.12.2021	3.000	EUR	-85.110,00	-0,01
Intuit, Inc. 37,32 %	21.01.2022	1.500	USD	-101.821,40	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 35,06 %	21.01.2022	745	USD	-38.216,61	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,50 %	21.01.2022	4.000	USD	-243.797,96	-0,03
JPMorgan Chase & Co. 31,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-102.757,40	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,41 %	21.01.2022	2.000	USD	-189.897,97	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 32,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-202.420,10	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 35,40 %	21.01.2022	2.000	USD	-205.346,15	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 34,92 %	21.01.2022	1.400	USD	-137.426,43	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 28,80 %	20.01.2023	2.200	USD	-46.062,90	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,66 %	20.01.2023	2.500	USD	-89.362,51	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
JPMorgan Chase & Co. 30,13 %	17.06.2022	2.500	USD	-111.392,19	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,01 %	21.01.2022	1.700	USD	-97.120,33	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,65 %	20.01.2023	2.500	USD	-90.184,67	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,70 %	20.01.2023	2.500	USD	-91.175,48	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,09 %	21.01.2022	1.500	USD	-86.883,38	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-143.498,61	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 35,72 %	21.01.2022	1.500	USD	-157.159,12	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,60 %	21.01.2022	3.000	USD	-159.069,06	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 33,40 %	21.01.2022	1.000	USD	-83.944,68	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 29,56 %	21.01.2022	1.665	USD	-88.234,32	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-133.918,55	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,16 %	17.06.2022	1.250	USD	-80.023,62	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-183.109,87	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 34,30 %	21.01.2022	2.000	USD	-175.950,75	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 32,94 %	21.01.2022	1.537	USD	-123.707,75	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,70 %	21.01.2022	1.800	USD	-137.955,99	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 35,51 %	21.01.2022	2.000	USD	-207.201,28	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 32,92 %	21.01.2022	1.500	USD	-115.760,18	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,70 %	21.01.2022	2.000	USD	-159.389,49	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 33,68 %	21.01.2022	1.500	USD	-121.439,41	-0,01
KBC Bank 38,64 %	17.12.2021	500	EUR	-31.030,00	0,00
Kellogg Co. 23,80 %	20.01.2023	1.429	USD	-24.936,35	0,00
Koninklijke Philips NV 23,98 %	16.12.2022	2.500	EUR	10.350,00	0,00
Koninklijke Philips NV 24,56 %	17.12.2021	3.500	EUR	-37.835,00	0,00
Koninklijke Philips NV 26,58 %	17.12.2021	2.500	EUR	-86.800,00	-0,01
Koninklijke Philips NV 25,04 %	17.12.2021	1.900	EUR	-28.082,00	0,00
Koninklijke Philips NV 23,55 %	16.12.2022	1.500	EUR	12.735,00	0,00
Koninklijke Philips NV 26,84 %	17.12.2021	2.500	EUR	-89.300,00	-0,01
Koninklijke Philips NV 25,60 %	17.06.2022	2.904	EUR	-29.069,51	0,00
Koninklijke Philips NV 24,69 %	17.06.2022	2.000	EUR	-3.320,00	0,00
Kraft Heinz Co./The 30,35 %	21.01.2022	1.500	USD	-89.122,19	-0,01
Kraft Heinz Co./The 32,00 %	21.01.2022	1.700	USD	-110.351,63	-0,01
Kraft Heinz Co./The 33,98 %	21.01.2022	1.500	USD	-101.391,35	-0,01
Kraft Heinz Co./The 28,80 %	20.01.2023	1.429	USD	-32.188,37	0,00
LafargeHolcim Ltd. 24,75 %	17.06.2022	2.211	CHF	-46.778,29	-0,01
LafargeHolcim Ltd. 27,40 %	17.12.2021	2.151	CHF	-138.895,25	-0,01
LafargeHolcim Ltd. 25,39 %	17.06.2022	2.765	CHF	-79.959,47	-0,01
LafargeHolcim Ltd. 24,43 %	17.06.2022	1.209	CHF	-21.146,90	0,00
LafargeHolcim Ltd. 27,57 %	17.12.2021	2.702	CHF	-176.055,38	-0,02
Lloyds Banking Group PLC 38,24 %	17.12.2021	452	GBP	-17.753,43	0,00
Lonza Group AG 29,18 %	17.12.2021	2.476	CHF	-116.406,95	-0,01
L'Oreal S.A . 23,83 %	17.06.2022	2.500	EUR	-96.925,00	-0,01
L'Oreal S.A . 21,28 %	16.12.2022	1.500	EUR	-15.855,00	0,00
L'Oreal S.A . 25,00 %	17.06.2022	2.904	EUR	-146.741,49	-0,02
L'Oreal S.A . 22,76 %	17.12.2021	1.900	EUR	-78.869,00	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 34,20 %	21.01.2022	1.700	USD	-85.523,23	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 36,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-113.420,19	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 33,76 %	21.01.2022	1.537	USD	-98.429,80	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 31,80 %	17.06.2022	1.250	USD	-53.377,19	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 31,70 %	20.01.2023	1.429	USD	-39.440,39	0,00
Lowe's Cos., Inc. 34,33 %	21.01.2022	1.852	USD	-148.952,86	-0,02
Lowe's Cos., Inc. 31,25 %	21.01.2022	1.665	USD	-88.360,71	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 32,97 %	17.06.2022	2.000	USD	-106.029,18	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 33,90 %	21.01.2022	1.800	USD	-126.268,66	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 30,58 %	20.01.2023	2.500	USD	-46.631,25	0,00
Marathon Petroleum Corp. 32,50 %	20.01.2023	1.429	USD	-4.866,80	0,00
Mastercard, Inc. 34,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-175.225,57	-0,02
McDonald's Corp. 27,14 %	21.01.2022	1.500	USD	-121.591,20	-0,01
McDonald's Corp. 25,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-103.098,91	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
McDonald's Corp. 24,30 %	21.01.2022	1.864	USD	-115.998,99	-0,01
McDonald's Corp. 27,10 %	21.01.2022	1.000	USD	-79.070,75	-0,01
McDonald's Corp. 25,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-107.386,79	-0,01
McDonald's Corp. 26,10 %	21.01.2022	2.000	USD	-142.996,88	-0,02
Medtronic, Inc. 27,07 %	17.06.2022	2.000	USD	-86.718,95	-0,01
Medtronic, Inc. 28,67 %	21.01.2022	745	USD	-41.582,94	0,00
Medtronic, Inc. 27,02 %	17.06.2022	1.800	USD	-76.832,79	-0,01
Medtronic, Inc. 28,43 %	21.01.2022	926	USD	-60.608,92	-0,01
Merck & Co., Inc. 23,50 %	21.01.2022	1.864	USD	-58.095,77	-0,01
MetLife, Inc. 37,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-143.182,39	-0,02
MetLife, Inc. 25,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-154.604,10	-0,02
MetLife, Inc. 37,92 %	21.01.2022	1.400	USD	-108.999,07	-0,01
MetLife, Inc. 36,01 %	21.01.2022	2.000	USD	-126.165,78	-0,01
MetLife, Inc. 37,31 %	21.01.2022	1.500	USD	-103.857,83	-0,01
MetLife, Inc. 35,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-91.854,29	-0,01
MetLife, Inc. 33,15 %	21.01.2022	1.864	USD	-73.717,52	-0,01
MetLife, Inc. 32,83 %	17.06.2022	1.250	USD	-11.562,95	0,00
MetLife, Inc. 37,41 %	21.01.2022	2.000	USD	-142.693,31	-0,02
MetLife, Inc. 36,48 %	21.01.2022	2.000	USD	-131.056,58	-0,01
Micron Technology, Inc. 45,89 %	21.01.2022	1.700	USD	-63.031,45	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-92.448,77	-0,01
Micron Technology, Inc. 46,99 %	21.01.2022	1.500	USD	-63.483,43	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-61.573,49	-0,01
Micron Technology, Inc. 52,80 %	21.01.2022	4.000	USD	-327.717,35	-0,03
Micron Technology, Inc. 45,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-72.645,25	-0,01
Micron Technology, Inc. 43,03 %	20.01.2023	2.500	USD	-45.535,04	0,00
Micron Technology, Inc. 43,11 %	17.06.2022	2.500	USD	-87.760,35	-0,01
Micron Technology, Inc. 41,99 %	20.01.2023	2.500	USD	-23.168,06	0,00
Micron Technology, Inc. 46,10 %	21.01.2022	2.000	USD	-68.875,96	-0,01
Micron Technology, Inc. 47,20 %	21.01.2022	556	USD	-36.593,14	0,00
Micron Technology, Inc. 48,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-93.941,31	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,98 %	21.01.2022	1.536	USD	-79.223,26	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,01 %	21.01.2022	926	USD	-60.843,17	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,00 %	20.01.2023	1.429	USD	-35.874,62	0,00
Micron Technology, Inc. 41,11 %	20.01.2023	2.500	USD	-2.909,18	0,00
Micron Technology, Inc. 49,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.092,33	-0,01
Microsoft Corp. 28,86 %	17.06.2022	2.500	USD	-88.434,94	-0,01
Microsoft Corp. 30,80 %	17.06.2022	1.200	USD	-62.818,11	-0,01
Microsoft Corp. 27,43 %	17.06.2022	2.500	USD	-58.626,36	-0,01
Microsoft Corp. 27,74 %	20.01.2023	2.500	USD	-42.942,07	0,00
Microsoft Corp. 27,58 %	20.01.2023	2.500	USD	-39.653,43	0,00
Microsoft Corp. 29,98 %	17.06.2022	2.000	USD	-89.063,16	-0,01
Microsoft Corp. 35,31 %	21.01.2022	4.000	USD	-304.949,83	-0,03
Microsoft Corp. 34,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-189.021,00	-0,02
Microsoft Corp. 34,86 %	21.01.2022	2.000	USD	-200.134,92	-0,02
Microsoft Corp. 31,60 %	21.01.2022	1.700	USD	-122.808,83	-0,01
Microsoft Corp. 35,17 %	21.01.2022	1.500	USD	-114.760,94	-0,01
Microsoft Corp. 32,10 %	21.01.2022	2.000	USD	-152.829,07	-0,02
Microsoft Corp. 31,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-104.540,86	-0,01
Microsoft Corp. 32,49 %	21.01.2022	1.500	USD	-124.184,16	-0,01
Microsoft Corp. 32,50 %	21.01.2022	1.536	USD	-123.181,48	-0,01
Microsoft Corp. 33,11 %	21.01.2022	1.500	USD	-133.379,71	-0,01
Microsoft Corp. 32,93 %	21.01.2022	926	USD	-81.777,53	-0,01
Microsoft Corp. 35,35 %	21.01.2022	1.500	USD	-159.056,41	-0,02
Microsoft Corp. 32,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-124.677,46	-0,01
Microsoft Corp. 34,60 %	21.01.2022	3.000	USD	-274.171,52	-0,03
Microsoft Corp. 33,79 %	21.01.2022	2.500	USD	-234.990,30	-0,03
Mondelez International, Inc. 26,36 %	21.01.2022	745	USD	-56.021,72	-0,01
Mondelez International, Inc. 25,9 %	21.01.2022	1.700	USD	-127.740,11	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Mondelez International, Inc. 30,20 %	21.01.2022	1.700	USD	-183.431,99	-0,02
Monster Beverage Corp. 34,28 %	21.01.2022	1.500	USD	-132.949,66	-0,01
Morgan Stanley 32,70 %	20.01.2023	2.200	USD	-20.332,23	0,00
Morgan Stanley 35,75 %	21.01.2022	1.800	USD	-99.797,63	-0,01
Morgan Stanley 36,60 %	21.01.2022	2.000	USD	-136.217,22	-0,01
Morgan Stanley 34,89 %	17.06.2022	2.000	USD	-103.010,37	-0,01
Morgan Stanley 33,25 %	21.01.2022	1.500	USD	-56.235,77	-0,01
Morgan Stanley 35,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-84.758,41	-0,01
Morgan Stanley 35,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-148.452,65	-0,02
Morgan Stanley 34,65 %	21.01.2022	1.864	USD	-96.540,08	-0,01
Morgan Stanley 35,40 %	21.01.2022	2.000	USD	-96.247,58	-0,01
Morgan Stanley 36,64 %	21.01.2022	1.700	USD	-87.874,18	-0,01
Morgan Stanley 36,21 %	21.01.2022	1.500	USD	-83.038,20	-0,01
Morgan Stanley 38,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.341,51	-0,01
Morgan Stanley 38,60 %	21.01.2022	1.000	USD	-81.263,18	-0,01
Morgan Stanley 36,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-97.723,25	-0,01
Morgan Stanley 32,84 %	21.01.2022	834	USD	-26.865,83	0,00
Morgan Stanley 35,94 %	21.01.2022	2.000	USD	-106.535,12	-0,01
Morgan Stanley 36,00 %	21.01.2022	1.700	USD	-95.787,16	-0,01
Morgan Stanley 38,60 %	21.01.2022	2.500	USD	-214.056,83	-0,02
Morgan Stanley 38,14 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.813,31	-0,01
Morgan Stanley 36,55 %	21.01.2022	1.852	USD	-125.858,06	-0,01
Morgan Stanley 33,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-93.157,10	-0,01
Morgan Stanley 38,12 %	21.01.2022	2.000	USD	-130.162,75	-0,01
NASDAQ 100 Index 29,60 %	21.01.2022	5.250	USD	334.474,44	0,03
NASDAQ 100 Index 24,42 %	17.06.2022	5.000	USD	114.309,81	0,01
NASDAQ 100 Index 29,41 %	21.01.2022	20.000	USD	1.289.552,24	0,13
NASDAQ 100 Index 23,70 %	17.06.2022	7.560	USD	122.812,54	0,01
NASDAQ 100 Index 24,91 %	17.06.2022	7.200	USD	189.607,90	0,02
NASDAQ 100 Index 27,10 %	21.01.2022	10.000	USD	464.271,86	0,05
NASDAQ 100 Index 28,20 %	21.01.2022	10.200	USD	539.252,22	0,06
NASDAQ 100 Index 24,07 %	17.06.2022	7.500	USD	147.748,55	0,02
NASDAQ 100 Index 27,20 %	21.01.2022	14.000	USD	632.496,84	0,07
NASDAQ 100 Index 28,30 %	21.01.2022	12.500	USD	661.132,90	0,07
NASDAQ 100 Index 27,50 %	21.01.2022	11.050	USD	560.531,96	0,06
NASDAQ 100 Index 31,56 %	21.01.2022	7.200	USD	589.994,44	0,06
NASDAQ 100 Index 27,40 %	21.01.2022	12.500	USD	651.214,27	0,07
NASDAQ 100 Index 27,90 %	21.01.2022	15.000	USD	910.346,57	0,10
NASDAQ 100 Index 23,30 %	20.01.2023	20.000	USD	30.272,37	0,00
NASDAQ 100 Index 28,05 %	21.01.2022	26.000	USD	1.057.144,79	0,11
NASDAQ 100 Index 27,68 %	21.01.2022	9.000	USD	350.043,01	0,04
NASDAQ 100 Index 28,50 %	21.01.2022	14.250	USD	647.840,88	0,07
NASDAQ 100 Index 28,87 %	21.01.2022	30.000	USD	1.446.597,52	0,15
NASDAQ 100 Index 28,70 %	21.01.2022	20.400	USD	941.816,34	0,10
NASDAQ 100 Index 29,40 %	21.01.2022	7.650	USD	487.364,16	0,05
NASDAQ 100 Index 29,90 %	21.01.2022	4.000	USD	270.238,64	0,03
NASDAQ 100 Index 30,00 %	21.01.2022	24.000	USD	1.641.386,29	0,17
NASDAQ 100 Index 28,50 %	21.01.2022	15.300	USD	960.639,76	0,10
NASDAQ 100 Index 28,19 %	21.01.2022	6.000	USD	359.443,46	0,04
NASDAQ 100 Index 28,20 %	21.01.2022	20.000	USD	1.196.964,33	0,12
NASDAQ 100 Index 23,83 %	17.06.2022	30.000	USD	495.041,74	0,05
NASDAQ 100 Index 28,10 %	21.01.2022	12.375	USD	721.201,94	0,08
NASDAQ 100 Index 24,60 %	17.06.2022	7.500	USD	171.983,30	0,02
NASDAQ 100 Index 28,10 %	21.01.2022	5.400	USD	313.627,12	0,03
NASDAQ 100 Index 30,84 %	21.01.2022	12.000	USD	885.494,56	0,09
NASDAQ 100 Index 24,20 %	17.06.2022	25.000	USD	478.729,24	0,05
NASDAQ 100 Index 26,80 %	21.01.2022	6.750	USD	315.096,76	0,03
NASDAQ 100 Index 23,82 %	17.06.2022	25.000	USD	399.759,68	0,04
NASDAQ 100 Index 26,40 %	21.01.2022	12.240	USD	522.390,69	0,05

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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
NASDAQ 100 Index 25,75 %	21.01.2022	10.710	USD	385.989,88	0,04
NASDAQ 100 Index 26,70 %	21.01.2022	12.500	USD	557.224,47	0,06
NASDAQ 100 Index 22,85 %	20.01.2023	20.000	USD	-43.899,15	0,00
NASDAQ 100 Index 30,48 %	21.01.2022	10.500	USD	747.643,56	0,08
NASDAQ 100 Index 28,14 %	21.01.2022	7.200	USD	448.854,04	0,05
NASDAQ 100 Index 26,44 %	17.06.2022	4.000	USD	160.644,24	0,02
Netflix, Inc. 43,00 %	21.01.2022	2.500	USD	-241.925,96	-0,03
Netflix, Inc. 39,49 %	17.06.2022	2.000	USD	-116.906,99	-0,01
Netflix, Inc. 43,71 %	21.01.2022	745	USD	-71.396,29	-0,01
Netflix, Inc. 43,40 %	21.01.2022	1.700	USD	-113.734,71	-0,01
Netflix, Inc. 43,92 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.738,68	-0,01
Netflix, Inc. 44,60 %	21.01.2022	2.500	USD	-202.420,10	-0,02
Netflix, Inc. 42,90 %	21.01.2022	2.000	USD	-190.623,16	-0,02
Netflix, Inc. 45,42 %	21.01.2022	2.000	USD	-176.608,48	-0,02
Netflix, Inc. 37,35 %	17.06.2022	2.500	USD	-94.632,77	-0,01
Netflix, Inc. 46,40 %	21.01.2022	3.000	USD	-205.489,50	-0,02
Netflix, Inc. 41,00 %	21.01.2022	1.800	USD	-83.526,44	-0,01
Netflix, Inc. 38,48 %	21.01.2022	1.666	USD	-95.152,45	-0,01
Netflix, Inc. 45,44 %	21.01.2022	1.500	USD	-133.341,77	-0,01
Netflix, Inc. 35,87 %	20.01.2023	2.500	USD	-17.244,29	0,00
Netflix, Inc. 43,10 %	21.01.2022	2.000	USD	-127.835,40	-0,01
Netflix, Inc. 44,80 %	21.01.2022	1.000	USD	-104.359,56	-0,01
Netflix, Inc. 37,26 %	17.06.2022	2.500	USD	-96.993,84	-0,01
Netflix, Inc. 37,61 %	17.06.2022	1.800	USD	-82.767,52	-0,01
Netflix, Inc. 44,65 %	21.01.2022	1.500	USD	-112.724,51	-0,01
Netflix, Inc. 44,94 %	21.01.2022	1.500	USD	-168.644,07	-0,02
Netflix, Inc. 39,75 %	21.01.2022	1.864	USD	-129.610,80	-0,01
Netflix, Inc. 35,21 %	17.06.2022	2.500	USD	-56.834,47	-0,01
Netflix, Inc. 37,10 %	17.06.2022	1.200	USD	-43.794,58	0,00
Netflix, Inc. 35,85 %	17.06.2022	2.500	USD	-71.928,49	-0,01
Netflix, Inc. 46,09 %	21.01.2022	2.000	USD	-236.681,00	-0,02
Netflix, Inc. 42,20 %	21.01.2022	1.800	USD	-102.894,01	-0,01
Netflix, Inc. 35,30 %	17.06.2022	2.500	USD	-60.355,00	-0,01
Netflix, Inc. 42,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-91.082,72	-0,01
Netflix, Inc. 46,40 %	21.01.2022	2.000	USD	-241.942,83	-0,03
Netflix, Inc. 44,40 %	21.01.2022	2.000	USD	-145.914,50	-0,02
Netflix, Inc. 42,50 %	21.01.2022	2.500	USD	-146.998,06	-0,02
Netflix, Inc. 44,90 %	21.01.2022	2.500	USD	-271.861,03	-0,03
Netflix, Inc. 45,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-95.788,01	-0,01
Netflix, Inc. 45,52 %	21.01.2022	1.400	USD	-157.365,72	-0,02
Netflix, Inc. 37,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-73.463,19	-0,01
Netflix, Inc. 46,67 %	21.01.2022	1.500	USD	-134.290,41	-0,01
Netflix, Inc. 42,60 %	21.01.2022	2.500	USD	-154.460,75	-0,02
Netflix, Inc. 43,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-144.118,39	-0,02
Netflix, Inc. 38,49 %	17.06.2022	1.250	USD	-59.901,77	-0,01
Netflix, Inc. 38,82 %	17.06.2022	2.500	USD	-132.684,04	-0,01
Netflix, Inc. 42,97 %	21.01.2022	1.852	USD	-179.355,55	-0,02
Netflix, Inc. 39,77 %	17.06.2022	2.000	USD	-121.764,06	-0,01
Newmont Corp. 34,45 %	21.01.2022	1.820	USD	-74.586,39	-0,01
NIKE, Inc. 30,70 %	20.01.2023	2.500	USD	-28.438,32	0,00
NIKE, Inc. 29,40 %	20.01.2023	1.429	USD	2.421,36	0,00
Nordea Bank Abp 28,39 %	17.12.2021	15.448	SEK	-85.800,27	-0,01
Northern Trust Corp. 36,80 %	21.01.2022	1.000	USD	-87.671,81	-0,01
Nucor Corp. 37,51 %	21.01.2022	1.500	USD	27.156,59	0,00
Nucor Corp. 36,80 %	21.01.2022	1.500	USD	32.013,66	0,00
Nucor Corp. 37,20 %	21.01.2022	2.500	USD	49.308,54	0,01
NVIDIA Corp. 45,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-53.495,24	-0,01
NVIDIA Corp. 41,55 %	21.01.2022	1.864	USD	-13.926,17	0,00
NVIDIA Corp. 44,20 %	21.01.2022	1.537	USD	-17.530,01	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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
NVIDIA Corp. 47,00 %	21.01.2022	3.000	USD	-113.964,08	-0,01
NVIDIA Corp. 47,46 %	21.01.2022	1.500	USD	-55.894,26	-0,01
NVIDIA Corp. 46,30 %	21.01.2022	1.700	USD	-59.519,35	-0,01
NVIDIA Corp. 48,08 %	21.01.2022	1.500	USD	-68.517,58	-0,01
NVIDIA Corp. 48,45 %	21.01.2022	1.500	USD	-68.694,66	-0,01
NVIDIA Corp. 41,45 %	21.01.2022	834	USD	-6.270,10	0,00
NVIDIA Corp. 44,88 %	21.01.2022	1.852	USD	-67.972,72	-0,01
NVIDIA Corp. 45,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-64.558,56	-0,01
NVIDIA Corp. 42,20 %	20.01.2023	1.429	USD	-25.382,07	0,00
Oracle Corp. 30,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-109.494,90	-0,01
Oracle Corp. 28,90 %	21.01.2022	1.800	USD	-56.675,95	-0,01
Oracle Corp. 28,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-41.757,32	0,00
Oracle Corp. 29,90 %	21.01.2022	4.000	USD	-180.858,42	-0,02
Oracle Corp. 28,71 %	21.01.2022	1.500	USD	-40.146,72	0,00
Oracle Corp. 29,00 %	21.01.2022	2.000	USD	-63.276,84	-0,01
Oracle Corp. 29,90 %	21.01.2022	3.000	USD	-134.252,47	-0,01
Oracle Corp. 30,31 %	21.01.2022	1.500	USD	-69.719,20	-0,01
Oracle Corp. 27,70 %	21.01.2022	1.864	USD	-54.132,86	-0,01
Oracle Corp. 31,12 %	21.01.2022	1.500	USD	-83.771,82	-0,01
Oracle Corp. 29,75 %	21.01.2022	1.500	USD	-61.156,08	-0,01
Oracle Corp. 30,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-74.968,38	-0,01
Oracle Corp. 28,80 %	17.06.2022	2.000	USD	-57.171,77	-0,01
Oracle Corp. 28,82 %	17.06.2022	2.000	USD	-59.212,41	-0,01
Oracle Corp. 27,35 %	21.01.2022	1.500	USD	-42.777,64	0,00
Oracle Corp. 35,56 %	21.01.2022	4.000	USD	-373.555,95	-0,04
Oracle Corp. 29,09 %	17.06.2022	1.250	USD	-39.748,30	0,00
Oracle Corp. 31,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-86.187,71	-0,01
Oracle Corp. 30,60 %	21.01.2022	1.500	USD	-75.461,67	-0,01
Oracle Corp. 31,65 %	21.01.2022	2.500	USD	-116.746,77	-0,01
Orange S.A. 20,21 %	17.06.2022	2.200	EUR	-33.638,00	0,00
Orange S.A. 26,43 %	17.12.2021	2.300	EUR	-217.672,00	-0,02
Orange S.A. 18,99 %	17.06.2022	2.000	EUR	-7.880,00	0,00
PACCAR , Inc. 31,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-71.603,85	-0,01
PACCAR , Inc. 30,68 %	21.01.2022	1.500	USD	-48.570,71	-0,01
PACCAR , Inc. 31,86 %	21.01.2022	1.500	USD	-67.429,80	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 38,31 %	21.01.2022	4.000	USD	9.983,98	0,00
PayPal Holdings, Inc. 37,36 %	17.06.2022	2.500	USD	-114.217,05	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 38,70 %	17.06.2022	2.500	USD	-142.402,39	-0,02
PepsiCo, Inc. 26,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-117.872,50	-0,01
PepsiCo, Inc. 23,73 %	20.01.2023	2.500	USD	-67.754,45	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,96 %	21.01.2022	2.000	USD	-130.685,56	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-101.492,54	-0,01
Pfizer, Inc. 28,94 %	21.01.2022	1.400	USD	-120.344,04	-0,01
Pfizer, Inc. 23,15 %	21.01.2022	1.500	USD	-50.898,05	-0,01
Pfizer, Inc. 23,05 %	21.01.2022	1.864	USD	-65.135,48	-0,01
Pfizer, Inc. 24,05 %	21.01.2022	834	USD	-34.042,71	0,00
Philip Morris International, Inc. 30,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-115.734,88	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 45,75 %	21.01.2022	1.864	USD	-111.707,97	-0,01
PNC Financial Services Group, Inc./The 35,34 %	21.01.2022	1.400	USD	-92.872,93	-0,01
Procter & Gamble Co./The 28,85 %	21.01.2022	1.700	USD	-166.000,50	-0,02
Procter & Gamble Co./The 25,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.164,43	-0,01
Procter & Gamble Co./The 25,64 %	21.01.2022	1.500	USD	-100.543,89	-0,01
Prudential Financial, Inc. 30,77 %	17.06.2022	1.250	USD	-24.643,74	0,00
Prudential Financial, Inc. 32,65 %	21.01.2022	1.864	USD	-99.809,43	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,70 %	21.01.2022	1.700	USD	-106.567,16	-0,01
Prudential Financial, Inc. 37,10 %	21.01.2022	1.400	USD	-120.497,51	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,50 %	21.01.2022	1.000	USD	-77.266,21	-0,01
Prudential Financial, Inc. 30,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-55.717,18	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,90 %	21.01.2022	745	USD	-48.020,42	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Prudential Financial, Inc. 35,32 %	21.01.2022	2.000	USD	-151.614,81	-0,02
Prudential Financial, Inc. 35,00 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.107,77	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,85 %	21.01.2022	1.500	USD	-149.924,11	-0,02
Prudential PLC 34,11 %	17.12.2021	2.258	GBP	-57.719,77	-0,01
QUALCOMM, Inc. 39,68 %	21.01.2022	1.500	USD	-27.928,16	0,00
QUALCOMM, Inc. 34,50 %	17.06.2022	2.500	USD	-84.429,55	-0,01
QUALCOMM, Inc. 40,75 %	21.01.2022	4.000	USD	-111.105,49	-0,01
QUALCOMM, Inc. 32,20 %	20.01.2023	1.429	USD	6.095,56	0,00
QUALCOMM, Inc. 35,75 %	17.06.2022	2.500	USD	-110.591,11	-0,01
QUALCOMM, Inc. 36,70 %	21.01.2022	834	USD	-44.713,13	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 35,90 %	21.01.2022	1.864	USD	-123.276,43	-0,01
Russell 2000 Index 31,25 %	21.01.2022	24.000	USD	1.664.963,32	0,17
Russell 2000 Index 31,08 %	21.01.2022	10.500	USD	718.062,23	0,07
Russell 2000 Index 30,50 %	21.01.2022	12.500	USD	792.562,61	0,08
S&P 500 Index 22,00 %	17.06.2022	30.000	USD	888.287,38	0,09
S&P 500 Index 19,70 %	20.01.2023	17.600	USD	49.717,52	0,01
S&P 500 Index 23,30 %	21.01.2022	12.500	USD	784.488,57	0,08
S&P 500 Index 20,50 %	20.01.2023	17.500	USD	182.024,20	0,02
S&P 500 Index 28,05 %	21.01.2022	26.000	USD	2.200.934,31	0,23
S&P 500 Index 23,60 %	21.01.2022	15.000	USD	966.620,29	0,10
S&P 500 Index 24,92 %	21.01.2022	16.000	USD	1.146.619,45	0,12
S&P 500 Index 26,90 %	21.01.2022	30.000	USD	2.616.266,13	0,27
S&P 500 Index 24,30 %	21.01.2022	17.850	USD	1.191.851,38	0,12
S&P 500 Index 23,00 %	21.01.2022	15.750	USD	953.526,43	0,10
S&P 500 Index 26,11 %	21.01.2022	24.000	USD	1.948.636,48	0,20
S&P 500 Index 21,35 %	17.06.2022	27.500	USD	676.821,40	0,07
S&P 500 Index 22,20 %	17.06.2022	21.600	USD	691.932,21	0,07
S&P 500 Index 20,86 %	20.01.2023	15.000	USD	197.419,68	0,02
S&P 500 Index 21,68 %	17.06.2022	45.000	USD	1.265.456,62	0,13
S&P 500 Index 20,60 %	17.06.2022	17.500	USD	320.619,36	0,03
S&P 500 Index 23,50 %	21.01.2022	10.200	USD	656.888,95	0,07
S&P 500 Index 25,14 %	21.01.2022	22.000	USD	1.507.498,10	0,16
S&P 500 Index 23,22 %	21.01.2022	14.000	USD	869.666,92	0,09
S&P 500 Index 20,33 %	20.01.2023	12.500	USD	103.223,29	0,01
S&P 500 Index 20,37 %	20.01.2023	15.000	USD	126.650,65	0,01
S&P 500 Index 24,80 %	21.01.2022	14.250	USD	938.320,26	0,10
S&P 500 Index 24,63 %	21.01.2022	27.000	USD	1.868.940,05	0,20
S&P 500 Index 21,80 %	21.01.2022	40.000	USD	1.952.879,67	0,20
S&P 500 Index 23,80 %	21.01.2022	12.600	USD	844.770,56	0,09
S&P 500 Index 22,90 %	21.01.2022	30.000	USD	1.755.957,50	0,18
S&P 500 Index 20,95 %	20.01.2023	15.000	USD	197.887,68	0,02
S&P 500 Index 20,00 %	20.01.2023	30.000	USD	159.499,12	0,02
S&P 500 Index 24,58 %	21.01.2022	30.600	USD	1.936.967,88	0,20
S&P 500 Index 26,68 %	21.01.2022	9.000	USD	672.848,47	0,07
S&P 500 Index 23,26 %	21.01.2022	10.125	USD	634.906,40	0,07
S&P 500 Index 23,55 %	21.01.2022	16.800	USD	1.084.088,03	0,11
S&P 500 Index 24,75 %	21.01.2022	6.000	USD	422.383,00	0,04
S&P 500 Index 23,07 %	21.01.2022	25.000	USD	1.510.308,63	0,16
S&P 500 Index 25,70 %	21.01.2022	25.500	USD	1.989.468,76	0,21
S&P 500 Index 21,00 %	17.06.2022	20.000	USD	435.247,49	0,05
S&P 500 Index 23,70 %	21.01.2022	10.000	USD	640.989,97	0,07
S&P 500 Index 19,72 %	21.01.2022	20.000	USD	597.217,30	0,06
S&P 500 Index 22,50 %	21.01.2022	12.500	USD	692.006,07	0,07
S&P 500 Index 24,80 %	21.01.2022	12.250	USD	873.851,92	0,09
S&P 500 Index 22,70 %	17.06.2022	20.000	USD	789.122,19	0,08
S&P 500 Index 20,46 %	17.06.2022	17.500	USD	336.881,27	0,04
S&P 500 Index 22,54 %	17.06.2022	16.000	USD	606.337,80	0,06
S&P 500 Index 19,73 %	21.01.2022	30.000	USD	936.453,33	0,10
S&P 500 Index 20,46 %	17.06.2022	17.640	USD	335.872,50	0,03

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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
S&P 500 Index 23,30 %	21.01.2022	14.000	USD	825.538,41	0,09
S&P 500 Index 22,60 %	21.01.2022	19.890	USD	1.112.743,11	0,12
S&P 500 Index 26,66 %	21.01.2022	16.800	USD	1.478.836,32	0,15
S&P 500 Index 20,45 %	17.06.2022	20.000	USD	394.181,63	0,04
S&P 500 Index 22,40 %	21.01.2022	18.360	USD	1.009.358,77	0,11
S&P 500 Index 23,60 %	21.01.2022	15.300	USD	944.164,43	0,10
S&P 500 Index 21,00 %	17.06.2022	16.800	USD	393.855,80	0,04
S&P 500 Index 25,57 %	21.01.2022	12.000	USD	929.501,64	0,10
S&P 500 Index 22,94 %	21.01.2022	25.000	USD	1.369.677,04	0,14
S&P 500 Index 22,60 %	21.01.2022	11.050	USD	612.413,57	0,06
S&P Global, Inc. 33,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-114.229,70	-0,01
S&P Global, Inc. 30,79 %	21.01.2022	745	USD	-43.284,95	0,00
salesforce.com, Inc. 34,25 %	21.01.2022	1.864	USD	-79.863,26	-0,01
salesforce.com, Inc. 31,93 %	17.06.2022	1.800	USD	-986,60	0,00
salesforce.com, Inc. 33,36 %	17.06.2022	2.000	USD	-25.752,59	0,00
salesforce.com, Inc. 37,32 %	21.01.2022	2.000	USD	-143.199,26	-0,02
salesforce.com, Inc. 33,75 %	21.01.2022	1.500	USD	-56.754,36	0,00
salesforce.com, Inc. 36,95 %	17.06.2022	2.000	USD	-89.552,24	-0,01
salesforce.com, Inc. 37,80 %	17.06.2022	1.200	USD	-57.586,64	-0,01
salesforce.com, Inc. 36,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-161.206,68	-0,02
salesforce.com, Inc. 33,19 %	21.01.2022	834	USD	-28.131,10	0,00
salesforce.com, Inc. 37,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.221,60	-0,01
Sanofi 22,83 %	17.12.2021	2.300	EUR	-111.159,00	-0,01
Sanofi 20,17 %	16.12.2022	1.500	EUR	2.235,00	0,00
Sanofi 22,00 %	17.06.2022	2.500	EUR	-58.725,00	-0,01
Schneider Electric SE 29,45 %	17.12.2021	3.500	EUR	-264.985,00	-0,03
Schneider Electric SE 25,84 %	16.12.2022	2.500	EUR	-20.825,00	0,00
Schneider Electric SE 29,89 %	17.06.2022	2.500	EUR	-155.650,00	-0,02
Schneider Electric SE 28,54 %	17.12.2021	2.500	EUR	-168.175,00	-0,02
Schneider Electric SE 26,43 %	17.06.2022	2.000	EUR	-43.220,00	0,00
Schneider Electric SE 26,37 %	17.06.2022	3.300	EUR	-67.584,00	-0,01
Schneider Electric SE 27,46 %	17.06.2022	1.600	EUR	-50.592,00	-0,01
Schneider Electric SE 25,70 %	16.12.2022	1.500	EUR	-9.720,00	0,00
Schneider Electric SE 27,18 %	17.06.2022	2.500	EUR	-80.425,00	-0,01
Schneider Electric SE 25,50 %	17.06.2022	2.904	EUR	-42.457,17	0,00
Schneider Electric SE 28,92 %	17.12.2021	1.900	EUR	-129.998,00	-0,01
Sherwin-Williams Co. 29,58 %	21.01.2022	1.536	USD	-91.181,24	-0,01
Skyworks Solutions, Inc. 38,90 %	20.01.2023	1.429	USD	-21.238,06	0,00
Southern Co./The 28,30 %	21.01.2022	1.500	USD	-107.222,36	-0,01
Southern Co./The 26,24 %	21.01.2022	745	USD	-47.631,02	-0,01
Starbucks Corp. 32,08 %	17.06.2022	2.500	USD	-163.588,84	-0,02
Starbucks Corp. 32,03 %	21.01.2022	926	USD	-80.512,57	-0,01
Starbucks Corp. 34,91 %	21.01.2022	1.500	USD	-139.286,62	-0,01
Starbucks Corp. 30,40 %	21.01.2022	1.800	USD	-106.324,31	-0,01
Starbucks Corp. 35,77 %	21.01.2022	3.000	USD	-306.071,34	-0,03
Starbucks Corp. 31,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-147.179,36	-0,02
Starbucks Corp. 31,49 %	21.01.2022	1.500	USD	-106.425,50	-0,01
Starbucks Corp. 31,96 %	21.01.2022	3.000	USD	-204.047,56	-0,02
Starbucks Corp. 31,83 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.980,52	-0,01
Starbucks Corp. 33,60 %	21.01.2022	1.000	USD	-87.208,03	-0,01
Starbucks Corp. 32,43 %	21.01.2022	2.000	USD	-181.549,88	-0,02
Starbucks Corp. 29,10 %	20.01.2023	2.500	USD	-57.635,55	-0,01
Starbucks Corp. 31,61 %	17.06.2022	2.000	USD	-127.734,21	-0,01
Starbucks Corp. 30,10 %	21.01.2022	1.500	USD	-86.655,70	-0,01
Starbucks Corp. 35,60 %	21.01.2022	2.000	USD	-227.911,29	-0,02
Starbucks Corp. 30,40 %	21.01.2022	2.500	USD	-146.787,25	-0,02
Starbucks Corp. 27,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-75.651,40	-0,01
Starbucks Corp. 28,41 %	20.01.2023	2.500	USD	-43.342,61	0,00
Starbucks Corp. 30,20 %	21.01.2022	2.500	USD	-147.208,87	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Starbucks Corp. 32,50 %	21.01.2022	2.000	USD	-157.821,06	-0,02
Starbucks Corp. 34,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-132.532,25	-0,01
Starbucks Corp. 31,46 %	21.01.2022	2.000	USD	-139.236,02	-0,01
Starbucks Corp. 30,62 %	21.01.2022	1.500	USD	-94.523,15	-0,01
Starbucks Corp. 36,24 %	21.01.2022	2.000	USD	-238.805,97	-0,03
Starbucks Corp. 28,57 %	17.06.2022	1.250	USD	-46.915,85	-0,01
Starbucks Corp. 29,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-92.527,20	-0,01
STMicroelectronics NV 37,06 %	17.06.2022	2.000	EUR	-63.980,00	-0,01
Swatch Group AG/The 28,48 %	17.12.2021	2.476	CHF	-117.242,78	-0,01
Swatch Group AG/The 28,11 %	17.12.2021	2.047	CHF	-93.037,55	-0,01
Swatch Group AG/The 29,50 %	17.12.2021	2.151	CHF	-124.630,98	-0,01
Swiss Life Holding AG 22,95 %	17.06.2022	1.209	CHF	-32.084,19	0,00
Swiss Life Holding AG 25,57 %	17.12.2021	2.702	CHF	-180.048,24	-0,02
Swiss Life Holding AG 24,00 %	17.06.2022	3.208	CHF	-124.160,59	-0,01
Swiss Life Holding AG 23,00 %	17.06.2022	1.752	CHF	-47.580,44	-0,01
Swiss Life Holding AG 27,20 %	17.12.2021	2.703	CHF	-137.912,50	-0,01
Swiss Life Holding AG 24,04 %	17.06.2022	2.765	CHF	-108.563,26	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 39,34 %	21.01.2022	4.000	USD	-199.747,03	-0,02
Target Corp. 29,70 %	20.01.2023	1.429	USD	-31.212,60	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,79 %	21.01.2022	3.000	USD	-182.721,98	-0,02
Texas Instruments, Inc. 31,32 %	20.01.2023	2.500	USD	8.179,44	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,45 %	21.01.2022	745	USD	-22.936,25	0,00
Texas Instruments, Inc. 36,13 %	21.01.2022	1.500	USD	-86.035,92	-0,01
Texas Instruments, Inc. 33,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-58.537,82	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,30 %	21.01.2022	2.500	USD	-122.185,68	-0,01
Texas Instruments, Inc. 35,72 %	21.01.2022	2.000	USD	-122.388,06	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,80 %	21.01.2022	1.700	USD	-89.178,68	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,10 %	21.01.2022	1.000	USD	-35.373,98	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,82 %	21.01.2022	3.000	USD	-186.541,87	-0,02
Texas Instruments, Inc. 35,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-90.083,48	-0,01
Texas Instruments, Inc. 35,49 %	21.01.2022	2.500	USD	-138.397,00	-0,01
Texas Instruments, Inc. 32,08 %	20.01.2023	2.500	USD	-7.694,58	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,38 %	21.01.2022	2.000	USD	-117.261,15	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,60 %	21.01.2022	1.800	USD	-123.475,85	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,20 %	17.06.2022	1.800	USD	-28.945,11	0,00
T-Mobile US, Inc. 35,26 %	21.01.2022	3.000	USD	-241.310,40	-0,03
T-Mobile US, Inc. 27,91 %	17.06.2022	2.500	USD	-20.680,50	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,11 %	21.01.2022	1.500	USD	-111.371,11	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-111.763,22	-0,01
T-Mobile US, Inc. 32,40 %	21.01.2022	1.800	USD	-103.592,21	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,46 %	17.06.2022	1.250	USD	-14.472,14	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,09 %	17.06.2022	2.000	USD	-88.186,19	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,98 %	21.01.2022	1.500	USD	-94.042,50	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,32 %	17.06.2022	2.500	USD	-70.452,82	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,82 %	17.06.2022	2.500	USD	-61.662,03	-0,01
TOTAL S.A. 26,15 %	17.06.2022	1.100	EUR	-20.020,00	0,00
Travelers Cos., Inc./The 33,50 %	21.01.2022	1.500	USD	-104.300,53	-0,01
Trip.com Group Ltd. 42,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-42.094,61	0,00
Twitter, Inc. 54,47 %	21.01.2022	4.000	USD	-115.287,97	-0,01
Twitter, Inc. 53,11 %	21.01.2022	1.500	USD	-33.531,50	0,00
Tyson Foods, Inc. 28,41 %	17.06.2022	1.800	USD	-79.655,96	-0,01
U.S. Bancorp 33,55 %	21.01.2022	2.000	USD	-137.431,49	-0,01
UBS Group AG 33,50 %	17.12.2021	2.703	CHF	-195.059,66	-0,02
UBS Group AG 31,00 %	17.06.2022	3.208	CHF	-196.819,25	-0,02
UBS Group AG 29,64 %	17.12.2021	2.709	CHF	-167.461,09	-0,02
UniCredit SpA 39,95 %	16.12.2021	3.000	EUR	-73.140,00	-0,01
UniCredit SpA 40,50 %	17.12.2021	2.000	EUR	-126.020,00	-0,01
Union Pacific Corp. 28,77 %	17.06.2022	2.000	USD	-75.976,05	-0,01
Union Pacific Corp. 34,93 %	21.01.2022	1.700	USD	-150.848,30	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Union Pacific Corp. 30,64 %	17.06.2022	2.500	USD	-132.557,55	-0,01
Union Pacific Corp. 34,52 %	21.01.2022	1.400	USD	-141.204,15	-0,01
Union Pacific Corp. 33,60 %	21.01.2022	1.500	USD	-142.840,88	-0,02
Union Pacific Corp. 32,80 %	21.01.2022	2.500	USD	-198.562,27	-0,02
Union Pacific Corp. 36,00 %	21.01.2022	1.000	USD	-108.491,44	-0,01
Union Pacific Corp. 28,91 %	17.06.2022	2.500	USD	-96.867,36	-0,01
Union Pacific Corp. 32,75 %	21.01.2022	926	USD	-82.316,31	-0,01
Union Pacific Corp. 31,01 %	17.06.2022	2.500	USD	-136.415,38	-0,01
Union Pacific Corp. 35,67 %	21.01.2022	4.000	USD	-376.355,51	-0,04
UnitedHealth Group, Inc. 28,13 %	20.01.2023	2.500	USD	-36.786,41	0,00
Vale S.A. 45,20 %	21.01.2022	1.500	USD	-97.331,14	-0,01
Verizon Communications, Inc. 20,20 %	21.01.2022	1.800	USD	-64.174,05	-0,01
Verizon Communications, Inc. 23,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-105.223,88	-0,01
Verizon Communications, Inc. 19,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-65.203,64	-0,01
Verizon Communications, Inc. 20,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-62.775,11	-0,01
Verizon Communications, Inc. 21,70 %	21.01.2022	1.800	USD	-87.412,10	-0,01
Verizon Communications, Inc. 20,31 %	17.06.2022	2.500	USD	-76.229,02	-0,01
Verizon Communications, Inc. 21,09 %	21.01.2022	2.000	USD	-92.587,91	-0,01
Verizon Communications, Inc. 21,69 %	21.01.2022	1.500	USD	-77.384,27	-0,01
Verizon Communications, Inc. 24,37 %	21.01.2022	3.000	USD	-226.587,40	-0,02
Verizon Communications, Inc. 20,99 %	21.01.2022	1.500	USD	-66.253,48	-0,01
Verizon Communications, Inc. 20,00 %	21.01.2022	1.864	USD	-86.511,99	-0,01
Verizon Communications, Inc. 23,79 %	21.01.2022	1.700	USD	-119.239,39	-0,01
Verizon Communications, Inc. 23,67 %	21.01.2022	4.000	USD	-270.039,63	-0,03
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 39,64 %	21.01.2022	745	USD	-71.132,52	-0,01
Visa, Inc. 32,10 %	21.01.2022	2.500	USD	-201.344,97	-0,02
Visa, Inc. 30,00 %	21.01.2022	1.852	USD	-124.655,69	-0,01
Vivendi SE 25,42 %	17.06.2022	1.600	EUR	-17.760,00	0,00
VMware, Inc. 31,03 %	20.01.2023	2.500	USD	-28.986,42	0,00
VMware, Inc. 38,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-170.941,90	-0,02
VMware, Inc. 37,70 %	21.01.2022	2.500	USD	-204.211,99	-0,02
VMware, Inc. 31,80 %	20.01.2023	1.429	USD	-26.225,33	0,00
VMware, Inc. 36,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-106.589,93	-0,01
VMware, Inc. 37,80 %	21.01.2022	1.800	USD	-149.931,70	-0,02
VMware, Inc. 38,60 %	21.01.2022	3.000	USD	-236.605,11	-0,02
VMware, Inc. 38,67 %	21.01.2022	1.500	USD	-134.416,90	-0,01
VMware, Inc. 32,90 %	17.06.2022	2.500	USD	-113.247,32	-0,01
VMware, Inc. 29,91 %	20.01.2023	2.500	USD	-6.598,36	0,00
VMware, Inc. 34,73 %	17.06.2022	2.000	USD	-118.812,72	-0,01
VMware, Inc. 34,40 %	17.06.2022	2.000	USD	-120.128,17	-0,01
VMware, Inc. 38,45 %	21.01.2022	1.800	USD	-157.080,70	-0,02
VMware, Inc. 37,75 %	21.01.2022	1.500	USD	-108.841,39	-0,01
VMware, Inc. 37,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-149.135,68	-0,02
VMware, Inc. 42,08 %	21.01.2022	2.500	USD	-323.362,00	-0,03
Vonovia SE 24,80 %	17.12.2021	2.500	EUR	-43.775,00	0,00
Walt Disney Co./The 35,46 %	21.01.2022	3.000	USD	-134.125,98	-0,01
Waste Management, Inc. 23,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-71.249,68	-0,01
Waste Management, Inc. 25,23 %	21.01.2022	2.000	USD	-119.925,79	-0,01
Waste Management, Inc. 27,80 %	21.01.2022	1.500	USD	-111.130,79	-0,01
Waste Management, Inc. 24,82 %	21.01.2022	2.000	USD	-115.068,72	-0,01
Waste Management, Inc. 24,40 %	21.01.2022	1.800	USD	-92.360,24	-0,01
Waste Management, Inc. 27,63 %	21.01.2022	1.500	USD	-110.118,90	-0,01
Waste Management, Inc. 22,60 %	21.01.2022	1.864	USD	-76.735,38	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 38,15 %	21.01.2022	1.700	USD	-187.560,50	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 35,90 %	21.01.2022	1.500	USD	-145.269,42	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 36,56 %	21.01.2022	1.500	USD	-154.174,05	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 34,80 %	21.01.2022	2.000	USD	-171.869,47	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 38,70 %	21.01.2022	1.500	USD	-176.144,70	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 35,89 %	21.01.2022	2.000	USD	-204.351,13	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Yum China Holdings, Inc. 38,15 %	21.01.2022	1.400	USD	-169.725,95	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 36,20 %	21.01.2022	2.000	USD	-209.562,36	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 36,98 %	21.01.2022	1.500	USD	-152.504,43	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 35,40 %	21.01.2022	1.500	USD	-131.887,17	-0,02
Yum China Holdings, Inc. 31,52 %	17.06.2022	1.800	USD	-61.320,52	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 32,72 %	17.06.2022	2.000	USD	-89.063,16	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 35,36 %	21.01.2022	1.500	USD	-135.428,79	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 35,44 %	21.01.2022	1.500	USD	-141.095,37	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 31,38 %	17.06.2022	1.250	USD	-43.901,26	0,00
Yum! Brands, Inc. 29,70 %	21.01.2022	1.000	USD	-85.707,06	-0,01
Yum! Brands, Inc. 27,31 %	17.06.2022	2.000	USD	-111.223,54	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,50 %	21.01.2022	1.800	USD	-185.464,21	-0,02
Zoetis, Inc. 30,49 %	21.01.2022	2.000	USD	-122.388,06	-0,02
Zurich Insurance Group AG 24,22 %	17.12.2021	2.702	CHF	-180.935,55	-0,02
Zurich Insurance Group AG 21,35 %	17.06.2022	1.752	CHF	-41.858,64	0,00
Zurich Insurance Group AG 23,98 %	17.06.2022	2.769	CHF	-143.629,36	-0,02
Zurich Insurance Group AG 21,40 %	16.12.2022	1.653	CHF	-28.289,23	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,34 %	16.12.2022	2.753	CHF	-71.311,76	-0,01
Zurich Insurance Group AG 22,95 %	17.06.2022	2.765	CHF	-114.516,08	-0,01
Zurich Insurance Group AG 20,85 %	17.06.2022	1.209	CHF	-23.021,23	0,00
Zurich Insurance Group AG 26,80 %	17.12.2021	2.703	CHF	-196.341,65	-0,02
				-9.141.720,34	**-0,95**
Summe Volatility Swaps				**-9.141.720,34**	**-0,95**

Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Deutschland				
Allianz SE	-7.672.174	EUR	83.084,14	0,01
Bayer AG	5.315.553	EUR	49.584,64	0,01
Bayerische Motoren Werke AG	-4.545.814	EUR	50.127,87	0,01
			182.796,65	**0,03**
Frankreich				
AXA S.A.	3.133.240	EUR	459.787,13	0,05
BNP Paribas S.A.	-6.716.627	EUR	-339.883,71	-0,04
Schneider Electric SE	2.339.925	EUR	33.460,19	0,00
			153.363,61	**0,01**
Schweiz				
Credit Suisse Group AG	-9.760.740	CHF	-171.712,20	-0,02
Swiss Life Holding AG	-4.334.831	CHF	-141.191,37	-0,01
UBS Group AG	-6.237.631	CHF	106.673,02	0,01
Zurich Insurance Group AG	-3.456.762	CHF	-34.247,39	0,00
			-240.477,94	**-0,02**
Vereinigte Staaten				
Amazon.com, Inc.	34.177.206	USD	-633.660,94	-0,07
American Express Co.	-11.356.227	USD	311.754,15	0,03
Apple, Inc.	8.671.808	USD	-161.265,64	-0,02
Bank of America Corp.	-8.124.348	USD	56.262,49	0,01
Caterpillar, Inc.	-14.746.178	USD	-283.817,16	-0,03
Chevron Corp.	10.943.996	USD	130.829,39	0,01
Citigroup, Inc.	-35.696.693	USD	-603.351,53	-0,06
Facebook, Inc.	-1.814.707	USD	34.468,18	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	-6.481.889	USD	282.804,37	0,03
Home Depot, Inc./The	18.805.147	USD	-285.805,69	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	-30.144.126	USD	596.515,26	0,06
MetLife, Inc.	-1.496.801	USD	2.046,03	0,00
Netflix, Inc.	15.496.832	USD	-550.053,18	-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 2021 (FORTSETZUNG)

Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Oracle Corp.	4.324.150	USD	73.515,70	0,01
Starbucks Corp.	10.771.642	USD	-14.379,55	0,00
			-1.044.138,12	**-0,12**
Summe Differenzkontrakte			**-948.455,80**	**-0,10**

Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder, Optionen, Volatility Swaps und Differenzkontrakte (Anschaffungskosten EUR 686.360.972,65)	**606.367.221,18**	**63,36**
Bankguthaben	**352.473.665,81**	**36,83**
Sonstige Vermögenswerte	**45.028.810,94**	**4,70**
Sonstige Verbindlichkeiten	**-46.834.301,73**	**-4,89**
Summe Nettoteilfondsvermögen	**957.035.396,20**	**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 2021 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	145.395.373,80
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	2.707.930,46
Tagesgelder (Erl. 2)	420.297.242,60
Optionen (Erl. 2)	50.764.780,92
Bankguthaben (Erl. 2) *	352.473.665,81
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	38.657.444,51
Forderungen aus Tagesgeldern	748,04
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	648.915,01
Zinsforderungen	506.411,49
Forderungen aus Differenzkontrakten	2.444.331,59
Sonstige Forderungen	63.029,84
Summe Aktiva	**1.013.959.874,07**
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	41.633.436,56
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	2.326.333,41
Unrealisierte Verluste aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	2.065.918,04
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	9.141.720,34
Unrealisierte Verluste aus Differerenzkontrakten	948.455,80
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	586.949,01
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	180.826,14
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	40.672,28
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	36,29
Sonstige Verbindlichkeiten	130,00
Summe Passiva	**56.924.477,87**
Summe Nettoteilfondsvermögen	**957.035.396,20**
Nettoinventarwert pro Anteil	
Anteilklasse I	1.070,75
Anteilklasse I2 SPEZ	918,03
Anteilklasse I GBP	1.125,67
Anteilklasse P	49,60
Anteilklasse R	49,08
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	
Anteilklasse I	633.408,57
Anteilklasse I2 SPEZ	92.710,00
Anteilklasse I GBP	25.038,27
Anteilklasse P	200.868,51
Anteilklasse R	3.169.741,00

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

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2021 IN EUR (FORTSETZUNG)

Anteilklassen	I	I2 SPEZ	I GBP	P	R
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	544.637,21	46.610,00	8.077,28	147.019,51	961.869,00
Zeichnungen	171.675,14	46.100,00	17.351,85	66.837,00	2.313.175,00
Rücknahmen	82.903,78	0,00	390,86	12.988,00	105.303,00
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	633.408,57	92.710,00	25.038,27	200.868,51	3.169.741,00

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS FÜR DIE AM 30. JUNI 2021 ENDENDE GESCHÄFTSPERIODE IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	**744.448.860,17**
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	203.156,71
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.165.865,87
Summe Erträge	**2.369.022,58**
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	500.144,27
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	303.801,42
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	408.099,30
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	2.927.486,00
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	506.389,20
Performance Fee (Erl. 3)	26,65
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	63.747,72
Aufwendungen aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	3.634.113,37
Transaktionskosten (Erl. 10)	10.675,37
Sonstige Zinsaufwendungen*	1.152.134,28
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	290.952,31
Summe Aufwendungen	**9.797.569,89**
Nettogewinn/(-verlust)	**-7.428.547,31**
Realisierte Nettogewinne	905.516.656,32
Realisierte Nettoverluste	-877.254.801,81
Realisierter Nettogewinn	**20.833.307,20**

Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-234.703.817,26
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	155.186.170,16
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	**-58.684.339,90**
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	372.680.960,78
Rücknahme von Anteilen	-101.410.084,85
Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	**957.035.396,20**

* Die Position beinhaltet Zinsen aus Overnight Deposits.
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
	Deutschland				
DE0001135473	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 04.07.2022	2.500.000	EUR	2.561.501,25	3,43
DE0001102333	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 15.02.2024	5.200.000	EUR	5.538.072,80	7,42
DE0001102325	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2 %, 15.08.2023	5.200.000	EUR	5.501.256,80	7,37
DE0001104834	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.03.2023	7.500.000	EUR	7.585.381,43	10,16
DE0001104800	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.06.2022	2.500.000	EUR	2.515.508,00	3,37
DE0001104784	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.12.2021	10.000.000	EUR	10.029.130,00	13,43
DE0001104826	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.12.2022	2.500.000	EUR	2.524.950,00	3,38
DE0001104842	Bundesschatzanweisungen 0 %, 16.06.2023	5.400.000	EUR	5.470.896,60	7,33
				41.726.696,88	**55,89**
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				**41.726.696,88**	**55,89**
Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.				**41.726.696,88**	**55,89**

Tagesgelder				
Kontrahent	**Zinssatz**	**Währung**	**Nominale (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
	Deutschland			
Bayerische Landesbank	(0,62) %	EUR	10.000.000,00	13,40
DekaBank	(0,70) %	EUR	10.000.000,00	13,40
DZ Bank AG	(0,65) %	EUR	10.000.000,00	13,39
Landesbank Baden Württemberg	(0,70) %	EUR	10.000.000,00	13,39
			40.000.000,00	**53,58**
Summe Tagesgelder			**40.000.000,00**	**53,58**

Volatility Swaps	**Fälligkeit**	**Nennbetrag (000)**	**Währung**	**Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)**	**Nettoteilfonds-vermögen (%)**
Abbott Laboratories 33,47 %	21.01.2022	130	USD	-10.581,75	-0,01
Abbott Laboratories 30,9 %	21.01.2022	130	USD	-7.186,77	-0,01
Abbott Laboratories 30,95 %	21.01.2022	120	USD	-7.576,02	-0,01
Abbott Laboratories 28,6 %	21.01.2022	130	USD	-4.965,84	-0,01
Abbott Laboratories 34,9 %	21.01.2022	120	USD	-10.703,77	-0,01
Abbott Laboratories 29,34 %	21.01.2022	190	USD	-7.262,59	-0,01
Abbott Laboratories 34,29 %	21.01.2022	120	USD	-10.440,68	-0,01
Abbott Laboratories 28,55 %	17.06.2022	140	USD	-4.074,04	-0,01
AbbVie, Inc. 30,10 %	21.01.2022	130	USD	-6.977,40	-0,01
AbbVie, Inc. 27,63 %	21.01.2022	180	USD	-6.575,26	-0,01
AbbVie, Inc. 28,44 %	17.06.2022	140	USD	-4.083,48	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
AbbVie, Inc. 33,65 %	21.01.2022	120	USD	-10.496,33	-0,01
AbbVie, Inc. 29,60 %	21.01.2022	110	USD	-6.478,12	-0,01
AbbVie, Inc. 30,15 %	21.01.2022	120	USD	-6.463,95	-0,01
AbbVie, Inc. 29,90 %	21.01.2022	120	USD	-6.553,00	-0,01
AbbVie, Inc. 32,81 %	21.01.2022	110	USD	-8.671,81	-0,01
Accenture PLC 31,20 %	21.01.2022	100	USD	-9.358,29	-0,01
Accenture PLC 32,15 %	21.01.2022	90	USD	-8.530,99	-0,01
Accenture PLC 34,35 %	21.01.2022	100	USD	-11.931,86	-0,02
Accenture PLC 29,80 %	21.01.2022	100	USD	-7.107,68	-0,01
Accenture PLC 32,31 %	21.01.2022	100	USD	-10.459,56	-0,01
Accenture PLC 28,13 %	17.06.2022	120	USD	-5.948,90	-0,01
Activision Blizzard, Inc. 33,79 %	21.01.2022	70	USD	-3.057,00	0,00
Activision Blizzard, Inc. 32,67 %	21.01.2022	70	USD	-2.417,15	0,00
Adobe, Inc. 31,53 %	21.01.2022	240	USD	-8.198,33	-0,01
Adobe, Inc. 34,40 %	21.01.2022	130	USD	-7.948,64	-0,01
Adobe, Inc. 33,49 %	21.01.2022	250	USD	-12.294,46	-0,02
Adobe, Inc. 38,60 %	21.01.2022	160	USD	-14.295,98	-0,02
Adobe, Inc. 36,88 %	21.01.2022	120	USD	-9.800,15	-0,01
Adobe, Inc. 32,53 %	21.01.2022	260	USD	-11.457,63	-0,02
Adobe, Inc. 38,36 %	21.01.2022	310	USD	-27.071,09	-0,04
Adobe, Inc. 38,44 %	21.01.2022	140	USD	-12.426,34	-0,02
Adobe, Inc. 34,15 %	21.01.2022	200	USD	-10.879,50	-0,01
Adobe, Inc. 38,25 %	21.01.2022	150	USD	-13.267,14	-0,02
Adobe, Inc. 39,30 %	21.01.2022	260	USD	-25.975,88	-0,03
Adobe, Inc. 37,00 %	21.01.2022	130	USD	-9.703,68	-0,01
Adobe, Inc. 34,26 %	17.06.2022	160	USD	-5.906,74	-0,01
Adobe, Inc. 39,36 %	21.01.2022	250	USD	-24.782,87	-0,03
Adobe, Inc. 37,66 %	21.01.2022	260	USD	-21.145,97	-0,03
Advanced Micro Devices, Inc. 45,46 %	21.01.2022	100	USD	-6.343,70	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 53,56 %	21.01.2022	110	USD	-13.537,82	-0,02
Advanced Micro Devices, Inc. 54,92 %	21.01.2022	120	USD	-15.551,73	-0,02
Advanced Micro Devices, Inc. 53,54 %	21.01.2022	110	USD	-13.602,75	-0,02
Advanced Micro Devices, Inc. 41,82 %	21.01.2022	100	USD	-3.624,25	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 45,77 %	21.01.2022	100	USD	-7.057,93	-0,01
Alphabet, Inc. 33,51 %	21.01.2022	350	USD	-26.529,64	-0,04
Alphabet, Inc. 33,66 %	21.01.2022	360	USD	-27.697,44	-0,04
Alphabet, Inc. 34,70 %	21.01.2022	340	USD	-22.838,69	-0,03
Alphabet, Inc. 31,28 %	21.01.2022	610	USD	-35.471,46	-0,05
Alphabet, Inc. 31,45 %	21.01.2022	590	USD	-34.975,13	-0,05
Alphabet, Inc. 34,00 %	21.01.2022	350	USD	-20.795,18	-0,03
Alphabet, Inc. 33,90 %	21.01.2022	460	USD	-26.946,79	-0,04
Alphabet, Inc. 34,64 %	21.01.2022	370	USD	-29.571,30	-0,04
Alphabet, Inc. 33,29 %	21.01.2022	430	USD	-23.670,12	-0,03
Alphabet, Inc. 33,28 %	21.01.2022	390	USD	-20.748,04	-0,03
Alphabet, Inc. 30,96 %	17.06.2022	460	USD	-16.446,58	-0,02
Alphabet, Inc. 33,20 %	21.01.2022	530	USD	-32.656,29	-0,04
Alphabet, Inc. 33,20 %	21.01.2022	550	USD	-32.590,02	-0,04
Alphabet, Inc. 32,85 %	21.01.2022	300	USD	-15.438,91	-0,02
Alphabet, Inc. 30,95 %	17.06.2022	450	USD	-17.018,72	-0,02
Alphabet, Inc. 32,60 %	21.01.2022	310	USD	-14.824,27	-0,02
Alphabet, Inc. 34,80 %	21.01.2022	380	USD	-30.402,56	-0,04
Alphabet, Inc. 31,20 %	21.01.2022	530	USD	-29.380,38	-0,04
Alphabet, Inc. 33,91 %	21.01.2022	500	USD	-30.251,29	-0,04
Alphabet, Inc. 33,00 %	21.01.2022	510	USD	-29.832,78	-0,04
Alphabet, Inc. 31,95 %	21.01.2022	340	USD	-16.823,68	-0,02
Alphabet, Inc. 31,30 %	21.01.2022	350	USD	-14.677,04	-0,02
Alphabet, Inc. 30,59 %	21.01.2022	470	USD	-23.597,10	-0,03
Alphabet, Inc. 30,80 %	21.01.2022	450	USD	-23.078,68	-0,03
Alphabet, Inc. 30,73 %	21.01.2022	510	USD	-25.837,59	-0,03

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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Alphabet, Inc. 31,40 %	21.01.2022	360	USD	-20.575,76	-0,03
Alphabet, Inc. 32,97 %	21.01.2022	530	USD	-29.554,68	-0,04
Alphabet, Inc. 31,40 %	21.01.2022	340	USD	-19.303,65	-0,03
Alphabet, Inc. 31,11 %	21.01.2022	470	USD	-25.816,51	-0,03
Alphabet, Inc. 30,82 %	21.01.2022	490	USD	-24.845,02	-0,03
Amazon.com, Inc. 35,85 %	21.01.2022	780	USD	-59.425,75	-0,08
Amazon.com, Inc. 38,80 %	21.01.2022	1.400	USD	-152.041,49	-0,20
Amazon.com, Inc. 33,22 %	21.01.2022	1.100	USD	-59.651,74	-0,08
Amazon.com, Inc. 35,75 %	21.01.2022	880	USD	-70.569,19	-0,09
Amazon.com, Inc. 32,43 %	21.01.2022	1.170	USD	-56.285,10	-0,08
Amazon.com, Inc. 35,03 %	21.01.2022	800	USD	-57.745,18	-0,08
Amazon.com, Inc. 32,00 %	17.06.2022	920	USD	-23.622,57	-0,03
Amazon.com, Inc. 37,07 %	21.01.2022	1.190	USD	-104.239,14	-0,14
Amazon.com, Inc. 33,20 %	21.01.2022	780	USD	-45.310,91	-0,06
Amazon.com, Inc. 32,44 %	21.01.2022	1.200	USD	-57.323,55	-0,08
Amazon.com, Inc. 37,00 %	21.01.2022	920	USD	-80.378,79	-0,11
Amazon.com, Inc. 34,68 %	21.01.2022	760	USD	-53.069,91	-0,07
Amazon.com, Inc. 37,26 %	21.01.2022	1.410	USD	-126.292,43	-0,17
Amazon.com, Inc. 38,41 %	21.01.2022	1.360	USD	-140.449,62	-0,19
Amazon.com, Inc. 32,64 %	21.01.2022	1.170	USD	-56.847,46	-0,08
Amgen, Inc. 33,20 %	21.01.2022	80	USD	-7.728,81	-0,01
Amgen, Inc. 30,15 %	21.01.2022	150	USD	-9.009,61	-0,01
Amgen, Inc. 30,85 %	21.01.2022	80	USD	-5.984,31	-0,01
Amgen, Inc. 27,70 %	21.01.2022	80	USD	-3.479,55	0,00
Amgen, Inc. 33,68 %	21.01.2022	160	USD	-16.138,97	-0,02
Amgen, Inc. 31,87 %	21.01.2022	150	USD	-11.362,25	-0,02
Amgen, Inc. 27,84 %	21.01.2022	140	USD	-8.027,66	-0,01
Amgen, Inc. 33,86 %	21.01.2022	150	USD	-15.346,57	-0,02
Amgen, Inc. 32,15 %	21.01.2022	160	USD	-13.663,21	-0,02
Analog Devices, Inc. 31,44 %	21.01.2022	60	USD	-2.274,73	0,00
Analog Devices, Inc. 31,67 %	21.01.2022	60	USD	-2.422,97	0,00
Apple, Inc. 32,37 %	17.06.2022	1.340	USD	-41.751,41	-0,06
Apple, Inc. 33,38 %	21.01.2022	1.760	USD	-111.946,03	-0,15
Apple, Inc. 41,10 %	21.01.2022	1.410	USD	-158.929,67	-0,21
Apple, Inc. 31,98 %	21.01.2022	1.480	USD	-75.965,59	-0,10
Apple, Inc. 39,60 %	21.01.2022	1.200	USD	-118.886,92	-0,16
Apple, Inc. 32,99 %	21.01.2022	1.460	USD	-86.290,07	-0,12
Apple, Inc. 33,82 %	21.01.2022	1.540	USD	-103.380,90	-0,14
Apple, Inc. 40,16 %	21.01.2022	1.630	USD	-170.257,27	-0,23
Apple, Inc. 34,90 %	21.01.2022	1.140	USD	-88.016,19	-0,12
Apple, Inc. 38,95 %	21.01.2022	1.220	USD	-126.269,33	-0,17
Apple, Inc. 40,67 %	21.01.2022	1.940	USD	-211.733,02	-0,28
Apple, Inc. 37,32 %	21.01.2022	1.820	USD	-141.806,22	-0,19
Apple, Inc. 37,64 %	21.01.2022	1.110	USD	-108.865,93	-0,15
Apple, Inc. 37,55 %	21.01.2022	1.770	USD	-141.343,28	-0,19
Apple, Inc. 37,50 %	21.01.2022	1.210	USD	-96.257,19	-0,13
Applied Materials, Inc. 44,37 %	21.01.2022	130	USD	-6.917,10	-0,01
Applied Materials, Inc. 46,42 %	21.01.2022	100	USD	-1.398,94	0,00
Applied Materials, Inc. 42,22 %	21.01.2022	120	USD	-4.222,62	-0,01
Applied Materials, Inc. 43,21 %	21.01.2022	80	USD	33,73	0,00
Applied Materials, Inc. 43,09 %	21.01.2022	120	USD	-5.427,78	-0,01
Applied Materials, Inc. 42,07 %	21.01.2022	80	USD	820,98	0,00
AT&T, Inc. 24,70 %	21.01.2022	120	USD	-3.992,92	-0,01
AT&T, Inc. 29,00 %	21.01.2022	140	USD	-9.907,08	-0,01
AT&T, Inc. 25,55 %	21.01.2022	130	USD	-5.112,74	-0,01
AT&T, Inc. 27,95 %	21.01.2022	120	USD	-7.384,77	-0,01
AT&T, Inc. 23,24 %	21.01.2022	200	USD	-3.836,74	-0,01
AT&T, Inc. 29,65 %	21.01.2022	120	USD	-8.938,02	-0,01
AT&T, Inc. 27,44 %	21.01.2022	120	USD	-6.937,52	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
AT&T, Inc. 24,64 %	17.06.2022	150	USD	-3.931,19	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 33,67 %	21.01.2022	80	USD	-7.988,53	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 27,07 %	21.01.2022	80	USD	-3.338,56	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 27,12 %	21.01.2022	90	USD	-3.941,82	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 31,16 %	21.01.2022	80	USD	-6.328,35	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 25,79 %	21.01.2022	80	USD	-3.012,05	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 32,95 %	21.01.2022	80	USD	-7.293,02	-0,01
Baidu, Inc. 40,74 %	21.01.2022	60	USD	-1.726,29	0,00
Baidu, Inc. 42,61 %	21.01.2022	60	USD	-2.771,06	0,00
Bank of America Corp. 36,70 %	21.01.2022	150	USD	-11.922,59	-0,02
Bank of America Corp. 35,60 %	21.01.2022	150	USD	-10.552,74	-0,01
Bank of America Corp. 32,55 %	17.06.2022	210	USD	-8.232,48	-0,01
Bank of America Corp. 35,24 %	21.01.2022	160	USD	-11.445,15	-0,02
Bank of America Corp. 34,17 %	21.01.2022	280	USD	-16.383,51	-0,02
Bank of America Corp. 38,27 %	21.01.2022	160	USD	-15.530,49	-0,02
Bank of America Corp. 35,70 %	21.01.2022	140	USD	-9.724,09	-0,01
Bank of America Corp. 35,00 %	21.01.2022	170	USD	-11.809,26	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 22,52 %	21.01.2022	490	USD	-22.890,64	-0,03
Berkshire Hathaway, Inc. 24,70 %	21.01.2022	280	USD	-17.453,08	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 24,02 %	21.01.2022	290	USD	-16.846,36	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 23,23 %	17.06.2022	370	USD	-13.958,85	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 26,20 %	21.01.2022	300	USD	-21.239,57	-0,03
Berkshire Hathaway, Inc. 27,50 %	21.01.2022	300	USD	-25.277,01	-0,03
Berkshire Hathaway, Inc. 25,45 %	21.01.2022	270	USD	-16.991,40	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 27,08 %	21.01.2022	300	USD	-23.736,41	-0,03
Booking Holdings, Inc. 39,86 %	21.01.2022	110	USD	-6.480,90	-0,01
Booking Holdings, Inc. 35,59 %	21.01.2022	110	USD	-5.528,29	-0,01
Booking Holdings, Inc. 34,51 %	21.01.2022	100	USD	-3.977,57	-0,01
Booking Holdings, Inc. 34,22 %	21.01.2022	100	USD	-3.878,07	-0,01
Booking Holdings, Inc. 39,94 %	21.01.2022	100	USD	-6.594,15	-0,01
Booking Holdings, Inc. 40,51 %	21.01.2022	90	USD	-6.290,67	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 29,55 %	21.01.2022	90	USD	-6.975,21	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 27,20 %	21.01.2022	80	USD	-4.886,75	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 28,15 %	21.01.2022	90	USD	-6.076,65	-0,01
Broadcom, Inc. 37,03 %	17.06.2022	120	USD	-7.981,79	-0,01
Broadcom, Inc. 39,94 %	21.01.2022	170	USD	-13.318,74	-0,02
Broadcom, Inc. 38,00 %	21.01.2022	100	USD	-7.484,61	-0,01
Broadcom, Inc. 38,20 %	21.01.2022	110	USD	-6.170,17	-0,01
Broadcom, Inc. 38,59 %	21.01.2022	230	USD	-14.113,42	-0,02
Broadcom, Inc. 39,77 %	21.01.2022	170	USD	-12.814,15	-0,02
Broadcom, Inc. 38,30 %	21.01.2022	100	USD	-6.156,50	-0,01
Broadcom, Inc. 38,15 %	21.01.2022	200	USD	-16.436,46	-0,02
Broadcom, Inc. 38,06 %	21.01.2022	200	USD	-11.285,94	-0,02
Broadcom, Inc. 42,68 %	21.01.2022	120	USD	-12.037,44	-0,02
Broadcom, Inc. 36,19 %	21.01.2022	190	USD	-12.206,85	-0,02
Broadcom, Inc. 34,89 %	21.01.2022	190	USD	-10.265,03	-0,01
Broadcom, Inc. 38,00 %	21.01.2022	110	USD	-8.545,67	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,86 %	21.01.2022	150	USD	-5.235,26	-0,01
Charter Communications Operating LLC 30,99 %	21.01.2022	150	USD	-6.779,66	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,38 %	21.01.2022	130	USD	-5.617,00	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,54 %	21.01.2022	130	USD	-6.031,36	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,68 %	21.01.2022	140	USD	-4.342,02	-0,01
Charter Communications Operating LLC 29,06 %	21.01.2022	130	USD	-5.102,87	-0,01
Chevron Corp. 30,61 %	17.06.2022	140	USD	-4.020,91	-0,01
Chevron Corp. 31,36 %	21.01.2022	190	USD	-7.268,99	-0,01
Chevron Corp. 35,90 %	21.01.2022	100	USD	-7.407,03	-0,01
Chevron Corp. 34,87 %	21.01.2022	120	USD	-8.366,30	-0,01
Chevron Corp. 37,45 %	21.01.2022	110	USD	-9.207,95	-0,01
Chevron Corp. 36,71 %	21.01.2022	120	USD	-10.133,06	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Chevron Corp. 34,50 %	21.01.2022	120	USD	-8.220,59	-0,01
Cisco Systems, Inc. 31,03 %	21.01.2022	120	USD	-9.087,78	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,60 %	21.01.2022	120	USD	-8.656,72	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,95 %	21.01.2022	120	USD	-10.674,42	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,65 %	21.01.2022	190	USD	-18.114,01	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,10 %	21.01.2022	110	USD	-7.256,35	-0,01
Cisco Systems, Inc. 28,19 %	21.01.2022	230	USD	-12.075,05	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,75 %	21.01.2022	220	USD	-16.067,29	-0,02
Cisco Systems, Inc. 29,45 %	21.01.2022	120	USD	-8.187,20	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,99 %	21.01.2022	250	USD	-18.838,02	-0,03
Cisco Systems, Inc. 29,70 %	21.01.2022	120	USD	-7.674,17	-0,01
Cisco Systems, Inc. 28,43 %	21.01.2022	220	USD	-11.212,41	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,40 %	21.01.2022	200	USD	-18.750,31	-0,03
Cisco Systems, Inc. 28,33 %	21.01.2022	220	USD	-11.486,97	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,29 %	21.01.2022	200	USD	-13.704,36	-0,02
Cisco Systems, Inc. 29,19 %	17.06.2022	150	USD	-7.533,52	-0,01
Citigroup, Inc. 41,44 %	21.01.2022	90	USD	-10.548,19	-0,01
Citigroup, Inc. 33,63 %	17.06.2022	110	USD	-4.904,04	-0,01
Citigroup, Inc. 39,26 %	21.01.2022	90	USD	-9.162,41	-0,01
Citigroup, Inc. 36,80 %	21.01.2022	90	USD	-7.114,85	-0,01
Coca-Cola Co./The 23,45 %	21.01.2022	130	USD	-6.416,14	-0,01
Coca-Cola Co./The 26,35 %	21.01.2022	110	USD	-8.829,50	-0,01
Coca-Cola Co./The 25,15 %	21.01.2022	110	USD	-8.027,16	-0,01
Coca-Cola Co./The 24,00 %	21.01.2022	120	USD	-7.449,53	-0,01
Coca-Cola Co./The 23,43 %	17.06.2022	140	USD	-5.677,21	-0,01
Coca-Cola Co./The 26,80 %	21.01.2022	140	USD	-11.553,93	-0,02
Coca-Cola Co./The 26,98 %	21.01.2022	120	USD	-10.373,89	-0,01
Coca-Cola Co./The 23,15 %	21.01.2022	190	USD	-9.648,20	-0,01
Comcast Corp. 28,96 %	17.06.2022	180	USD	-3.671,65	0,00
Comcast Corp. 32,75 %	21.01.2022	130	USD	-7.816,00	-0,01
Comcast Corp. 33,49 %	21.01.2022	150	USD	-11.328,10	-0,02
Comcast Corp. 32,45 %	21.01.2022	250	USD	-14.415,22	-0,02
Comcast Corp. 30,30 %	21.01.2022	150	USD	-7.380,47	-0,01
Comcast Corp. 31,90 %	21.01.2022	150	USD	-8.556,79	-0,01
Comcast Corp. 31,16 %	21.01.2022	150	USD	-8.465,72	-0,01
Comcast Corp. 33,07 %	21.01.2022	300	USD	-18.823,68	-0,03
Comcast Corp. 28,82 %	21.01.2022	250	USD	-8.008,69	-0,01
Comcast Corp. 31,62 %	21.01.2022	270	USD	-13.712,87	-0,02
Comcast Corp. 29,52 %	21.01.2022	260	USD	-10.278,10	-0,01
Comcast Corp. 29,63 %	21.01.2022	230	USD	-9.055,32	-0,01
Comcast Corp. 31,40 %	21.01.2022	250	USD	-12.431,49	-0,02
Comcast Corp. 27,61 %	21.01.2022	260	USD	-6.257,19	-0,01
Comcast Corp. 32,70 %	21.01.2022	150	USD	-8.947,63	-0,01
Costco Wholesale Corp. 28,06 %	21.01.2022	190	USD	-15.199,68	-0,02
Costco Wholesale Corp. 28,33 %	21.01.2022	220	USD	-17.434,52	-0,02
Costco Wholesale Corp. 28,10 %	21.01.2022	90	USD	-6.966,10	-0,01
Costco Wholesale Corp. 24,15 %	21.01.2022	170	USD	-7.798,30	-0,01
Costco Wholesale Corp. 27,65 %	21.01.2022	190	USD	-13.921,16	-0,02
Costco Wholesale Corp. 23,05 %	21.01.2022	170	USD	-6.205,67	-0,01
Costco Wholesale Corp. 27,58 %	21.01.2022	80	USD	-5.904,71	-0,01
Costco Wholesale Corp. 28,04 %	21.01.2022	190	USD	-15.347,08	-0,02
Costco Wholesale Corp. 23,95 %	21.01.2022	170	USD	-7.623,41	-0,01
Costco Wholesale Corp. 23,60 %	17.06.2022	110	USD	-2.946,88	0,00
Costco Wholesale Corp. 26,10 %	21.01.2022	90	USD	-5.675,19	-0,01
Costco Wholesale Corp. 30,77 %	21.01.2022	90	USD	-8.941,57	-0,01
Costco Wholesale Corp. 26,50 %	21.01.2022	110	USD	-7.279,54	-0,01
CSX Corp. 28,97 %	21.01.2022	80	USD	-4.550,80	-0,01
CSX Corp. 35,78 %	21.01.2022	80	USD	-8.605,11	-0,01
CSX Corp. 29,16 %	21.01.2022	80	USD	-4.880,68	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
CSX Corp. 35,78 %	21.01.2022	80	USD	-8.514,04	-0,01
Danaher Corp. 30,50 %	21.01.2022	80	USD	-3.703,51	0,00
Danaher Corp. 34,36 %	21.01.2022	90	USD	-6.900,08	-0,01
Danaher Corp. 29,71 %	17.06.2022	110	USD	-2.358,80	0,00
Danaher Corp. 36,30 %	21.01.2022	90	USD	-8.250,19	-0,01
Danaher Corp. 32,35 %	21.01.2022	90	USD	-4.648,37	-0,01
Eli Lilly and Co. 40,34 %	21.01.2022	100	USD	-9.037,86	-0,01
Eli Lilly and Co. 27,16 %	17.06.2022	100	USD	2.235,44	0,00
Eli Lilly and Co. 32,30 %	21.01.2022	90	USD	-2.486,22	0,00
Eli Lilly and Co. 30,70 %	21.01.2022	90	USD	-2.008,10	0,00
Eli Lilly and Co. 40,68 %	21.01.2022	90	USD	-9.670,89	-0,01
Exxon Mobil Corp. 33,74 %	21.01.2022	230	USD	-9.319,09	-0,01
Exxon Mobil Corp. 40,18 %	21.01.2022	140	USD	-13.056,75	-0,02
Exxon Mobil Corp. 40,80 %	21.01.2022	120	USD	-10.079,43	-0,01
Exxon Mobil Corp. 37,37 %	21.01.2022	150	USD	-10.752,59	-0,01
Exxon Mobil Corp. 36,40 %	21.01.2022	140	USD	-9.137,37	-0,01
Exxon Mobil Corp. 32,50 %	17.06.2022	170	USD	-5.827,22	-0,01
Exxon Mobil Corp. 38,45 %	21.01.2022	120	USD	-8.275,23	-0,01
Exxon Mobil Corp. 40,00 %	21.01.2022	110	USD	-8.191,34	-0,01
Facebook, Inc. 40,65 %	21.01.2022	360	USD	-28.061,72	-0,04
Facebook, Inc. 36,37 %	21.01.2022	650	USD	-31.620,29	-0,04
Facebook, Inc. 38,40 %	21.01.2022	410	USD	-25.839,78	-0,03
Facebook, Inc. 35,22 %	21.01.2022	520	USD	-19.937,94	-0,03
Facebook, Inc. 38,68 %	21.01.2022	380	USD	-23.984,32	-0,03
Facebook, Inc. 36,21 %	21.01.2022	500	USD	-20.701,58	-0,03
Facebook, Inc. 40,70 %	21.01.2022	590	USD	-48.373,14	-0,06
Facebook, Inc. 39,50 %	21.01.2022	440	USD	-28.754,53	-0,04
Facebook, Inc. 35,91 %	21.01.2022	470	USD	-17.473,90	-0,02
Facebook, Inc. 36,28 %	17.06.2022	510	USD	-17.137,61	-0,02
Facebook, Inc. 39,94 %	21.01.2022	570	USD	-39.360,23	-0,05
Facebook, Inc. 40,00 %	21.01.2022	570	USD	-42.527,70	-0,06
Facebook, Inc. 39,36 %	21.01.2022	480	USD	-30.567,16	-0,04
Facebook, Inc. 38,88 %	21.01.2022	380	USD	-22.894,85	-0,03
Facebook, Inc. 39,10 %	21.01.2022	430	USD	-29.043,76	-0,04
Fiserv, Inc. 28,23 %	21.01.2022	80	USD	-2.851,50	0,00
Fiserv, Inc. 36,85 %	21.01.2022	80	USD	-8.565,31	-0,01
Fiserv, Inc. 33,86 %	21.01.2022	90	USD	-7.218,82	-0,01
Fiserv, Inc. 28,77 %	21.01.2022	80	USD	-2.948,64	0,00
Fiserv, Inc. 36,62 %	21.01.2022	80	USD	-8.617,25	-0,01
Fiserv, Inc. 28,82 %	21.01.2022	90	USD	-3.511,51	0,00
Gilead Sciences, Inc. 33,10 %	21.01.2022	90	USD	-7.791,05	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 30,57 %	21.01.2022	90	USD	-6.430,31	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 34,73 %	21.01.2022	80	USD	-8.186,86	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 34,46 %	21.01.2022	90	USD	-9.105,49	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 31,10 %	21.01.2022	80	USD	-5.999,83	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 29,7 %	21.01.2022	80	USD	-5.271,94	-0,01
Home Depot, Inc./The 28,65 %	17.06.2022	230	USD	-11.254,66	-0,02
Home Depot, Inc./The 27,95 %	21.01.2022	190	USD	-10.441,27	-0,01
Home Depot, Inc./The 30,07 %	21.01.2022	170	USD	-12.742,47	-0,02
Home Depot, Inc./The 29,63 %	21.01.2022	320	USD	-23.759,17	-0,03
Home Depot, Inc./The 28,55 %	21.01.2022	180	USD	-10.111,82	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,20 %	21.01.2022	190	USD	-11.498,69	-0,02
Home Depot, Inc./The 27,40 %	21.01.2022	180	USD	-9.456,11	-0,01
Home Depot, Inc./The 32,03 %	21.01.2022	170	USD	-15.203,81	-0,02
Honeywell International, Inc. 28,72 %	17.06.2022	110	USD	-5.470,79	-0,01
Honeywell International, Inc. 33,10 %	21.01.2022	90	USD	-9.062,99	-0,01
Honeywell International, Inc. 30,47 %	21.01.2022	90	USD	-6.746,78	-0,01
Honeywell International, Inc. 30,49 %	21.01.2022	90	USD	-6.780,17	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,80 %	21.01.2022	90	USD	-4.743,99	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Honeywell International, Inc. 33,50 %	21.01.2022	90	USD	-8.987,10	-0,01
Intel Corp. 38,89 %	21.01.2022	150	USD	-11.950,41	-0,02
Intel Corp. 32,98 %	21.01.2022	240	USD	-9.422,72	-0,01
Intel Corp. 35,02 %	21.01.2022	220	USD	-2.665,82	0,00
Intel Corp. 34,55 %	21.01.2022	220	USD	-1.489,67	0,00
Intel Corp. 35,17 %	21.01.2022	270	USD	-14.719,20	-0,02
Intel Corp. 36,60 %	21.01.2022	160	USD	-10.190,41	-0,01
Intel Corp. 34,21 %	21.01.2022	260	USD	-13.522,89	-0,02
Intel Corp. 34,39 %	21.01.2022	200	USD	-10.410,65	-0,01
Intel Corp. 33,07 %	17.06.2022	150	USD	-4.979,76	-0,01
Intel Corp. 38,80 %	21.01.2022	140	USD	-5.966,44	-0,01
Intel Corp. 33,85 %	21.01.2022	130	USD	-8,77	0,00
Intel Corp. 37,40 %	21.01.2022	270	USD	-8.330,63	-0,01
Intel Corp. 37,70 %	21.01.2022	140	USD	-5.599,29	-0,01
Intel Corp. 36,87 %	21.01.2022	240	USD	-6.233,24	-0,01
Intel Corp. 41,41 %	21.01.2022	150	USD	-14.530,73	-0,02
Intuit, Inc. 31,04 %	21.01.2022	110	USD	-4.815,92	-0,01
Intuit, Inc. 34,80 %	21.01.2022	110	USD	-5.848,30	-0,01
Intuit, Inc. 32,99 %	21.01.2022	120	USD	-7.169,24	-0,01
Intuit, Inc. 37,35 %	21.01.2022	110	USD	-8.606,88	-0,01
Intuit, Inc. 31,91 %	21.01.2022	120	USD	-6.246,39	-0,01
Intuit, Inc. 37,01 %	21.01.2022	110	USD	-8.427,86	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 31,62 %	21.01.2022	100	USD	-3.819,88	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 32,16 %	21.01.2022	100	USD	-4.490,26	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 37,25 %	21.01.2022	110	USD	-6.787,93	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 32,78 %	21.01.2022	100	USD	-2.919,30	0,00
Intuitive Surgical, Inc. 39,93 %	21.01.2022	100	USD	-9.153,38	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 39,55 %	21.01.2022	100	USD	-8.760,43	-0,01
JD.Com, Inc. 38,09 %	21.01.2022	60	USD	-1.106,00	0,00
JD.Com, Inc. 38,10 %	21.01.2022	70	USD	-1.130,37	0,00
JD.Com, Inc. 48,08 %	21.01.2022	90	USD	-5.746,52	-0,01
JD.Com, Inc. 51,33 %	21.01.2022	90	USD	-9.571,47	-0,01
JD.Com, Inc. 50,46 %	21.01.2022	100	USD	-8.578,29	-0,01
Johnson & Johnson 24,65 %	21.01.2022	250	USD	-16.127,00	-0,02
Johnson & Johnson 23,50 %	21.01.2022	250	USD	-14.889,54	-0,02
Johnson & Johnson 22,28 %	21.01.2022	390	USD	-18.538,07	-0,02
Johnson & Johnson 26,60 %	21.01.2022	280	USD	-22.746,61	-0,03
Johnson & Johnson 24,57 %	21.01.2022	240	USD	-16.845,94	-0,02
Johnson & Johnson 26,58 %	21.01.2022	260	USD	-22.717,94	-0,03
Johnson & Johnson 22,92 %	17.06.2022	300	USD	-10.999,25	-0,01
Johnson & Johnson 23,60 %	21.01.2022	240	USD	-13.324,56	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 36,50 %	21.01.2022	280	USD	-31.735,22	-0,04
JPMorgan Chase & Co. 31,24 %	21.01.2022	430	USD	-28.043,00	-0,04
JPMorgan Chase & Co. 30,38 %	17.06.2022	330	USD	-15.839,11	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 32,00 %	21.01.2022	240	USD	-16.977,48	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 32,20 %	21.01.2022	260	USD	-19.712,12	-0,03
JPMorgan Chase & Co. 33,00 %	21.01.2022	250	USD	-20.374,83	-0,03
JPMorgan Chase & Co. 31,80 %	21.01.2022	270	USD	-19.853,27	-0,03
JPMorgan Chase & Co. 32,75 %	21.01.2022	270	USD	-21.788,51	-0,03
Kraft Heinz Co./The 28,52 %	21.01.2022	50	USD	-2.254,40	0,00
Lam Research Corp. 42,15 %	21.01.2022	90	USD	-3.751,33	0,00
Lam Research Corp. 44,34 %	21.01.2022	100	USD	-5.571,29	-0,01
Lam Research Corp. 41,78 %	21.01.2022	90	USD	-3.239,06	0,00
Linde PLC 27,44 %	17.06.2022	100	USD	-3.220,34	0,00
Linde PLC 30,85 %	21.01.2022	80	USD	-6.333,75	-0,01
Linde PLC 28,70 %	21.01.2022	90	USD	-4.589,93	-0,01
McDonald's Corp. 24,90 %	21.01.2022	100	USD	-6.693,65	-0,01
McDonald's Corp. 26,20 %	21.01.2022	90	USD	-6.435,62	-0,01
McDonald's Corp. 25,15 %	21.01.2022	100	USD	-6.320,94	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
McDonald's Corp. 25,57 %	21.01.2022	90	USD	-6.573,74	-0,01
McDonald's Corp. 24,19 %	17.06.2022	120	USD	-4.587,91	-0,01
McDonald's Corp. 27,29 %	21.01.2022	90	USD	-7.441,95	-0,01
Medtronic, Inc. 29,33 %	21.01.2022	90	USD	-6.500,89	-0,01
Medtronic, Inc. 27,14 %	17.06.2022	110	USD	-4.539,51	-0,01
Medtronic, Inc. 29,00 %	21.01.2022	90	USD	-5.316,22	-0,01
Medtronic, Inc. 31,10 %	21.01.2022	90	USD	-7.762,21	-0,01
Medtronic, Inc. 29,90 %	21.01.2022	100	USD	-7.068,05	-0,01
Medtronic, Inc. 30,49 %	21.01.2022	100	USD	-8.178,60	-0,01
MercadoLibre, Inc. 47,71 %	21.01.2022	80	USD	-5.438,57	-0,01
MercadoLibre, Inc. 47,20 %	21.01.2022	80	USD	-5.313,09	-0,01
MercadoLibre, Inc. 48,56 %	21.01.2022	80	USD	-6.292,60	-0,01
Merck & Co., Inc. 26,14 %	21.01.2022	110	USD	-6.008,39	-0,01
Merck & Co., Inc. 26,20 %	21.01.2022	140	USD	-7.625,53	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,50 %	21.01.2022	110	USD	-5.222,87	-0,01
Merck & Co., Inc. 24,64 %	21.01.2022	170	USD	-6.820,03	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,44 %	17.06.2022	130	USD	-5.096,68	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,65 %	21.01.2022	120	USD	-6.100,76	-0,01
Merck & Co., Inc. 28,30 %	21.01.2022	110	USD	-8.030,76	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,15 %	21.01.2022	130	USD	-6.228,59	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,49 %	21.01.2022	100	USD	-3.969,14	-0,01
Micron Technology, Inc. 50,87 %	21.01.2022	100	USD	-6.783,03	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,57 %	21.01.2022	100	USD	-4.287,88	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,74 %	21.01.2022	90	USD	-4.024,54	-0,01
Microsoft Corp. 32,90 %	21.01.2022	1.110	USD	-92.326,84	-0,12
Microsoft Corp. 32,78 %	21.01.2022	1.020	USD	-88.014,67	-0,12
Microsoft Corp. 29,20 %	21.01.2022	1.340	USD	-77.276,83	-0,10
Microsoft Corp. 30,69 %	21.01.2022	1.640	USD	-117.547,86	-0,16
Microsoft Corp. 29,08 %	21.01.2022	1.280	USD	-72.165,28	-0,10
Microsoft Corp. 33,00 %	21.01.2022	1.460	USD	-127.557,63	-0,17
Microsoft Corp. 33,14 %	21.01.2022	1.210	USD	-102.675,02	-0,14
Microsoft Corp. 30,19 %	17.06.2022	1.250	USD	-59.469,61	-0,08
Microsoft Corp. 33,69 %	21.01.2022	1.430	USD	-128.409,39	-0,17
Microsoft Corp. 32,70 %	21.01.2022	950	USD	-76.455,01	-0,10
Microsoft Corp. 32,88 %	21.01.2022	1.400	USD	-119.482,25	-0,16
Microsoft Corp. 35,27 %	21.01.2022	1.080	USD	-114.019,73	-0,15
Microsoft Corp. 30,75 %	21.01.2022	1.050	USD	-69.902,60	-0,09
Microsoft Corp. 30,50 %	21.01.2022	1.040	USD	-70.675,10	-0,09
Microsoft Corp. 28,68 %	21.01.2022	1.280	USD	-67.524,08	-0,09
Mondelez International, Inc. 27,53 %	21.01.2022	90	USD	-8.117,38	-0,01
Mondelez International, Inc. 26,25 %	21.01.2022	100	USD	-7.550,38	-0,01
Mondelez International, Inc. 26,72 %	21.01.2022	90	USD	-7.472,30	-0,01
Mondelez International, Inc. 21,90 %	21.01.2022	90	USD	-4.388,82	-0,01
Mondelez International, Inc. 22,50 %	21.01.2022	90	USD	-4.519,35	-0,01
Mondelez International, Inc. 22,37 %	21.01.2022	80	USD	-3.876,88	-0,01
Monster Beverage Corp. 29,51 %	21.01.2022	50	USD	-2.185,26	0,00
Monster Beverage Corp. 29,35 %	21.01.2022	50	USD	-2.184,42	0,00
NASDAQ 100 Index 28,35 %	21.01.2022	15.000	USD	894.801,42	1,20
NASDAQ 100 Index 25,50 %	21.01.2022	15.000	USD	608.297,50	0,81
NASDAQ 100 Index 27,40 %	21.01.2022	15.000	USD	700.999,24	0,94
NASDAQ 100 Index 25,10 %	21.01.2022	15.000	USD	551.011,89	0,74
NASDAQ 100 Index 25,50 %	21.01.2022	15.000	USD	582.519,61	0,78
NASDAQ 100 Index 28,50 %	21.01.2022	15.000	USD	929.370,10	1,24
NASDAQ 100 Index 27,80 %	21.01.2022	15.000	USD	752.023,78	1,01
Netflix, Inc. 38,79 %	21.01.2022	250	USD	-14.522,73	-0,02
Netflix, Inc. 43,69 %	21.01.2022	250	USD	-16.740,46	-0,02
Netflix, Inc. 36,13 %	21.01.2022	230	USD	-9.534,37	-0,01
Netflix, Inc. 44,70 %	21.01.2022	150	USD	-11.406,52	-0,02
Netflix, Inc. 44,57 %	21.01.2022	300	USD	-22.494,31	-0,03

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 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Netflix, Inc. 36,77 %	21.01.2022	190	USD	-8.972,09	-0,01
Netflix, Inc. 36,67 %	21.01.2022	230	USD	-11.355,51	-0,02
Netflix, Inc. 36,54 %	17.06.2022	150	USD	-4.843,15	-0,01
Netflix, Inc. 42,43 %	21.01.2022	130	USD	-11.863,22	-0,02
Netflix, Inc. 43,47 %	21.01.2022	240	USD	-16.617,25	-0,02
Netflix, Inc. 43,45 %	21.01.2022	130	USD	-8.233,66	-0,01
Netflix, Inc. 40,55 %	21.01.2022	140	USD	-6.057,34	-0,01
Netflix, Inc. 43,98 %	21.01.2022	150	USD	-15.239,06	-0,02
Netflix, Inc. 40,90 %	21.01.2022	140	USD	-11.180,88	-0,01
Netflix, Inc. 44,10 %	21.01.2022	240	USD	-18.199,85	-0,02
NextEra Energy, Inc. 32,05 %	21.01.2022	100	USD	-6.514,04	-0,01
NextEra Energy, Inc. 33,65 %	21.01.2022	80	USD	-7.676,87	-0,01
NextEra Energy, Inc. 29,65 %	21.01.2022	90	USD	-4.027,58	-0,01
NextEra Energy, Inc. 34,42 %	21.01.2022	90	USD	-9.023,53	-0,01
NIKE, Inc. 36,01 %	21.01.2022	100	USD	-5.142,93	-0,01
NIKE, Inc. 34,45 %	21.01.2022	110	USD	-5.190,66	-0,01
NIKE, Inc. 30,46 %	17.06.2022	120	USD	-1.033,14	0,00
NIKE, Inc. 33,45 %	21.01.2022	100	USD	-3.190,82	0,00
NIKE, Inc. 33,70 %	21.01.2022	100	USD	-3.268,40	0,00
NIKE, Inc. 37,27 %	21.01.2022	100	USD	-6.245,04	-0,01
NIKE, Inc. 36,10 %	21.01.2022	120	USD	-6.782,70	-0,01
NVIDIA Corp. 47,26 %	21.01.2022	370	USD	-17.821,41	-0,02
NVIDIA Corp. 42,90 %	21.01.2022	370	USD	-8.442,71	-0,01
NVIDIA Corp. 46,72 %	21.01.2022	200	USD	-8.034,40	-0,01
NVIDIA Corp. 42,75 %	21.01.2022	310	USD	-5.761,36	-0,01
NVIDIA Corp. 41,77 %	17.06.2022	240	USD	-2.649,13	0,00
NVIDIA Corp. 44,49 %	21.01.2022	440	USD	-7.220,17	-0,01
NVIDIA Corp. 42,30 %	21.01.2022	190	USD	-2.739,69	0,00
NVIDIA Corp. 45,30 %	21.01.2022	210	USD	-6.153,56	-0,01
NVIDIA Corp. 44,70 %	21.01.2022	220	USD	-4.001,52	-0,01
NVIDIA Corp. 44,00 %	21.01.2022	190	USD	-1.839,28	0,00
NVIDIA Corp. 43,77 %	21.01.2022	360	USD	-3.491,02	0,00
NVIDIA Corp. 48,40 %	21.01.2022	370	USD	-22.102,04	-0,03
NVIDIA Corp. 45,73 %	21.01.2022	180	USD	-7.784,98	-0,01
NVIDIA Corp. 42,88 %	21.01.2022	410	USD	-9.348,51	-0,01
NVIDIA Corp. 42,07 %	21.01.2022	380	USD	-4.979,51	-0,01
NXP Semiconductors NV 39,90 %	21.01.2022	60	USD	-3.798,64	-0,01
NXP Semiconductors NV 39,62 %	21.01.2022	50	USD	-3.069,40	0,00
PayPal Holdings, Inc. 41,87 %	21.01.2022	250	USD	-13.561,44	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 37,59 %	21.01.2022	250	USD	-15.355,43	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 42,11 %	21.01.2022	360	USD	-19.182,39	-0,03
PayPal Holdings, Inc. 37,60 %	21.01.2022	170	USD	-9.925,62	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 38,03 %	21.01.2022	310	USD	-19.045,96	-0,03
PayPal Holdings, Inc. 41,21 %	21.01.2022	250	USD	-12.170,09	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 45,63 %	21.01.2022	190	USD	-20.978,67	-0,03
PayPal Holdings, Inc. 43,60 %	21.01.2022	180	USD	-11.849,74	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 44,93 %	21.01.2022	170	USD	-19.758,07	-0,03
PayPal Holdings, Inc. 38,56 %	21.01.2022	330	USD	-22.153,05	-0,03
PayPal Holdings, Inc. 37,19 %	21.01.2022	310	USD	-16.902,44	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 41,70 %	21.01.2022	170	USD	-8.469,18	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 41,20 %	21.01.2022	160	USD	-7.833,38	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 41,42 %	21.01.2022	310	USD	-14.897,46	-0,02
PayPal Holdings, Inc. 37,24 %	17.06.2022	190	USD	-8.759,00	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,40 %	21.01.2022	130	USD	-9.404,41	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,79 %	21.01.2022	110	USD	-8.695,93	-0,01
PepsiCo, Inc. 27,61 %	21.01.2022	110	USD	-10.181,89	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,83 %	21.01.2022	200	USD	-9.644,99	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,49 %	21.01.2022	220	USD	-16.527,36	-0,02
PepsiCo, Inc. 23,15 %	17.06.2022	130	USD	-4.058,18	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
PepsiCo, Inc. 25,10 %	21.01.2022	120	USD	-8.241,84	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,41 %	21.01.2022	230	USD	-14.770,89	-0,02
PepsiCo, Inc. 22,81 %	21.01.2022	180	USD	-9.982,80	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,14 %	21.01.2022	260	USD	-18.098,49	-0,02
PepsiCo, Inc. 21,55 %	21.01.2022	210	USD	-9.571,21	-0,01
PepsiCo, Inc. 23,90 %	21.01.2022	110	USD	-7.154,32	-0,01
PepsiCo, Inc. 22,65 %	21.01.2022	130	USD	-6.575,09	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,68 %	21.01.2022	200	USD	-9.366,72	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,95 %	21.01.2022	230	USD	-16.357,37	-0,02
Pfizer, Inc. 31,00 %	21.01.2022	140	USD	-14.799,23	-0,02
Pfizer, Inc. 27,85 %	21.01.2022	120	USD	-9.426,76	-0,01
Pfizer, Inc. 27,32 %	21.01.2022	110	USD	-7.823,09	-0,01
Pfizer, Inc. 28,78 %	21.01.2022	110	USD	-9.299,78	-0,01
Pfizer, Inc. 32,45 %	21.01.2022	130	USD	-14.085,25	-0,02
Pfizer, Inc. 24,35 %	21.01.2022	200	USD	-9.044,60	-0,01
Pfizer, Inc. 25,10 %	21.01.2022	120	USD	-6.233,24	-0,01
Pfizer, Inc. 23,95 %	17.06.2022	150	USD	-5.031,62	-0,01
Procter & Gamble Co./The 23,78 %	17.06.2022	230	USD	-9.235,69	-0,01
Procter & Gamble Co./The 23,45 %	21.01.2022	220	USD	-11.525,93	-0,02
Procter & Gamble Co./The 25,92 %	21.01.2022	180	USD	-12.802,94	-0,02
Procter & Gamble Co./The 26,90 %	21.01.2022	190	USD	-15.010,63	-0,02
Procter & Gamble Co./The 26,05 %	21.01.2022	200	USD	-13.749,89	-0,02
Procter & Gamble Co./The 28,20 %	21.01.2022	190	USD	-16.758,58	-0,02
Procter & Gamble Co./The 23,55 %	21.01.2022	300	USD	-15.011,39	-0,02
Procter & Gamble Co./The 26 %	21.01.2022	230	USD	-16.122,70	-0,02
QUALCOMM, Inc. 41,64 %	21.01.2022	200	USD	-13.744,83	-0,02
QUALCOMM, Inc. 43,29 %	21.01.2022	190	USD	-15.787,67	-0,02
QUALCOMM, Inc. 40,74 %	21.01.2022	90	USD	-6.909,19	-0,01
QUALCOMM, Inc. 36,90 %	21.01.2022	90	USD	-4.810,02	-0,01
QUALCOMM, Inc. 35,52 %	21.01.2022	160	USD	-6.973,95	-0,01
QUALCOMM, Inc. 35,54 %	21.01.2022	160	USD	-7.807,74	-0,01
QUALCOMM, Inc. 43,57 %	21.01.2022	190	USD	-15.973,52	-0,02
QUALCOMM, Inc. 39,37 %	21.01.2022	90	USD	-6.465,22	-0,01
QUALCOMM, Inc. 40,95 %	21.01.2022	100	USD	-6.142,17	-0,01
QUALCOMM, Inc. 34,80 %	21.01.2022	150	USD	-5.861,37	-0,01
QUALCOMM, Inc. 43,35 %	21.01.2022	110	USD	-9.236,70	-0,01
QUALCOMM, Inc. 42,66 %	21.01.2022	230	USD	-17.879,84	-0,02
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 37,78 %	21.01.2022	50	USD	-3.902,52	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 37,02 %	21.01.2022	50	USD	-3.686,65	0,00
S&P 500 Index 23,50 %	21.01.2022	15.000	USD	895.522,39	1,20
S&P 500 Index 25,25 %	21.01.2022	15.000	USD	1.162.901,59	1,56
S&P 500 Index 23,43 %	21.01.2022	15.000	USD	945.142,93	1,27
S&P 500 Index 23,10 %	21.01.2022	15.000	USD	863.685,81	1,16
S&P 500 Index 22,30 %	21.01.2022	20.000	USD	1.002.074,37	1,34
S&P 500 Index 22,20 %	21.01.2022	15.000	USD	779.117,13	1,04
S&P 500 Index 21,20 %	17.06.2022	17.500	USD	422.780,17	0,57
S&P 500 Index 22,15 %	21.01.2022	15.000	USD	793.157,10	1,06
salesforce.com, Inc. 39,35 %	21.01.2022	120	USD	-9.928,66	-0,01
salesforce.com, Inc. 34,69 %	17.06.2022	130	USD	-2.731,76	0,00
salesforce.com, Inc. 34,44 %	21.01.2022	170	USD	-6.898,05	-0,01
salesforce.com, Inc. 36,71 %	21.01.2022	110	USD	-7.201,62	-0,01
salesforce.com, Inc. 40,60 %	21.01.2022	150	USD	-13.412,60	-0,02
salesforce.com, Inc. 37,36 %	21.01.2022	120	USD	-8.560,59	-0,01
salesforce.com, Inc. 39,10 %	21.01.2022	140	USD	-11.444,14	-0,02
salesforce.com, Inc. 34,80 %	21.01.2022	120	USD	-5.777,89	-0,01
Starbucks Corp. 31,51 %	21.01.2022	130	USD	-9.198,33	-0,01
Starbucks Corp. 29,48 %	21.01.2022	140	USD	-9.129,10	-0,01
Starbucks Corp. 31,36 %	21.01.2022	130	USD	-8.885,90	-0,01
Starbucks Corp. 32,16 %	21.01.2022	140	USD	-10.676,79	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Starbucks Corp. 28,28 %	21.01.2022	140	USD	-8.072,52	-0,01
Starbucks Corp. 29,00 %	21.01.2022	140	USD	-8.648,62	-0,01
Tesla, Inc. 78,97 %	21.01.2022	300	USD	-52.878,83	-0,07
Tesla, Inc. 76,47 %	21.01.2022	520	USD	-62.076,40	-0,08
Tesla, Inc. 70,42 %	21.01.2022	560	USD	-58.974,96	-0,08
Tesla, Inc. 61,25 %	17.06.2022	300	USD	-1.320,52	0,00
Tesla, Inc. 66,31 %	21.01.2022	420	USD	-30.213,51	-0,04
Tesla, Inc. 79,70 %	21.01.2022	370	USD	-54.908,77	-0,07
Tesla, Inc. 78,15 %	21.01.2022	370	USD	-51.576,61	-0,07
Tesla, Inc. 76,38 %	21.01.2022	750	USD	-90.336,46	-0,12
Tesla, Inc. 72,80 %	21.01.2022	430	USD	-36.081,71	-0,05
Tesla, Inc. 81,52 %	21.01.2022	670	USD	-111.706,21	-0,15
Tesla, Inc. 76,38 %	21.01.2022	320	USD	-40.513,36	-0,05
Tesla, Inc. 65,46 %	21.01.2022	570	USD	-36.534,03	-0,05
Tesla, Inc. 71,68 %	21.01.2022	600	USD	-70.756,39	-0,09
Tesla, Inc. 71,90 %	21.01.2022	300	USD	-36.068,81	-0,05
Texas Instruments, Inc. 35,17 %	21.01.2022	90	USD	-6.170,76	-0,01
Texas Instruments, Inc. 36,47 %	21.01.2022	100	USD	-7.251,03	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,38 %	21.01.2022	200	USD	-8.171,01	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,11 %	21.01.2022	170	USD	-6.572,64	-0,01
Texas Instruments, Inc. 33,30 %	21.01.2022	90	USD	-2.751,84	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,25 %	21.01.2022	90	USD	-3.470,53	0,00
Texas Instruments, Inc. 32,30 %	21.01.2022	100	USD	-4.436,29	-0,01
Texas Instruments, Inc. 34,38 %	21.01.2022	180	USD	-11.476,35	-0,02
Texas Instruments, Inc. 31,48 %	17.06.2022	110	USD	-3.344,81	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,62 %	21.01.2022	170	USD	-9.783,71	-0,01
Texas Instruments, Inc. 35,01 %	21.01.2022	160	USD	-8.715,75	-0,01
Texas Instruments, Inc. 32,50 %	21.01.2022	170	USD	-8.874,86	-0,01
Texas Instruments, Inc. 35,64 %	21.01.2022	160	USD	-9.660,18	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 33,45 %	21.01.2022	120	USD	-7.072,10	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 31,10 %	21.01.2022	100	USD	-4.530,73	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 29,18 %	17.06.2022	120	USD	-888,44	0,00
Thermo Fisher Scientific, Inc. 33,35 %	21.01.2022	100	USD	-6.562,95	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 31,80 %	21.01.2022	130	USD	-5.418,58	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 32,75 %	21.01.2022	120	USD	-5.930,69	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 35,36 %	21.01.2022	110	USD	-8.702,42	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,12 %	21.01.2022	170	USD	-6.359,05	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,99 %	21.01.2022	180	USD	-14.586,39	-0,02
T-Mobile US, Inc. 34,40 %	21.01.2022	220	USD	-15.150,85	-0,02
T-Mobile US, Inc. 34,02 %	21.01.2022	190	USD	-12.455,18	-0,02
T-Mobile US, Inc. 28,40 %	21.01.2022	160	USD	-5.129,61	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,83 %	21.01.2022	180	USD	-14.493,81	-0,02
T-Mobile US, Inc. 28,15 %	21.01.2022	170	USD	-5.314,02	-0,01
Union Pacific Corp. 30,72 %	17.06.2022	100	USD	-5.375,66	-0,01
Union Pacific Corp. 32,35 %	21.01.2022	90	USD	-6.859,86	-0,01
Union Pacific Corp. 34,45 %	21.01.2022	90	USD	-8.159,12	-0,01
Union Pacific Corp. 36,17 %	21.01.2022	90	USD	-10.380,47	-0,01
Union Pacific Corp. 32,94 %	21.01.2022	80	USD	-7.179,02	-0,01
United Parcel Service, Inc. 31,90 %	21.01.2022	80	USD	-4.110,97	-0,01
United Parcel Service, Inc. 28,14 %	17.06.2022	100	USD	-2.982,54	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 36,29 %	21.01.2022	190	USD	-22.720,21	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 29,85 %	17.06.2022	260	USD	-10.990,64	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 29,89 %	21.01.2022	350	USD	-23.770,14	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 33,91 %	21.01.2022	190	USD	-19.256,35	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 34,80 %	21.01.2022	220	USD	-24.291,08	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 33,60 %	21.01.2022	210	USD	-21.185,94	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 33,70 %	21.01.2022	200	USD	-19.829,66	-0,03
UnitedHealth Group, Inc. 33,10 %	21.01.2022	200	USD	-18.871,74	-0,03
Verizon Communications, Inc. 21,51 %	17.06.2022	160	USD	-6.473,40	-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 PREMIUM
WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2021 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag (000)	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
Verizon Communications, Inc. 21,60 %	21.01.2022	140	USD	-8.411,33	-0,01
Verizon Communications, Inc. 23,72 %	21.01.2022	130	USD	-10.150,94	-0,01
Verizon Communications, Inc. 22,20 %	21.01.2022	160	USD	-8.114,01	-0,01
Verizon Communications, Inc. 22,15 %	21.01.2022	140	USD	-7.017,12	-0,01
Verizon Communications, Inc. 25,71 %	21.01.2022	140	USD	-12.632,94	-0,02
Verizon Communications, Inc. 20,40 %	21.01.2022	160	USD	-6.029,52	-0,01
Verizon Communications, Inc. 20,72 %	21.01.2022	220	USD	-11.590,86	-0,02
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 39,25 %	21.01.2022	60	USD	-5.331,15	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 39,51 %	21.01.2022	60	USD	-5.529,98	-0,01
Walmart, Inc. 28,30 %	21.01.2022	140	USD	-11.209,21	-0,01
Walmart, Inc. 27,40 %	21.01.2022	120	USD	-8.594,99	-0,01
Walmart, Inc. 25,70 %	21.01.2022	140	USD	-8.747,79	-0,01
Walmart, Inc. 30,27 %	21.01.2022	110	USD	-11.847,80	-0,02
Walmart, Inc. 24,73 %	17.06.2022	130	USD	-6.227,59	-0,01
Walmart, Inc. 28,39 %	21.01.2022	100	USD	-9.300,11	-0,01
Walmart, Inc. 24,78 %	21.01.2022	170	USD	-10.186,52	-0,01
Walmart, Inc. 26,00 %	21.01.2022	110	USD	-7.972,43	-0,01
Walt Disney Co./The 33,40 %	21.01.2022	170	USD	-7.372,54	-0,01
Walt Disney Co./The 38,40 %	21.01.2022	200	USD	-26.339,48	-0,04
Walt Disney Co./The 38,40 %	21.01.2022	220	USD	-23.589,84	-0,03
Walt Disney Co./The 32,80 %	21.01.2022	290	USD	-22.854,71	-0,03
Walt Disney Co./The 35,50 %	21.01.2022	200	USD	-21.698,28	-0,03
Walt Disney Co./The 40,66 %	21.01.2022	210	USD	-29.843,41	-0,04
Walt Disney Co./The 30,39 %	17.06.2022	210	USD	-8.228,94	-0,01
Walt Disney Co./The 35,70 %	21.01.2022	180	USD	-14.970,41	-0,02
Wells Fargo & Co. 36,75 %	21.01.2022	170	USD	-7.941,65	-0,01
Wells Fargo & Co. 35,57 %	17.06.2022	130	USD	-5.652,07	-0,01
Wells Fargo & Co. 40,21 %	21.01.2022	90	USD	-6.742,98	-0,01
Wells Fargo & Co. 41,45 %	21.01.2022	90	USD	-7.500,38	-0,01
Wells Fargo & Co. 39,20 %	21.01.2022	90	USD	-5.938,53	-0,01
Zoom Video Communications, Inc. 49,55 %	21.01.2022	80	USD	-2.282,14	0,00
Zoom Video Communications, Inc. 68,84 %	21.01.2022	80	USD	-10.742,89	-0,01
Zoom Video Communications, Inc. 69,12 %	21.01.2022	80	USD	-10.891,98	-0,01
Zoom Video Communications, Inc. 50,77 %	21.01.2022	80	USD	-3.351,38	0,00
				845.388,92	**1,13**
Summe Volatility Swaps				**845.388,92**	**1,13**
Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder und Volatility Swaps (Anschaffungskosten EUR 81.731.965,59)				**82.572.085,80**	**110,60**
Bankguthaben				**10.186.551,15**	**13,64**
Sonstige Vermögenswerte				**38.219.598,45**	**51,19**
Sonstige Verbindlichkeiten				**-56.317.651,77**	**-75,43**
Summe Nettoteilfondsvermögen				**74.660.583,63**	**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 2021 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	41.726.696,88
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	845.388,92
Tagesgelder (Erl. 2)	40.000.000,00
Bankguthaben (Erl. 2) *	10.186.551,15
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	37.978.172,75
Zinsforderungen	168.475,34
Sonstige Forderungen	72.950,36
Summe Aktiva	**130.978.235,40**
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	37.733.234,28
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	18.316.703,65
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	53.365,51
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	23.238,07
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	2.772,67
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	188.337,59
Summe Passiva	**56.317.651,77**
Summe Nettoteilfondsvermögen	**74.660.583,63**
Nettoinventarwert pro Anteil	
Anteilklasse I	1.030,43
Anteilklasse I2R	1.028,35
Anteilklasse IS	1.033,87
Anteilklasse P	51,03
Anteilklasse R	51,49
Anteilklasse RS	51,63
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	
Anteilklasse I	375,00
Anteilklasse I2R	1.030,00
Anteilklasse IS	64.099,97
Anteilklasse P	2.000,00
Anteilklasse R	2.000,00
Anteilklasse RS	130.522,00

Anteilklassen	I	I2R	IS	P	R	RS
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	375,00	1.030,00	124.249,97	2.000,00	2.000,00	147.824,00
Zeichnungen	0,00	0,00	1.800,00	0,00	0,00	0,00
Rücknahmen	0,00	0,00	61,950,00	0,00	0,00	17.302,00
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	375,00	1.030,00	64.099,97	2.000,00	2.000,00	130.522,00

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.
Die nachfolgenden Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

ASSENAGON ALPHA PREMIUM

AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS FÜR DIE AM 30. JUNI 2021 ENDENDE GESCHÄFTSPERIODE IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	**135.611.265,97**
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	46.640,41
Summe Erträge	**46.640,41**
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	156.743,23
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	32.295,83
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	3.473,10
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	355.945,43
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	58.052,51
Performance Fee (Erl. 3)	188.337,59
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	6.683,39
Sonstige Zinsaufwendungen*	308.643,88
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	101.415,03
Summe Aufwendungen	**1.211.589,99**
Nettogewinn/(-verlust)	**-1.164.949,58**
Realisierte Nettogewinne	56.910.464,34
Realisierte Nettoverluste	-56.738.567,99
Realisierter Nettoverlust	**-993.053,23**
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-52.237.235,98
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	55.251.733,32
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	**2.021.444,11**
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	1.836.096,00
Rücknahme von Anteilen	-64.808.222,45
Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	**74.660.583,63**

* Die Position beinhaltet Zinsen aus Overnight Deposits.
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

Konsolidierte Darstellung

ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2021 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	187.122.070,68
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	2.707.930,46
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	845.388,92
Tagesgelder (Erl. 2)	460.297.242,60
Optionen (Erl. 2)	50.764.780,92
Bankguthaben (Erl. 2) *	362.660.216,96
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	76.635.617,26
Forderungen aus Tagesgeldern	748,04
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	648.915,01
Zinsforderungen	674.886,83
Forderungen aus Differenzkontrakten	2.444.331,59
Sonstige Forderungen	135.980,20
Summe Aktiva	**1.144.938.109,47**
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	79.366.670,84
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	20.643.037,06
Unrealisierte Verluste aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	2.065.918,04
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	9.141.720,34
Unrealisierte Verluste aus Differerenzkontrakten	948.455,80
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	640.314,52
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	204.064,21
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	43.444,95
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	188.373,88
Sonstige Verbindlichkeiten	130,00
Summe Passiva	**113.242.129,64**
Summe Nettofondsvermögen	**1.031.695.979,83**

* 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 AM 30. JUNI 2021 ENDENDE GESCHÄFTSPERIODE IN EUR

Nettofondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	**880.060.126,14**
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	249.797,12
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.165.865,87
Summe Erträge	**2.415.662,99**
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	656.887,50
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	336.097,25
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	411.572,40
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	3.283.431,43
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	564.441,71
Performance Fee (Erl. 3)	188.364,24
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	70.431,11
Aufwendungen aus Differenzkontrakten (Erl.2)	3.634.113,37
Transaktionskosten (Erl. 10)	10.675,37
Sonstige Zinsaufwendungen*	1.460.778,16
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	392.367,34
Summe Aufwendungen	**11.009.159,88**
Nettogewinn/(-verlust)	**-8.593.496,89**
Realisierte Nettogewinne	962.427.120,66
Realisierte Nettoverluste	-933.993.369,80
Realisierter Nettogewinn	**19.840.253,97**

Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-286.941.053,24
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	210.437.903,48
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	**-56.662.895,79**
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	374.517.056,78
Rücknahme von Anteilen	-166.218.307,30
Summe Nettofondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	**1.031.695.979,83**

* Die Position beinhaltet Zinsen aus Overnight Deposits.
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, welcher die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) erfüllt.

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

Gegenwärtig wird der Teilfonds Assenagon Alpha Volatility mit den Anteilklassen I, P (Auflagedatum: 25. Januar 2011), I GBP (Auflagedatum: 17. Dezember 2018), R (Auflagedatum: 1. August 2019) und I2 SPEZ (Auflagedatum: 17. November 2020) und der Teilfonds Assenagon Alpha Premium mit den Anteilklassen I, I2R, IS, P,R und RS (Auflagedatum: 11. Dezember 2019) zum Kauf angeboten.

Das konsolidierte Nettofondsvermögen 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 luxemburgischen Vorschriften in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) unter der Annahme des Prinzips der Unternehmenfortführung.

Bewertung der Anlagen

Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

a) 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.

b) 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.

c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfbaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Abschlussprüfer nachvollziehbaren, Weise.

d) 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 nachprüfbaren, 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“)

Die laufenden Kosten werden nun EU-weit einheitlich nach den Vorschriften der Richtlinie CESR/10/674 berechnet und in den Kundeninformationsdokumenten (KIID) ausgewiesen. Ein redundanter Ausweis der Berechnung der TER ("Total Expense Ratio") im Jahresbericht entfällt somit.
Für die Berichterstattung an die Schweizer Anleger ist die TER eine Pflichtangabe. Die Werte der TER nach den Richtlinien der SFAMA sind im hinteren Berichtsabschnitt "Sonstige zusätzliche Informationen für die Anleger in der Schweiz (ungeprüft)" angegeben.

Für den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Verwaltungsgebühren

Für die Verwaltung des Teilfonds Assenagon Alpha Volatility erhält die Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung in Höhe von 0,8 % p.a. für die Anteilklasse I, I GBP und R, 1,5 % p.a. für die Anteilklasse P und 0,0 % p.a. für die Anteilklasse I2 SPEZ. 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 SPEZ, I GBP, P und R

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Nettoteilfondsvermögen eine wertentwicklungsabhängige Vergütung (Performance Fee) von 15 % der Mehrperformance über einen Hurdle-Index. Die Performance Fee wird bewertungstäglich berechnet und zum Geschäftsjahresende 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 höheren Wert von a) dem für das Geschäftsjahresende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilswert der jeweiligen Anteilsklasse nach Auszahlung der Performance Fee für das abgelaufene Geschäftsjahr (High Water Mark) angepasst, wobei der Anteilswert um Ausschüttungen angepasst wird (BVI Methode).

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 36,29 angefallen.

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 0,55 % p.a für die Anteilklasse IS und RS, 0,75 % p.a. für die Anteilklasse I und R, 0,95% p.a. für die Anteilklasse I2R, und 1,4 % p.a. für die Anteilklasse P.

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 % 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 Anteilsklasse auf dem Erstausgabepreis der jeweiligen Anteilsklasse und entwickelt sich im Laufe des Geschäftsjahres auf Basis des 1-Monats-Euribor (bzw. auf Basis des 1-Monats-CHF-ICE LIBOR, des 1-Monats-GBP-ICE LIBOR, des 1-Monats-JPY-ICE LIBOR oder des 1-Monats-USD-ICE LIBOR 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. Der 1-Monats-CHF oder GBP oder JPY oder USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist der durchschnittliche Zinssatz zu dem ausgewählte Banken in London bereit sind, sich einander Kredite in CHF oder GBP oder JPY oder USD zu gewähren. 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 ("BVI-Methode"). 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 188.373,88 angefallen.

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	**R**
Performance Fee-Rückstellung zum 30.06.2021 (EUR)	36,29
Durchschnittliches Anteilklassenvolumen während des Berichtszeitraumes (EUR)	78.357.964
Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Anteilklassenvolumen	0,00%

Teilfonds	**Assenagon Alpha Premium**			
Anteilklasse	**I**	**IS**	**R**	**RS**
Performance Fee-Rückstellung zum 30.06.2021 (EUR)	461,02	178.151,12	112,11	9.613,34
Durchschnittliches Anteilklassenvolumen während des Berichtszeitraumes (EUR)	381.091	120.665.483	101.568	7.022.906
Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Anteilklassenvolumen	0,12%	0,15%	0,11%	0,14%

Unterschiede in den relativen Ergebnissen der Anteilklassen ergeben sich aus dem Vergleich der Performance Fee Beträge mit den jeweiligen Durchschnittsvolumen aufgrund unterschiedlicher Volumensentwicklungen während der Berichtsperiode durch Anteilszeichnungen und Anteilsrücknahmen sowie aus unterschiedlichen Kostenbelastungen.

Verwahrstellen- und Administrationsgebühren und sonstige Kosten des Fonds

Die Verwahrstelle is berechtigt ein Entgelt im Durchschnitt zwischen 0,02 % und 0,05 % p. a. auf das verwahrte Fondsvermögen 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 Fondsvermögen; 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 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.

Verwässerungsabgabe

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

Wenn Ausgaben, Rücknahmen und Umtäusche 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, Brokergebühren 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 Umtauschvon Anteilen eine Verwässerungsabgabe von bis zu zwei (2) Prozent des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteile erheben, wenn ihrer Meinung nach die bestehenden Anteilsinhaber (bei Ausgaben und Umtausch) oder die verbleibenden Anteilsinhaber (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 Anteilsinhaber, 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 2021 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
DAX Index Future	EUR	17.09.2021	-113	226.900,00	0,02
E-Mini Russell 2000 Future	USD	17.09.2021	-34	29.601,99	0,00
EURO/GBP Future	GBP	13.09.2021	-134	34.067,96	0,00
Euro Stoxx 50® Index Future	EUR	17.09.2021	-1.018	444.209,95	0,05
FTSE 100 Index Future	GBP	17.09.2021	-455	324.417,67	0,03
Nasdaq 100 E-Mini Future	USD	17.09.2021	-127	-1.127.662,52	-0,12
S&P 500 E-Mini Future	USD	17.09.2021	1.199	2.776.395,41	0,30
				2.707.930,46	**0,28**

5. Devisentermingeschäfte

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 30. Juni 2021 ausstehenden Devisentermingeschäfte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
42.240.587,70	EUR	46.000.000,00	CHF	17.09.2021	256.913,86	0,03
2.000.000,00	EUR	2.179.242,71	CHF	17.09.2021	11.030,11	0,00
2.737.436,08	EUR	3.000.000,00	CHF	17.09.2021	-629,60	0,00
11.600.645,46	EUR	10.000.000,00	GBP	17.09.2021	-31.440,95	0,00
94.558.371,29	EUR	115.000.000,00	USD	17.09.2021	-2.256.992,55	-0,25
16.827.552,09	EUR	20.000.000,00	USD	17.09.2021	-9.902,49	0,00
					-2.031.021,62	**-0,22**

Die am 30. Juni 2021 ausstehenden Devisentermingeschäfte für währungsgesicherte Anteilklassen werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfonds-vermögen (%)
24.690.630,00	GBP	28.773.067,98	EUR	16.08.2021	-34.896,42	0,00
					-34.896,42	**0,00**

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 (I2R, I2 SPEZ) und ausschüttende (I, I GBP, IS, P, R und RS) Anteile ausgegeben.

In der Geschäftsperiode vom 1. Januar 2021 bis zum 30. Juni 2021 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 2021 umgerechnet:

Britische Pfund	0,858446	= 1 Euro
Hong Kong Dollar	9,209522	= 1 Euro
Japanische Yen	131,623043	= 1 Euro
Schweizer Franken	1,096187	= 1 Euro
Schwedische Krone	10,141995	= 1 Euro
US-Dollar	1,185900	= 1 Euro

10. Transaktionskosten

Die Transaktionskosten resultierend aus den Käufen und Verkäufen der Wertpapiere und Derivate für die am 30. Juni 2021 endende Geschäftsperiode werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Transaktionskosten (EUR)
Assenagon Alpha Volatility	1.890.370,81
Assenagon Alpha Premium	0,00
	1.890.370,81

Die Transaktionskosten, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung 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)
Goldman Sachs International	Barmittel	10.280.000,00
HSBC Bank PLC London	Barmittel	410.000,00
HSBC France	Barmittel	1.190.000,00
Morgan Stanley & Co. International PLC	Barmittel	23.250.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	27.040.000,00
Société Générale (Paris)	Barmittel	20.180.000,00
UBS AG	Barmittel	58.620.000,00

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	40.210.000,00
Credit Suisse International	Barmittel	110.000,00
Credit Suisse Securities Sociedad de Valores SA	Barmittel	5.700.000,00
Goldman Sachs Bank Europe	Barmittel	10.030.000,00
JP Morgan AG (Frankfurt)	Barmittel	470.000,00
JP Morgan Securities PLC	Barmittel	3.820.000,00
Natixis S.A. (Paris)	Barmittel	2.570.000,00

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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)
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	190.000,00

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	360.000,00
Citigroup Global Markets Limited	Barmittel	330.000,00

12. Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

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

Kontrahent
Banco Bilbao Vizcaya Madrid S.A.
Barclays Bank PLC.
BNP Paribas S.A.
Brown Brothers Harriman & Co
Citigroup Global Markets Limited
Credit Suisse AG (Schweiz)

Credit Suisse International
Goldman Sachs Bank Europe SE
Goldman Sachs International
HSBC Bank PLC
JP Morgan AG
JP Morgan Securities PLC.
Morgan Stanley Bank AG
Morgan Stanley & Co. International
Morgan Stanley Europe SE
Natixis S.A.
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.
Citigroup Global Markets Limited
Credit Suisse AG (Schweiz)
Goldman Sachs Bank Europe SE
Goldman Sachs International
HSBC Bank PLC
JP Morgan Securities PLC
Morgan Stanley & Co. International
Morgan Stanley Europe SE
Natixis S.A
UBS AG (London)

13. Wesentliche Ereignisse im Laufe der Geschäftsperiode

Die COVID-Krise dauert weiter an. Trotz zunehmender Fortschritte in der Impfung der Bevölkerung und Lockerungen in den angeordneten Beschränkungen (z.B. Reisefreiheit, Gastronomie) bereiten die Nachrichten über deutlich ansteckendere Virusmutationen Sorge. Die Kapitalmärkte zeigen sich davon jedoch bisher weitgehend unbeeindruckt.

Rückblick: Die erste COVID-Welle im Frühjahr 2020 erfasste auch die Kapitalmärkte. Nach den starken Kurseinbrüchen folgte eine schnelle und anhaltende Erholung getrieben von der schnellen Entwicklung wirksamer Impfstoffe gegen das Virus, den Zusagen umfangreicher staatlicher Unterstützungsmaßnahmen und der weiterhin offensiven Geldpolitik der Zentralbanken. Die Assenagon Asset Management S.A. installierte ihre geübten Notfallprozesse (Disaster Recovery) und ermöglichte nahezu allen ihren Mitarbeiterinnen und Mitarbeitern ihren täglichen Aufgaben im Homeoffice nachzukommen. Die technische Ausrüstung ermöglicht auch den Fondsmanagern unabhängig von ihrem Standort die Märkte zu beobachten und zu analysieren sowie ihre Investmentfonds zu managen.

Weder technisch/organisatorisch bedingt noch verursacht durch große Anteilsrücknahmen ist es zu Unregelmäßigkeiten in der Fondsadministration gekommen. Es gab weder Aussetzungen von Anteilspreisberechnungen, noch wesentliche Verzögerungen in den Fondspreisveröffentlichungen.Trotz teilweise stark schwankender Marktliquidität in den Bondassetklassen konnten alle Anteilsrücknahmen pünktlich und vollständig abgewickelt werden. Die Assets in den Fondsportfolios unterlagen zwar großen Preisschwankungen und deutlichen Preiseinbrüchen, Verzögerungen fälliger Zinszahlungen und Zahlungsausfälle sind bisher keine aufgetreten.
Zum 1. Februar 2021 wurde Dr. Immo Querner in den Verwaltungsrat der Assenagon Asset Management S.A. berufen.
Am 17. März 2021 ist Michael Hünseler als Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft zurückgetreten.

14. Wesentliche Ereignisse nach Bilanzstichtag 30. Juni 2021

Es lagen keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag vor.

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Allgemein

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

Vertreter in der Schweiz ist:

Carnegie Fund Services S.A.
11, Rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz ist:

Banque Cantonale de Genève
17, Quai de l’Ile
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 durchnittlichen Fondsvermögens innerhalb einer 12 Monats-Periode aus.

	Anteilklasse	Total Expense Ratio 01.07.2020 bis 30.06.2021 (inkl. Performance Fee)	Performance Fee 01.07.2020 bis 30.06.2021
Assenagon Alpha Volatility	I	1,03%	
	I2 SPEZ*	0,28%	
	I GBP	1,02%	
	P	1,76%	
	R	1,12%	0,05%
Assenagon Alpha Premium	I	1,14%	0,12%
	I2R	1,20%	
	IS	1,00%	0,18%
	P	1,71%	
	R	1,17%	0,11%
	RS	1,00%	0,14%

* Die Anteilklasse I2 SPEZ wurde am 17. November 2020 gestartet. Die in der Tabelle ausgewiesene TER von 0,28% drückt das Verhältnis der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme der Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens im Zeitraum vom 17. November 2020 bis zum 30. Juni 2021 (annualisiert) aus.

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

Die Gesamtkostenquote (TER) wurde gemäß den Richtlinien der Swiss Fund & Asset Management Association (SFAMA) 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

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	150,91% (1)
Minimum	36,69% (1)
Durchschnitt	77,12% (1)

Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	1.126,87%(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	145,51% (1)
Minimum	61,81% (1)
Durchschnitt	93,53% (1)

Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	476,09% (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

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

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 2020

Assenagon Asset Management S.A.	**Angabe in Euro**
Personalbestand Jahresdurchschnitt	57
Gesamtvergütung	10,892 Mio
– davon feste Vergütung	6,5 – 7,0 Mio
– davon variable Vergütung	4,0 – 4,5 Mio
Gesamtvergütung an die Geschäftsführer	1,5 – 2,0 Mio
Gesamtvergütung an weitere Risikoträger	6,5 – 7,0 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

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 2021. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannten Regulierung finden daher keine Anwendung.

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center
1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg
Telefon +352 27049-100
Telefax +352 27049-111
www.assenagon.com
© 2021