

assenagon

Halbjahres-
bericht

Assenagon Alpha

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2023

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

R.C.S K72

Inhalt

Verwaltung und Administration

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

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

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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

Konsolidierte Darstellung

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

Erläuterungen zum Halbjahresbericht

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Risikomanagementverfahren

Angaben zur Mitarbeitervergütung

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 bzw. Basisinformationsblätter und des aktuellen ausführlichen Verkaufsprospekts erfolgen, ergänzt durch den jeweiligen letzten Jahresbericht inklusive geprüftem Jahresabschluss. Wenn der Stichtag des Jahresberichts länger als acht Monate zurückliegt, ist dem Erwerber auch ein Halbjahresbericht auszuhändigen.

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

Zusätzliche Informationen für die 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'Île, 1204 Genf. Die aktuellen Anteilspreise 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

KoppaKontor GmbH, vertreten durch Dr. Immo Querner
(Vorsitzender seit 1. Juni 2023)
Hans Günther Bonk (Vorsitzender bis 31. Mai 2023)
Vassilios Pappas
Dr. Dr. Heimo Plössnig

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

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

Verwahrstelle, Zentralverwaltung, Zahlstelle für Luxemburg, Deutschland und Österreich

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

Register- und Transferstelle

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

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Prannerstraße 8
80333 München
Deutschland

Informationsstelle für Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Prannerstraße 8
80333 München
Deutschland

Wirtschaftsprüfer des Fonds und der Verwaltungsgesellschaft

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

Aufsichtsbehörde

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

Kontaktstelle für Österreich und Deutschland

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

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
Deutschland					
DE0001141794	Bundesschatzanweisungen 0 %, 05.04.2024	37.000.000	EUR	36.062.531,00	3,06
DE0001141802	Bundesschatzanweisungen 0 %, 18.10.2024	27.000.000	EUR	25.868.619,00	2,19
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	42.000.000	EUR	40.932.864,00	3,47
DE0001102333	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 15.02.2024	40.000.000	EUR	39.612.040,00	3,36
DE0001104859	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.09.2023	40.000.000	EUR	39.743.600,00	3,37
DE0001104867	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.12.2023	42.000.000	EUR	41.356.140,00	3,50
DE0001104883	Bundesschatzanweisungen 0,2 %, 14.06.2024	35.000.000	EUR	33.965.820,00	2,88
DE0001104909	Bundesschatzanweisungen 2,2 %, 12.12.2024	30.000.000	EUR	29.528.400,00	2,50
DE000BU22007	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 13.03.2025	40.000.000	EUR	39.507.000,00	3,35
DE000BU22015	Bundesschatzanweisungen 2,8 %, 12.06.2025	40.000.000	EUR	39.705.860,80	3,36
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				366.282.874,80	31,04
Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.				366.282.874,80	31,04

Tagesgelder					
Kontrahent	Zinssatz	Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)	
Deutschland					
	Bayerische Landesbank 3,30 %, Tagesgeld	EUR	95.000.000,00	8,05	
	DZ Bank AG 3,35 %, Tagesgeld	EUR	90.000.000,00	7,63	
	DekaBank 3,33 %, Tagesgeld	EUR	70.000.000,00	5,93	
	Landesbank Baden Württemberg 3,30 %, Tagesgeld	EUR	100.000.000,00	8,48	
	Commerzbank 2,00 %, Tagesgeld	EUR	100.094.122,00	8,48	
			455.094.122,00	38,57	
Schweiz					
	Zürcher Kantonalbank 2,75 %, Tagesgeld	EUR	50.000.000,00	4,24	
			50.000.000,00	4,24	
Summe Tagesgelder				505.094.122,00	42,81

Optionen

Indexoptionen

Underlying	Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)	
DAX Index	Sep 2023 (call, strike 15.947,00)	420	EUR	236.595,87	0,02
DAX Index	Sep 2023 (put, strike 15.947,00)	-420	EUR	-105.836,15	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Sep 2023 (call, strike 16.080,00)	-450	EUR	-211.990,05	-0,02
DAX Index	Sep 2023 (put, strike 16.080,00)	450	EUR	131.293,00	0,01
DAX Index	Sep 2023 (call, strike 16.266,00)	-405	EUR	-143.020,76	-0,01
DAX Index	Sep 2023 (put, strike 16.266,00)	405	EUR	145.160,34	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.500,00)	2.700	EUR	108.282,49	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.500,00)	-1.100	EUR	-44.115,09	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.500,00)	-1.600	EUR	-64.167,40	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.000,00)	2.500	EUR	126.322,32	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.000,00)	-2.500	EUR	-126.322,32	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.100,00)	3.300	EUR	175.329,34	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.100,00)	-3.300	EUR	-175.329,34	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.400,00)	700	EUR	2.804.722,31	0,24
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.400,00)	-700	EUR	-2.804.722,31	-0,24
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.400,00)	700	EUR	43.212,37	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.400,00)	-700	EUR	-43.212,37	0,00
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	2.550	EUR	9.974.726,95	0,85
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	750	EUR	2.933.743,22	0,25
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-750	EUR	-2.933.743,22	-0,25
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-850	EUR	-3.324.908,98	-0,28
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-1.700	EUR	-6.649.817,97	-0,56
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	3.700	EUR	240.096,79	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	2.550	EUR	165.472,11	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	1.400	EUR	90.847,44	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	1.200	EUR	77.869,23	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	750	EUR	48.668,27	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	700	EUR	45.423,72	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-750	EUR	-48.668,27	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-850	EUR	-55.157,37	0,00
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.400	EUR	-90.847,44	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.700	EUR	-110.314,74	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.800	EUR	-116.803,85	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.900	EUR	-123.292,95	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.900	EUR	-123.292,95	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	3.000	EUR	250.825,97	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	2.500	EUR	209.021,64	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	1.600	EUR	133.773,85	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-1.600	EUR	-133.773,85	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-2.500	EUR	-209.021,64	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-3.000	EUR	-250.825,97	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	700	EUR	2.080.832,32	0,18
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	690	EUR	2.051.106,14	0,17
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	-690	EUR	-2.051.106,14	-0,17
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	-700	EUR	-2.080.832,32	-0,18
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	2.400	EUR	259.984,73	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	1.600	EUR	173.323,15	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	1.100	EUR	119.159,67	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	700	EUR	75.828,88	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	690	EUR	74.745,61	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-690	EUR	-74.745,61	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-700	EUR	-75.828,88	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-1.300	EUR	-140.825,06	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-1.600	EUR	-173.323,15	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-2.200	EUR	-238.319,33	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.800,00)	850	EUR	2.292.088,08	0,19
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.800,00)	850	EUR	2.292.088,08	0,19
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.800,00)	-1.700	EUR	-4.584.176,16	-0,39

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.800,00)	850	EUR	107.972,42	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.800,00)	850	EUR	107.972,42	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.800,00)	-1.700	EUR	-215.944,84	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	1.300	EUR	3.268.830,97	0,28
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	650	EUR	1.634.415,49	0,14
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-600	EUR	-1.508.691,22	-0,13
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-650	EUR	-1.634.415,49	-0,14
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-700	EUR	-1.760.139,75	-0,15
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	1.500	EUR	212.149,08	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	1.300	EUR	183.862,54	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	650	EUR	91.931,27	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-600	EUR	-84.859,63	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-650	EUR	-91.931,27	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-700	EUR	-99.002,91	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-1.500	EUR	-212.149,08	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.200,00)	550	EUR	1.283.797,68	0,11
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.200,00)	550	EUR	1.283.797,68	0,11
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.200,00)	-1.100	EUR	-2.567.595,35	-0,22
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.200,00)	550	EUR	86.691,08	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.200,00)	550	EUR	86.691,08	0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.200,00)	-1.100	EUR	-173.382,16	-0,01
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	1.800	EUR	334.575,59	0,03
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	1.000	EUR	185.875,33	0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	-1.000	EUR	-185.875,33	-0,02
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	-1.800	EUR	-334.575,59	-0,03
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 14.000,00)	-4.000	EUR	-1.248.537,33	-0,11
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 14.700,00)	1.800	EUR	735.481,48	0,06
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 14.700,00)	-1.800	EUR	-735.481,48	-0,06
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 14.800,00)	2.200	EUR	934.368,84	0,08
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 14.800,00)	-2.200	EUR	-934.368,84	-0,08
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.000,00)	-750	EUR	-1.654.297,28	-0,14
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	2.300	EUR	1.055.400,97	0,09
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	1.000	EUR	458.869,99	0,04
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	-750	EUR	-344.152,49	-0,03
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	-1.000	EUR	-458.869,99	-0,04
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	-2.300	EUR	-1.055.400,97	-0,09
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	-2.400	EUR	-1.101.287,97	-0,09
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.000,00)	-3.300	EUR	-1.514.270,96	-0,13
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.200,00)	700	EUR	1.435.255,67	0,12
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.200,00)	-700	EUR	-1.435.255,67	-0,12
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.200,00)	700	EUR	347.110,51	0,03
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.200,00)	-700	EUR	-347.110,51	-0,03
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.300,00)	680	EUR	1.342.177,10	0,11
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.300,00)	-600	EUR	-1.184.273,91	-0,10
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.300,00)	-680	EUR	-1.342.177,10	-0,11
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.300,00)	680	EUR	350.526,46	0,03
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.300,00)	-600	EUR	-309.288,05	-0,03
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.300,00)	-680	EUR	-350.526,46	-0,03
DAX Index	Jun 2024 (call, strike 15.500,00)	-600	EUR	-1.093.908,78	-0,09
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 15.500,00)	-600	EUR	-334.342,90	-0,03
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.500,00)	-2.100	EUR	-1.123.594,20	-0,10
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 14.800,00)	-2.200	EUR	-1.285.003,35	-0,11
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.000,00)	-2.300	EUR	-1.424.629,28	-0,12
DAX Index	Dez 2024 (call, strike 15.500,00)	-1.200	EUR	-2.654.623,95	-0,23
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	-1.200	EUR	-861.875,20	-0,07
DAX Index	Dez 2024 (put, strike 15.500,00)	-1.400	EUR	-1.005.521,07	-0,09

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (call, strike 4.295,00)	-1.148	EUR	-215.057,32	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (put, strike 4.295,00)	1.148	EUR	67.573,22	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (call, strike 4.366,00)	-1.160	EUR	-157.596,16	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (put, strike 4.366,00)	1.160	EUR	90.314,78	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (call, strike 4.383,00)	1.216	EUR	151.535,55	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (put, strike 4.383,00)	-1.216	EUR	-101.523,59	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (call, strike 4.387,00)	1.680	EUR	205.010,44	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Sep 2023 (put, strike 4.387,00)	-1.680	EUR	-142.584,74	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	14.000	EUR	125.587,07	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	5.200	EUR	46.646,63	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	-5.200	EUR	-46.646,63	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	-14.000	EUR	-125.587,07	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	12.000	EUR	127.000,68	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	9.000	EUR	95.250,51	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-3.000	EUR	-31.750,17	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-6.000	EUR	-63.500,34	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-12.000	EUR	-127.000,68	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	4.400	EUR	5.472.469,91	0,46
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	2.600	EUR	3.233.732,22	0,27
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-2.487.486,32	-0,21
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	-5.000	EUR	-6.218.715,81	-0,53
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	15.000	EUR	188.018,76	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	6.500	EUR	81.474,80	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	4.400	EUR	55.152,17	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	2.600	EUR	32.589,92	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	1.500	EUR	18.801,88	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-25.069,17	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-5.000	EUR	-62.672,92	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-6.500	EUR	-81.474,80	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-6.500	EUR	-81.474,80	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-10.000	EUR	-125.345,84	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.300,00)	3.000	EUR	3.443.498,97	0,29
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-3.443.498,97	-0,29
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	14.000	EUR	208.208,15	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	4.500	EUR	66.924,05	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	3.000	EUR	44.616,03	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-500	EUR	-7.436,01	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-44.616,03	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-9.000	EUR	-133.848,10	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-9.000	EUR	-133.848,10	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.400,00)	2.900	EUR	3.052.139,85	0,26
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.400,00)	-2.900	EUR	-3.052.139,85	-0,26
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	5.700	EUR	101.167,21	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	2.900	EUR	51.471,04	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	-2.900	EUR	-51.471,04	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	-5.700	EUR	-101.167,21	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	7.000	EUR	148.551,38	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	4.300	EUR	91.252,99	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.000	EUR	-21.221,63	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-4.300	EUR	-91.252,99	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-6.000	EUR	-127.329,76	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	5.000	EUR	128.130,57	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	4.800	EUR	123.005,34	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.800	EUR	-123.005,34	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-5.000	EUR	-128.130,57	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	2.500	EUR	1.927.419,55	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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	1.000	EUR	770.967,82	0,07
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.500	EUR	-2.698.387,37	-0,23
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	14.000	EUR	433.961,23	0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	12.800	EUR	396.764,56	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	5.700	EUR	176.684,22	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	2.500	EUR	77.493,08	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	1.000	EUR	30.997,23	0,00
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.500	EUR	-108.490,31	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.700	EUR	-176.684,22	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.000	EUR	-185.983,39	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.800	EUR	-210.781,17	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-14.000	EUR	-433.961,23	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	2.300	EUR	1.563.172,65	0,13
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.300	EUR	-1.563.172,65	-0,13
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	5.200	EUR	197.169,91	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	2.300	EUR	87.209,77	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.300	EUR	-87.209,77	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.200	EUR	-197.169,91	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	4.700	EUR	269.746,40	0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-4.700	EUR	-269.746,40	-0,02
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jan 2024 (put, strike 3.900,00)	-10.000	EUR	-1.592.893,87	-0,14
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.000,00)	4.500	EUR	130.582,48	0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.000,00)	-4.500	EUR	-130.582,48	-0,01
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.600,00)	8.000	EUR	574.384,14	0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.600,00)	-8.000	EUR	-574.384,14	-0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.700,00)	-5.000	EUR	-417.664,60	-0,04
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 3.000,00)	-3.500	EUR	-2.484.165,64	-0,21
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-3.500	EUR	-339.941,29	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-11.000	EUR	-1.068.386,91	-0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-12.000	EUR	-1.165.513,00	-0,10
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-12.300	EUR	-1.194.650,82	-0,10
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	7.000	EUR	789.782,16	0,07
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-7.000	EUR	-789.782,16	-0,07
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	2.500	EUR	1.378.622,22	0,12
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.300	EUR	-1.268.332,44	-0,11
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.300	EUR	-1.268.332,44	-0,11
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-1.378.622,22	-0,12
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	2.500	EUR	327.949,97	0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.300	EUR	-301.713,97	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.300	EUR	-301.713,97	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.500	EUR	-327.949,97	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-7.500	EUR	-983.849,91	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-8.500	EUR	-1.115.029,90	-0,09
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-10.000	EUR	-1.311.799,88	-0,11
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-11.000	EUR	-1.442.979,87	-0,12
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	4.000	EUR	1.906.504,80	0,16
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	-4.000	EUR	-1.906.504,80	-0,16
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	4.000	EUR	610.162,46	0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	-4.000	EUR	-610.162,46	-0,05
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.200	EUR	-891.443,74	-0,08
Euro Stoxx 50 [®] Index	Jun 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.200	EUR	-390.058,74	-0,03
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-5.200	EUR	-734.195,72	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-10.000	EUR	-1.592.893,87	-0,14
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-2.591.638,51	-0,22
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-718.980,06	-0,06
Euro Stoxx 50 [®] Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-718.980,06	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.000	EUR	-718.980,06	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.500	EUR	-808.852,57	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.500	EUR	-709.606,68	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.700	EUR	-750.155,63	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-4.200	EUR	-851.528,01	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-7.500	EUR	-1.520.585,74	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-2.500	EUR	-1.269.907,58	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-2.500	EUR	-571.550,71	-0,05
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 80,00)	120.000	EUR	3.398.296,32	0,29
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 80,00)	-120.000	EUR	-3.398.296,32	-0,29
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 80,00)	120.000	EUR	86.441,04	0,01
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 80,00)	-120.000	EUR	-86.441,04	-0,01
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 90,00)	150.000	EUR	2.901.820,20	0,25
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 90,00)	-150.000	EUR	-2.901.820,20	-0,25
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 90,00)	150.000	EUR	235.715,10	0,02
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 90,00)	-150.000	EUR	-235.715,10	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2023 (call, strike 4.410,00)	-3.135	USD	-408.864,68	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2023 (put, strike 4.410,00)	3.135	USD	181.782,24	0,02
S&P 500 Index	Sep 2023 (call, strike 4.412,00)	1.560	USD	201.415,32	0,02
S&P 500 Index	Sep 2023 (call, strike 4.412,00)	-1.320	USD	-170.428,34	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2023 (put, strike 4.412,00)	1.320	USD	77.207,23	0,01
S&P 500 Index	Sep 2023 (put, strike 4.412,00)	-1.560	USD	-91.244,91	-0,01
S&P 500 Index	Sep 2023 (call, strike 4.440,00)	-3.520	USD	-391.840,25	-0,03
S&P 500 Index	Sep 2023 (put, strike 4.440,00)	3.520	USD	232.572,57	0,02
S&P 500 Index	Sep 2023 (call, strike 4.481,00)	-2.800	USD	-243.969,53	-0,02
S&P 500 Index	Sep 2023 (put, strike 4.481,00)	2.800	USD	221.319,08	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	5.500	USD	5.204.028,62	0,44
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	5.000	USD	4.730.935,11	0,40
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	3.000	USD	2.838.561,06	0,24
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-1.000	USD	-946.187,02	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-1.500	USD	-1.419.280,53	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-2.500	USD	-2.365.467,55	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-3.500	USD	-3.311.654,57	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-4.730.935,11	-0,40
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	9.800	USD	164.980,68	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	6.500	USD	109.425,97	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	5.500	USD	92.591,20	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	5.000	USD	84.173,82	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	3.400	USD	57.238,19	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	3.000	USD	50.504,29	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	1.300	USD	21.885,20	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.000	USD	-16.834,77	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.100	USD	-18.518,24	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.500	USD	-25.252,14	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-2.500	USD	-42.086,91	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-3.500	USD	-58.921,67	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-84.173,82	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-7.000	USD	-117.843,35	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-12.900	USD	-217.168,45	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	6.300	USD	5.418.098,25	0,46
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	3.200	USD	2.752.049,90	0,23
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	200	USD	172.003,12	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-2.300	USD	-1.978.035,87	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-3.400	USD	-2.924.053,02	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-4.000	USD	-3.440.062,38	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	11.600	USD	232.580,84	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	7.000	USD	140.350,50	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	7.000	USD	140.350,50	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	6.300	USD	126.315,45	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	5.800	USD	116.290,42	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	4.500	USD	90.225,33	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	3.200	USD	64.160,23	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	500	USD	10.025,03	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	200	USD	4.010,02	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-500	USD	-10.025,03	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-1.300	USD	-26.065,10	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-2.300	USD	-46.115,17	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-3.400	USD	-68.170,25	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.000	USD	-80.200,29	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.500	USD	-90.225,33	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.500	USD	-90.225,33	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-11.600	USD	-232.580,84	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-14.000	USD	-280.701,02	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	4.100	USD	3.175.628,44	0,27
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	3.200	USD	2.478.539,27	0,21
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	2.900	USD	2.246.176,21	0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	1.800	USD	1.394.178,34	0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-800	USD	-619.634,82	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-1.400	USD	-1.084.360,93	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-2.500	USD	-1.936.358,81	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.500	USD	-2.710.902,33	-0,23
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.800	USD	-2.943.265,38	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	6.300	USD	150.977,83	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	6.000	USD	143.788,41	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	6.000	USD	143.788,41	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	5.000	USD	119.823,68	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	4.700	USD	112.634,25	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	4.100	USD	98.255,41	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	3.200	USD	76.687,15	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	2.900	USD	69.497,73	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	1.800	USD	43.136,53	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	1.200	USD	28.757,68	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	600	USD	14.378,85	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-400	USD	-9.585,89	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-800	USD	-19.171,79	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-1.400	USD	-33.550,63	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-2.500	USD	-59.911,83	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.500	USD	-83.876,57	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.800	USD	-91.065,99	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.300	USD	-127.013,09	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.500	USD	-131.806,04	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.800	USD	-138.995,46	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.300	USD	-150.977,83	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.500	USD	-155.770,77	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.750,00)	2.500	USD	1.830.340,12	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.750,00)	-2.500	USD	-1.830.340,12	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.750,00)	2.500	USD	65.626,57	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.750,00)	-2.500	USD	-65.626,57	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	3.500	USD	2.415.175,24	0,20
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	3.000	USD	2.070.150,21	0,18
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	2.900	USD	2.001.145,20	0,17

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	2.900	USD	2.001.145,20	0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	500	USD	345.025,03	0,03
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-2.001.145,20	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-2.001.145,20	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-2.415.175,24	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-2.415.175,24	-0,20
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	8.500	USD	245.293,14	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	8.500	USD	245.293,14	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	6.900	USD	199.120,31	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	6.500	USD	187.577,10	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	5.000	USD	144.290,08	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	5.000	USD	144.290,08	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	3.500	USD	101.003,06	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	3.000	USD	86.574,05	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	2.900	USD	83.688,25	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	2.900	USD	83.688,25	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	500	USD	14.429,01	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-1.900	USD	-54.830,23	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-83.688,25	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-83.688,25	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-101.003,06	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-101.003,06	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-144.290,08	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-144.290,08	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-144.290,08	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-6.500	USD	-187.577,10	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-8.500	USD	-245.293,14	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-8.500	USD	-245.293,14	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.850,00)	3.500	USD	2.268.870,36	0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.850,00)	-3.500	USD	-2.268.870,36	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.850,00)	3.500	USD	111.124,96	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.850,00)	-3.500	USD	-111.124,96	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	5.500	USD	3.337.235,30	0,28
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	4.700	USD	2.851.819,26	0,24
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	3.200	USD	1.941.664,17	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	3.100	USD	1.880.987,17	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	3.100	USD	1.880.987,17	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.800	USD	1.698.956,15	0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.700	USD	1.638.279,15	0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.700	USD	1.638.279,15	0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.500	USD	1.516.925,13	0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.500	USD	1.516.925,13	0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.400	USD	1.456.248,13	0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	2.400	USD	1.456.248,13	0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-900	USD	-546.093,05	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-1.456.248,13	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-1.516.925,13	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-1.698.956,15	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-1.698.956,15	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-1.880.987,17	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.600	USD	-2.791.142,25	-0,24
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-2.912.496,26	-0,25
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-5.600	USD	-3.397.912,30	-0,29
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-8.100	USD	-4.914.837,43	-0,42
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	5.500	USD	192.306,05	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	4.700	USD	164.334,26	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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	3.200	USD	111.887,16	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	3.100	USD	108.390,69	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	3.100	USD	108.390,69	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.800	USD	97.901,26	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.700	USD	94.404,79	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.700	USD	94.404,79	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.500	USD	87.411,84	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.500	USD	87.411,84	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.400	USD	83.915,37	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	2.400	USD	83.915,37	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-900	USD	-31.468,27	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-83.915,37	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-87.411,84	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-97.901,26	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-97.901,26	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-108.390,69	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.600	USD	-160.837,79	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-167.830,73	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-5.600	USD	-195.802,53	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-8.100	USD	-283.214,37	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	3.600	USD	1.889.829,44	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	2.500	USD	1.312.381,56	0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-1.312.381,56	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-1.889.829,44	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	6.000	USD	255.204,23	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	5.800	USD	246.697,42	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	5.000	USD	212.670,20	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	3.600	USD	153.122,54	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	2.500	USD	106.335,10	0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	700	USD	29.773,83	0,00
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-106.335,10	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-153.122,54	-0,01
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-5.700	USD	-242.444,02	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-5.800	USD	-246.697,42	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-255.204,23	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.100,00)	4.800	USD	249.542,65	0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.100,00)	-4.800	USD	-249.542,65	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.600,00)	-2.800	USD	-2.696.636,51	-0,23
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.600,00)	-2.900	USD	-2.792.944,96	-0,24
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.600,00)	-2.800	USD	-149.607,55	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.600,00)	-2.900	USD	-154.950,69	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.700,00)	-7.000	USD	-431.111,38	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.700,00)	-13.000	USD	-800.635,42	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.800,00)	-2.800	USD	-2.258.944,09	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.800,00)	-5.500	USD	-4.437.211,59	-0,38
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.800,00)	-6.300	USD	-5.082.624,19	-0,43
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-2.800	USD	-198.489,15	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-5.500	USD	-389.889,40	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.000	USD	-425.333,89	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.300	USD	-446.600,58	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.500	USD	-460.778,38	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.700	USD	-474.956,17	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.850,00)	-11.000	USD	-836.263,73	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-1.200	USD	-876.604,27	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-2.264.561,03	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-3.200	USD	-2.337.611,38	-0,20

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-3.200	USD	-2.337.611,38	-0,20
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-3.300	USD	-2.410.661,74	-0,20
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-4.500	USD	-3.287.266,00	-0,28
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 3.900,00)	-4.700	USD	-3.433.366,72	-0,29
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	8.100	USD	660.271,59	0,06
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-1.200	USD	-97.818,01	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-252.696,54	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-3.200	USD	-260.848,04	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-3.200	USD	-260.848,04	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-3.300	USD	-268.999,53	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-4.500	USD	-366.817,55	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-4.700	USD	-383.120,55	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-407.575,06	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.300	USD	-432.029,56	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-6.000	USD	-489.090,06	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-6.500	USD	-529.847,57	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-8.000	USD	-652.120,09	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 3.900,00)	-8.100	USD	-660.271,59	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-500	USD	-327.853,30	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-1.639.266,52	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-3.200	USD	-2.098.261,14	-0,18
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-3.400	USD	-2.229.402,46	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.000,00)	-4.500	USD	-2.950.679,73	-0,25
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	6.000	USD	561.637,65	0,05
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-500	USD	-46.803,13	0,00
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-234.015,69	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-3.000	USD	-280.818,83	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-3.200	USD	-299.540,08	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-3.400	USD	-318.261,34	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.400	USD	-411.867,62	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.500	USD	-421.228,24	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.500	USD	-421.228,24	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-561.637,65	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-561.637,65	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-6.500	USD	-608.440,80	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-9.000	USD	-842.456,48	-0,07
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-9.500	USD	-889.259,62	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.000,00)	-10.200	USD	-954.784,01	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	-2.300	USD	-1.339.939,13	-0,11
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	-3.000	USD	-1.747.746,69	-0,15
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	-3.500	USD	-2.039.037,80	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2024 (call, strike 4.100,00)	-4.400	USD	-2.563.361,81	-0,22
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	-2.300	USD	-246.951,27	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.000	USD	-322.110,35	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	-3.500	USD	-375.795,41	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2024 (put, strike 4.100,00)	-4.400	USD	-472.428,52	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.800,00)	-6.000	USD	-651.070,86	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 3.900,00)	-4.000	USD	-3.299.772,84	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-4.124.716,06	-0,35
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-4.124.716,06	-0,35
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-4.000	USD	-487.834,30	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-609.792,88	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.000	USD	-609.792,88	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-5.500	USD	-670.772,16	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-6.100	USD	-743.947,31	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 3.900,00)	-10.000	USD	-1.219.585,76	-0,10

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-1.886.912,50	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.000,00)	-3.000	USD	-2.264.295,00	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-341.696,77	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-3.000	USD	-410.036,13	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.500	USD	-615.054,20	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.700	USD	-642.389,94	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-4.900	USD	-669.725,68	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.200	USD	-710.729,29	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.500	USD	-751.732,91	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-5.500	USD	-751.732,91	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-820.072,26	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.050,00)	-5.000	USD	-3.600.731,32	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.050,00)	-5.000	USD	-722.545,72	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.100,00)	-2.500	USD	-1.714.877,64	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-2.500	USD	-381.907,77	-0,03
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-6.000	USD	-916.578,64	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.100,00)	-6.500	USD	-992.960,20	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2024 (call, strike 4.200,00)	-3.000	USD	-1.856.432,27	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-3.000	USD	-511.563,46	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.200,00)	-10.000	USD	-1.705.211,53	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-9.500	USD	-1.804.180,71	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2024 (put, strike 4.300,00)	-11.000	USD	-2.089.051,34	-0,18
Swiss Market Index	Sep 2023 (call, strike 11.244,00)	-745	CHF	-182.754,61	-0,02
Swiss Market Index	Sep 2023 (put, strike 11.244,00)	745	CHF	126.192,08	0,01
Swiss Market Index	Sep 2023 (call, strike 11.414,00)	-600	CHF	-88.270,09	-0,01
Swiss Market Index	Sep 2023 (put, strike 11.414,00)	600	CHF	146.832,63	0,01
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.000,00)	1.900	CHF	130.393,45	0,01
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.000,00)	1.900	CHF	130.393,45	0,01
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.000,00)	-3.800	CHF	-260.786,89	-0,02
Swiss Market Index	Dez 2023 (call, strike 10.800,00)	1.050	CHF	764.416,19	0,06
Swiss Market Index	Dez 2023 (call, strike 10.800,00)	-1.050	CHF	-764.416,19	-0,06
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.800,00)	1.050	CHF	174.609,30	0,01
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.800,00)	-1.050	CHF	-174.609,30	-0,01
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 10.500,00)	-2.000	CHF	-885.903,44	-0,08
Swiss Market Index	Dez 2024 (put, strike 11.000,00)	-1.800	CHF	-1.081.655,49	-0,09
Summe Indexoptionen				-161.375.734,60	-13,68
				-161.375.734,60	-13,68
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ABB Ltd.	Dez 2024 (put, strike 33,00)	6.000	CHF	1.513.669,46	0,13
Allianz SE	Jun 2024 (put, strike 180,00)	3.200	EUR	1.966.233,60	0,17
Allianz SE	Jun 2024 (put, strike 190,00)	2.000	EUR	1.646.309,00	0,14
Allianz SE	Jun 2024 (call, strike 200,00)	1.800	EUR	4.683.699,18	0,40
Allianz SE	Jun 2024 (put, strike 200,00)	1.800	EUR	1.981.808,28	0,17
Allianz SE	Dez 2024 (put, strike 180,00)	1.700	EUR	1.413.626,16	0,12
Allianz SE	Dez 2024 (call, strike 200,00)	1.400	EUR	4.007.679,06	0,34
Allianz SE	Dez 2024 (put, strike 200,00)	6.950	EUR	9.508.657,79	0,81
Allianz SE	Dez 2024 (call, strike 220,00)	2.000	EUR	3.266.407,80	0,28
Allianz SE	Dez 2024 (put, strike 220,00)	-2.000	EUR	-4.063.707,00	-0,34
American Express Co.	Jun 2024 (put, strike 160,00)	160.000	USD	1.485.628,01	0,13
American International Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 57,50)	350.000	USD	1.276.318,15	0,11
American International Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 57,50)	-350.000	USD	-1.276.318,15	-0,11

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktienoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermögen (%)
American International Group Inc.	Jan 2024 (call, strike 60,00)	150.000	USD	494.104,95	0,04
American International Group Inc.	Jan 2024 (call, strike 60,00)	-150.000	USD	-494.104,95	-0,04
American International Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 60,00)	150.000	USD	710.676,63	0,06
American International Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 60,00)	-150.000	USD	-710.676,63	-0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	170.000	USD	152.410,38	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	-170.000	USD	-152.410,38	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	80.000	USD	3.566.210,96	0,30
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	80.000	USD	3.566.210,96	0,30
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	-160.000	USD	-7.132.421,92	-0,60
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	80.000	USD	113.054,67	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	80.000	USD	113.054,67	0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	-160.000	USD	-226.109,33	-0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 160,00)	150.000	USD	344.100,69	0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 160,00)	-150.000	USD	-344.100,69	-0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (call, strike 135,00)	160.000	USD	9.624.992,41	0,82
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 135,00)	160.000	USD	297.850,63	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 140,00)	280.000	USD	615.025,52	0,05
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (call, strike 145,00)	100.000	USD	5.222.623,65	0,44
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 145,00)	150.000	USD	397.065,67	0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 145,00)	100.000	USD	264.710,45	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (call, strike 150,00)	65.000	USD	3.148.739,95	0,27
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 150,00)	170.000	USD	548.790,23	0,05
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 150,00)	150.000	USD	484.226,67	0,04
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 150,00)	65.000	USD	209.831,56	0,02
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (call, strike 160,00)	90.000	USD	3.704.520,93	0,31
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 160,00)	140.000	USD	657.618,24	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 160,00)	90.000	USD	422.754,58	0,04
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 170,00)	120.000	USD	775.449,57	0,07
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2024 (put, strike 170,00)	120.000	USD	775.449,57	0,07
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 150,00)	150.000	USD	812.094,91	0,07
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 155,00)	120.000	USD	750.865,08	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 160,00)	120.000	USD	5.535.895,44	0,47
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	150.000	USD	1.083.528,78	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	150.000	USD	1.083.528,78	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 160,00)	120.000	USD	866.823,02	0,07
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 165,00)	130.000	USD	1.082.969,11	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	70.000	USD	2.790.047,94	0,24
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (call, strike 170,00)	60.000	USD	2.391.469,66	0,20
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	150.000	USD	1.435.135,93	0,12
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	150.000	USD	1.435.135,93	0,12
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	120.000	USD	1.148.108,74	0,10
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	70.000	USD	669.730,10	0,06
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 170,00)	60.000	USD	574.054,37	0,05
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2025 (put, strike 175,00)	120.000	USD	1.328.992,63	0,11
Apple, Inc.	Jun 2024 (put, strike 150,00)	130.000	USD	419.663,12	0,04
AXA S.A.	Jun 2024 (put, strike 24,00)	18.000	EUR	2.383.709,40	0,20
AXA S.A.	Jun 2024 (call, strike 25,00)	6.000	EUR	2.235.102,60	0,19
AXA S.A.	Jun 2024 (put, strike 25,00)	75.000	EUR	12.234.832,50	1,04
AXA S.A.	Jun 2024 (call, strike 26,00)	8.000	EUR	2.416.277,60	0,20
AXA S.A.	Jun 2024 (put, strike 26,00)	8.000	EUR	1.599.717,60	0,14
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 24,00)	26.500	EUR	4.393.278,65	0,37
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 25,00)	20.000	EUR	3.945.974,00	0,33
AXA S.A.	Dez 2024 (call, strike 26,00)	19.500	EUR	6.028.267,05	0,51
AXA S.A.	Dez 2024 (call, strike 26,00)	10.000	EUR	3.085.312,00	0,26

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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktienoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
AXA S.A.	Dez 2024 (call, strike 26,00)	3.200	EUR	1.058.549,12	0,09
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 26,00)	9.200	EUR	2.153.436,64	0,18
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 26,00)	-10.000	EUR	-2.199.515,00	-0,19
AXA S.A.	Dez 2024 (put, strike 26,00)	-19.500	EUR	-4.281.289,35	-0,36
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 30,00)	400.000	USD	626.449,13	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 30,00)	260.000	USD	407.191,93	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 30,00)	-260.000	USD	-407.191,93	-0,03
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 30,00)	-400.000	USD	-626.449,13	-0,05
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	400.000	USD	962.219,62	0,08
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	260.000	USD	625.442,75	0,05
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	100.000	USD	240.554,90	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	-100.000	USD	-240.554,90	-0,02
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	-260.000	USD	-625.442,75	-0,05
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	-400.000	USD	-962.219,62	-0,08
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 31,00)	600.000	USD	713.319,71	0,06
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 31,00)	-600.000	USD	-713.319,71	-0,06
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 31,00)	600.000	USD	1.766.582,58	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 31,00)	-600.000	USD	-1.766.582,58	-0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	400.000	USD	357.670,39	0,03
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	320.000	USD	286.136,32	0,02
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	-320.000	USD	-286.136,32	-0,02
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	-400.000	USD	-357.670,39	-0,03
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	1.000.000	USD	3.572.429,88	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	700.000	USD	2.500.700,92	0,21
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	500.000	USD	1.786.214,94	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	400.000	USD	1.428.971,95	0,12
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	320.000	USD	1.143.177,56	0,10
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	-320.000	USD	-1.143.177,56	-0,10
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	-400.000	USD	-1.428.971,95	-0,12
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	-1.000.000	USD	-3.572.429,88	-0,30
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	-1.200.000	USD	-4.286.915,86	-0,36
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 26,00)	400.000	USD	1.801.988,27	0,15
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 26,00)	400.000	USD	601.258,30	0,05
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 27,00)	400.000	USD	1.572.037,76	0,13
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 27,00)	400.000	USD	724.722,27	0,06
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 28,00)	350.000	USD	1.187.780,66	0,10
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 28,00)	350.000	USD	756.828,32	0,06
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 33,00)	650.000	USD	878.912,01	0,07
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 33,00)	400.000	USD	540.868,93	0,05
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 33,00)	-650.000	USD	-878.912,01	-0,07
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 33,00)	650.000	USD	3.021.836,30	0,26
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 33,00)	400.000	USD	1.859.591,57	0,16
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 33,00)	-650.000	USD	-3.021.836,30	-0,26
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 34,00)	400.000	USD	441.561,14	0,04
Bank of America Corp.	Jun 2024 (call, strike 34,00)	-400.000	USD	-441.561,14	-0,04
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 34,00)	700.000	USD	3.732.865,81	0,32
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 34,00)	400.000	USD	2.133.066,18	0,18
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 34,00)	-400.000	USD	-2.133.066,18	-0,18
Bank of America Corp.	Jun 2024 (put, strike 34,00)	-700.000	USD	-3.732.865,81	-0,32
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 26,00)	750.000	USD	1.518.941,11	0,13
Bank of America Corp.	Jan 2025 (call, strike 28,00)	350.000	USD	1.487.877,27	0,13
Bank of America Corp.	Jan 2025 (put, strike 28,00)	350.000	USD	961.319,75	0,08
Bayerische Motoren Werke AG	Jun 2024 (put, strike 86,00)	4.600	EUR	1.199.639,06	0,10
Bayerische Motoren Werke AG	Jun 2024 (put, strike 88,00)	4.800	EUR	1.390.150,08	0,12
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2024 (call, strike 92,00)	1.200	EUR	3.253.626,60	0,28
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2024 (put, strike 92,00)	1.200	EUR	601.220,16	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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktienoptionen					
Underlying	Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)	
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2024 (put, strike 95,00)	1.800	EUR	1.028.472,30	0,09
BNP Paribas S.A.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	6.000	EUR	1.924.712,40	0,16
BNP Paribas S.A.	Jun 2024 (call, strike 52,00)	2.600	EUR	2.564.653,78	0,22
BNP Paribas S.A.	Jun 2024 (put, strike 52,00)	2.600	EUR	997.992,58	0,08
Broadcom Inc.	Jun 2024 (put, strike 600,00)	35.000	USD	559.373,53	0,05
Broadcom Inc.	Jun 2024 (put, strike 600,00)	-35.000	USD	-559.373,53	-0,05
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	450.000	USD	1.199.012,01	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	450.000	USD	1.199.012,01	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	-400.000	USD	-1.065.788,45	-0,09
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	-500.000	USD	-1.332.235,56	-0,11
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	280.000	USD	742.011,55	0,06
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	250.000	USD	662.510,31	0,06
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	220.000	USD	583.009,07	0,05
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	-220.000	USD	-583.009,07	-0,05
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	-530.000	USD	-1.404.521,86	-0,12
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	280.000	USD	1.038.598,28	0,09
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	250.000	USD	927.319,89	0,08
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	220.000	USD	816.041,50	0,07
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	-220.000	USD	-816.041,50	-0,07
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	-530.000	USD	-1.965.918,17	-0,17
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 45,00)	700.000	USD	2.588.278,55	0,22
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 45,00)	500.000	USD	1.848.770,39	0,16
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 45,00)	-700.000	USD	-2.588.278,55	-0,22
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (call, strike 50,00)	300.000	USD	864.005,77	0,07
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (call, strike 50,00)	250.000	USD	720.004,81	0,06
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (call, strike 50,00)	250.000	USD	720.004,81	0,06
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (call, strike 50,00)	-250.000	USD	-720.004,81	-0,06
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (call, strike 50,00)	-300.000	USD	-864.005,77	-0,07
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	300.000	USD	1.786.594,59	0,15
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	250.000	USD	1.488.828,83	0,13
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	250.000	USD	1.488.828,83	0,13
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	-250.000	USD	-1.488.828,83	-0,13
Citigroup, Inc.	Jun 2024 (put, strike 50,00)	-300.000	USD	-1.786.594,59	-0,15
Citigroup, Inc.	Jan 2025 (put, strike 45,00)	460.000	USD	2.122.404,58	0,18
Credit Agricole S.A.	Jun 2024 (put, strike 9,00)	20.000	EUR	864.356,00	0,07
Credit Agricole S.A.	Jun 2024 (call, strike 10,00)	40.000	EUR	6.748.728,00	0,57
Credit Agricole S.A.	Jun 2024 (put, strike 10,00)	40.000	EUR	2.721.832,00	0,23
Credit Agricole S.A.	Dez 2024 (put, strike 9,60)	48.000	EUR	3.666.763,20	0,31
Credit Agricole S.A.	Dez 2024 (put, strike 10,00)	32.000	EUR	2.824.780,80	0,24
CVS Health Corp.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	90.000	USD	13.200,14	0,00
CVS Health Corp.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	-90.000	USD	-13.200,14	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 310,00)	60.000	USD	876.604,73	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 310,00)	-60.000	USD	-876.604,73	-0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	55.000	USD	1.301.342,75	0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	35.000	USD	828.127,20	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	-35.000	USD	-828.127,20	-0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	-55.000	USD	-1.301.342,75	-0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	70.000	USD	1.262.632,03	0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	55.000	USD	992.068,02	0,08
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	35.000	USD	631.316,01	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	-35.000	USD	-631.316,01	-0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	-55.000	USD	-992.068,02	-0,08
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	-70.000	USD	-1.262.632,03	-0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 330,00)	25.000	USD	466.811,09	0,04
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 330,00)	-25.000	USD	-466.811,09	-0,04

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

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying	Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)	
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 330,00)	60.000	USD	1.326.553,69	0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 330,00)	25.000	USD	552.730,71	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 330,00)	-25.000	USD	-552.730,71	-0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 330,00)	-60.000	USD	-1.326.553,69	-0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (call, strike 320,00)	31.000	USD	1.004.037,38	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (put, strike 320,00)	31.000	USD	741.811,81	0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (call, strike 350,00)	35.000	USD	669.694,75	0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (call, strike 350,00)	-35.000	USD	-669.694,75	-0,06
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (put, strike 350,00)	70.000	USD	2.640.788,88	0,22
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (put, strike 350,00)	35.000	USD	1.320.394,45	0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (put, strike 350,00)	-35.000	USD	-1.320.394,45	-0,11
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2024 (put, strike 350,00)	-70.000	USD	-2.640.788,88	-0,22
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 300,00)	70.000	USD	1.625.101,65	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (call, strike 310,00)	40.000	USD	1.834.950,72	0,16
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 310,00)	40.000	USD	1.057.473,11	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2025 (put, strike 320,00)	60.000	USD	1.823.161,48	0,16
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	120.000	USD	5.112.011,88	0,43
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	90.000	USD	3.834.008,91	0,32
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	-90.000	USD	-3.834.008,91	-0,33
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	-120.000	USD	-5.112.011,88	-0,43
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	300.000	USD	215.284,23	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	260.000	USD	186.579,67	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	200.000	USD	143.522,82	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	120.000	USD	86.113,69	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	90.000	USD	64.585,27	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	-90.000	USD	-64.585,27	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	-120.000	USD	-86.113,69	-0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	-760.000	USD	-545.386,73	-0,05
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 105,00)	250.000	USD	233.310,49	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 105,00)	-250.000	USD	-233.310,49	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	200.000	USD	240.928,32	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	160.000	USD	192.742,66	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	-160.000	USD	-192.742,66	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	-200.000	USD	-240.928,32	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	200.000	USD	405.632,81	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	170.000	USD	344.787,89	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	160.000	USD	324.506,25	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	-200.000	USD	-405.632,81	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	-330.000	USD	-669.294,14	-0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 125,00)	90.000	USD	1.993.755,32	0,17
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 125,00)	80.000	USD	1.772.226,95	0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 125,00)	-170.000	USD	-3.765.982,26	-0,32
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	90.000	USD	238.131,83	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	80.000	USD	211.672,74	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	-170.000	USD	-449.804,57	-0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	120.000	USD	2.209.163,92	0,19
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	70.000	USD	1.288.678,96	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	70.000	USD	1.288.678,96	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	-120.000	USD	-2.209.163,92	-0,19
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	-140.000	USD	-2.577.357,91	-0,22
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	120.000	USD	406.956,52	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	70.000	USD	237.391,30	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	70.000	USD	237.391,30	0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	-120.000	USD	-406.956,52	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	-140.000	USD	-474.782,60	-0,04

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

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	110.000	USD	1.058.346,40	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	-110.000	USD	-1.058.346,40	-0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (call, strike 120,00)	110.000	USD	3.161.102,97	0,27
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 120,00)	400.000	USD	1.477.109,44	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 120,00)	250.000	USD	923.193,40	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 120,00)	200.000	USD	738.554,72	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 120,00)	110.000	USD	406.205,10	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (call, strike 125,00)	175.000	USD	4.408.783,99	0,37
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 125,00)	340.000	USD	1.540.428,43	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 125,00)	175.000	USD	792.867,58	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (call, strike 130,00)	190.000	USD	4.136.260,47	0,35
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (call, strike 130,00)	140.000	USD	3.047.770,87	0,26
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (call, strike 130,00)	135.000	USD	2.938.921,92	0,25
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	330.000	USD	1.815.571,68	0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	300.000	USD	1.650.519,71	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	190.000	USD	1.045.329,15	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	180.000	USD	990.311,82	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	140.000	USD	770.242,53	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jun 2024 (put, strike 130,00)	135.000	USD	742.733,87	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 130,00)	150.000	USD	3.772.414,34	0,32
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (call, strike 130,00)	150.000	USD	3.772.414,34	0,32
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	160.000	USD	1.259.914,65	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	150.000	USD	1.181.169,98	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	150.000	USD	1.181.169,98	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2025 (put, strike 130,00)	140.000	USD	1.102.425,32	0,09
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2024 (put, strike 60,00)	4.000	EUR	1.142.482,40	0,10
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2024 (call, strike 64,00)	2.800	EUR	3.878.774,76	0,33
Mercedes-Benz Group AG	Jun 2024 (put, strike 64,00)	2.800	EUR	1.085.052,92	0,09
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2024 (put, strike 60,00)	2.800	EUR	1.104.229,00	0,09
Mercedes-Benz Group AG	Dez 2024 (put, strike 70,00)	3.000	EUR	2.169.057,90	0,18
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 65,00)	250.000	USD	2.185.682,17	0,19
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 65,00)	-250.000	USD	-2.185.682,17	-0,19
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 67,50)	300.000	USD	3.184.299,54	0,27
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 67,50)	-300.000	USD	-3.184.299,54	-0,27
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	150.000	USD	87.841,02	0,01
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	130.000	USD	76.128,88	0,01
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	-130.000	USD	-76.128,88	-0,01
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	-150.000	USD	-87.841,02	-0,01
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 60,00)	200.000	USD	831.724,47	0,07
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 60,00)	150.000	USD	623.793,35	0,05
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 60,00)	-150.000	USD	-623.793,35	-0,05
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 60,00)	-200.000	USD	-831.724,47	-0,07
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 60,00)	200.000	USD	1.336.222,91	0,11
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 60,00)	150.000	USD	1.002.167,19	0,08
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 60,00)	-150.000	USD	-1.002.167,19	-0,09
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 60,00)	-200.000	USD	-1.336.222,91	-0,11
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 70,00)	140.000	USD	212.969,00	0,02
MetLife, Inc.	Jun 2024 (call, strike 70,00)	-140.000	USD	-212.969,00	-0,02
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 70,00)	350.000	USD	4.600.840,79	0,39
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 70,00)	140.000	USD	1.840.336,32	0,16
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 70,00)	-140.000	USD	-1.840.336,32	-0,16
MetLife, Inc.	Jun 2024 (put, strike 70,00)	-350.000	USD	-4.600.840,79	-0,39
Starbucks Corp.	Jan 2025 (put, strike 95,00)	200.000	USD	1.587.456,10	0,13
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	200.000	USD	479.453,53	0,04
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	-200.000	USD	-479.453,53	-0,04
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	150.000	USD	647.725,71	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 2023 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying	Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)	
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	-150.000	USD	-647.725,71	-0,05
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (call, strike 140,00)	65.000	USD	621.810,85	0,05
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (call, strike 140,00)	-65.000	USD	-621.810,85	-0,05
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	65.000	USD	490.361,79	0,04
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	-65.000	USD	-490.361,79	-0,04
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	62.000	USD	328.384,39	0,03
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	-62.000	USD	-328.384,39	-0,03
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	62.000	USD	782.642,77	0,07
T-Mobile US Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	-62.000	USD	-782.642,77	-0,07
T-Mobile US Inc.	Jan 2025 (call, strike 140,00)	100.000	USD	1.911.451,51	0,16
T-Mobile US Inc.	Jan 2025 (put, strike 140,00)	100.000	USD	1.239.198,26	0,11
U.S. Bancorp	Jan 2024 (put, strike 40,00)	500.000	USD	3.558.862,51	0,30
U.S. Bancorp	Jan 2024 (put, strike 40,00)	-500.000	USD	-3.558.862,51	-0,30
UnitedHealth Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 500,00)	45.000	USD	1.483.745,99	0,13
UnitedHealth Group Inc.	Jan 2024 (put, strike 500,00)	-45.000	USD	-1.483.745,99	-0,13
Zurich Insurance Group AG	Dez 2024 (put, strike 400,00)	5.000	CHF	1.397.664,51	0,12
Summe Aktioptionen				229.893.962,83	19,49
Summe Optionen				68.518.228,23	5,81

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
3M Co. 26,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	37.246,38	0,00
ABB Ltd. 25,19 %	21.06.2024	1.200.000	CHF	-43.351,08	0,00
ABB Ltd. 25,55 %	21.06.2024	798.500	CHF	-33.809,85	0,00
AbbVie, Inc. 25,07 %	21.06.2024	1.500.000	USD	11.271,05	0,00
AbbVie, Inc. 24,92 %	21.06.2024	1.500.000	USD	4.593,46	0,00
AbbVie, Inc. 25,33 %	21.06.2024	1.500.000	USD	9.662,22	0,00
AbbVie, Inc. 25,17 %	21.06.2024	2.500.000	USD	3.393,06	0,00
AbbVie, Inc. 24,99 %	21.06.2024	1.200.000	USD	10.290,41	0,00
AbbVie, Inc. 26,34 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-76.862,69	-0,01
AbbVie, Inc. 26,12 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-10.899,42	0,00
AbbVie, Inc. 27,39 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-20.141,87	0,00
AbbVie, Inc. 30,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-160.191,13	-0,01
AbbVie, Inc. 25,10 %	21.06.2024	1.500.000	USD	6.661,44	0,00
AbbVie, Inc. 33,13 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-95.817,71	-0,01
AbbVie, Inc. 26,61 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-38.688,51	0,00
AbbVie, Inc. 25,60 %	21.06.2024	1.500.000	USD	1.108,35	0,00
AbbVie, Inc. 25,16 %	21.06.2024	1.600.000	USD	6.746,93	0,00
AbbVie, Inc. 32,37 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-89.977,20	-0,01
AbbVie, Inc. 26,18 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-554,76	0,00
AbbVie, Inc. 27,18 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-99.447,43	-0,01
AbbVie, Inc. 25,30 %	21.06.2024	1.200.000	USD	2.536,66	0,00
AbbVie, Inc. 26,91 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-32.920,05	0,00
AbbVie, Inc. 30,85 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-91.124,19	-0,01
AbbVie, Inc. 27,08 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-38.457,22	0,00
AbbVie, Inc. 25,98 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-4.962,49	0,00
AbbVie, Inc. 32,55 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-110.058,52	-0,01
AbbVie, Inc. 26,80 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-22.661,98	0,00
AbbVie, Inc. 26,60 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-15.294,65	0,00
AbbVie, Inc. 26,64 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-15.559,50	0,00
AbbVie, Inc. 26,70 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-31.953,81	0,00
AbbVie, Inc. 30,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-141.275,73	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ABN AMRO Bank N.V. 37,76 %	21.06.2024	800.000	EUR	-56.301,78	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 54,82 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-60.483,89	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 54,03 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-56.475,68	0,00
Aflac, Inc. 25,75 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-89.091,91	-0,01
Aflac, Inc. 27,78 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-80.414,96	-0,01
Aflac, Inc. 32,84 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-94.212,43	-0,01
Aflac, Inc. 25,01 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-63.835,25	-0,01
Aflac, Inc. 32,20 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-88.105,74	-0,01
Aflac, Inc. 25,54 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-49.713,06	0,00
Aflac, Inc. 32,45 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-226.450,57	-0,02
Aflac, Inc. 24,24 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-26.632,14	0,00
Aflac, Inc. 30,10 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-138.530,52	-0,01
Aflac, Inc. 28,41 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-84.225,45	-0,01
Aflac, Inc. 28,79 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-157.992,21	-0,01
Aflac, Inc. 32,09 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-108.336,48	-0,01
Aflac, Inc. 28,55 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-82.610,25	-0,01
Aflac, Inc. 30,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-74.801,74	-0,01
Aflac, Inc. 31,99 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-174.069,06	-0,01
Aflac, Inc. 25,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-88.179,93	-0,01
Aflac, Inc. 30,41 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-91.948,41	-0,01
Aflac, Inc. 32,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-135.090,58	-0,01
Aflac, Inc. 25,08 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-109.115,80	-0,01
Aflac, Inc. 32,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-131.904,70	-0,01
Aflac, Inc. 31,80 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-104.936,42	-0,01
Aflac, Inc. 29,28 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-97.171,72	-0,01
Aflac, Inc. 30,91 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-144.717,11	-0,01
Aflac, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-94.798,91	-0,01
Agilent Technologies, Inc. 29,90 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-36.649,65	0,00
Agnico Eagle Mines Ltd. 41,73 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-103.068,10	-0,01
Agnico Eagle Mines Ltd. 42,07 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-143.074,10	-0,01
Agnico Eagle Mines Ltd. 42,04 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-140.270,12	-0,01
Air Liquide S.A. 24,39 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-47.671,67	0,00
Air Products and Chemicals, Inc. 30,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-119.579,52	-0,01
Airbus SE 33,76 %	21.06.2024	800.000	EUR	-67.793,11	-0,01
Airbus SE 34,14 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-107.071,08	-0,01
Alaska Air Group, Inc. 35,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-109.727,43	-0,01
Alaska Air Group, Inc. 36,18 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-88.239,81	-0,01
Alaska Air Group, Inc. 43,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-176.758,24	-0,02
Alaska Air Group, Inc. 47,04 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-178.940,51	-0,02
Alaska Air Group, Inc. 41,05 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-110.252,07	-0,01
Alcon, Inc. 27,55 %	21.06.2024	1.461.300	CHF	-78.814,23	-0,01
Allianz SE 26,27 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-71.400,19	-0,01
Allianz SE 23,74 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-109.657,54	-0,01
Allianz SE 28,63 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-188.336,18	-0,02
Allianz SE 26,22 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-150.454,50	-0,01
Allianz SE 28,51 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-148.354,92	-0,01
Allianz SE 23,38 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-63.105,80	-0,01
Allianz SE 28,04 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-112.264,78	-0,01
Allianz SE 28,84 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-167.979,46	-0,01
Allianz SE 28,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-147.401,37	-0,01
Allianz SE 25,55 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-107.020,84	-0,01
Allianz SE 27,98 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-131.555,32	-0,01
Allianz SE 25,11 %	21.06.2024	800.000	EUR	-39.687,62	0,00
Allianz SE 23,75 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-62.508,76	-0,01
Allianz SE 29,02 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-104.453,98	-0,01
Allianz SE 27,87 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-110.538,81	-0,01
Allianz SE 29,61 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-131.130,58	-0,01
Allstate Corp./The 31,86 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-20.272,12	0,00
Allstate Corp./The 29,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-5.476,35	0,00
Allstate Corp./The 30,29 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-13.213,92	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Allstate Corp./The 31,52 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-21.087,46	0,00
Allstate Corp./The 30,65 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-13.219,84	0,00
Alphabet, Inc. 35,15 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-102.077,20	-0,01
Alphabet, Inc. 34,59 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-55.677,97	0,00
Alphabet, Inc. 35,54 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-24.567,54	0,00
Amazon.com, Inc. 41,48 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-45.018,96	0,00
Amazon.com, Inc. 39,88 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-85.244,47	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 25,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-24.322,62	0,00
American International Group, Inc. 35,40 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-38.173,81	0,00
American International Group, Inc. 35,88 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-112.464,80	-0,01
American International Group, Inc. 39,23 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-165.386,42	-0,01
American International Group, Inc. 36,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-79.524,64	-0,01
American International Group, Inc. 39,74 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-104.789,60	-0,01
Amgen, Inc. 28,93 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-122.181,14	-0,01
Amgen, Inc. 29,17 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-67.431,28	-0,01
Amgen, Inc. 27,72 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.693,84	-0,01
Amgen, Inc. 26,67 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-51.132,54	0,00
Amgen, Inc. 24,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-50.219,23	0,00
Amgen, Inc. 27,25 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-91.975,40	-0,01
Amgen, Inc. 29,98 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-89.024,59	-0,01
Amgen, Inc. 24,70 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-78.853,02	-0,01
Amgen, Inc. 25,73 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-23.174,35	0,00
Amkor Technology, Inc. 50,69 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-106.912,77	-0,01
Analog Devices, Inc. 35,00 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-62.872,09	-0,01
Analog Devices, Inc. 32,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-65.583,56	-0,01
Analog Devices, Inc. 34,94 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-39.335,91	0,00
Aon Corp. 30,01 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-225.475,85	-0,02
Aon Corp. 25,79 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-53.604,42	0,00
Aon Corp. 30,37 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-117.438,59	-0,01
Aon Corp. 30,18 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-115.149,44	-0,01
Aon Corp. 27,59 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-62.280,65	-0,01
Aon Corp. 27,30 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-158.958,82	-0,01
Aon Corp. 31,84 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-117.650,36	-0,01
Aon Corp. 33,74 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-111.144,92	-0,01
Aon Corp. 26,04 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-56.116,56	0,00
Aon Corp. 29,45 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-172.572,61	-0,01
Aon Corp. 25,81 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-57.059,79	0,00
Aon Corp. 31,28 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-128.406,30	-0,01
Aon Corp. 31,62 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-138.756,11	-0,01
Aon Corp. 29,90 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-72.839,68	-0,01
Aon Corp. 29,21 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-99.956,80	-0,01
Aon Corp. 30,52 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-120.638,23	-0,01
Aon Corp. 26,05 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-43.108,63	0,00
Aon Corp. 32,45 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-197.424,49	-0,02
Aon Corp. 25,92 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-44.910,45	0,00
Aon Corp. 30,89 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-167.936,17	-0,01
Aon Corp. 28,00 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-211.728,31	-0,02
Aon Corp. 27,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-108.575,48	-0,01
Aon Corp. 25,76 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-122.410,42	-0,01
Aon Corp. 31,27 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-111.661,10	-0,01
Aon Corp. 31,73 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-89.022,82	-0,01
Aon Corp. 27,92 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-173.858,71	-0,01
Aon Corp. 33,55 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-112.791,56	-0,01
Aon Corp. 33,17 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-122.495,65	-0,01
Apollo Global Management LLC 33,69 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-42.744,46	0,00
Apple, Inc. 31,13 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-104.789,23	-0,01
Apple, Inc. 27,25 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-36.357,40	0,00
Apple, Inc. 30,58 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-90.719,44	-0,01
Apple, Inc. 35,27 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-101.235,46	-0,01
Apple, Inc. 35,94 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-181.397,39	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Apple, Inc. 29,81 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-95.570,18	-0,01
Apple, Inc. 33,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-244.510,27	-0,02
Apple, Inc. 31,16 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-98.154,09	-0,01
Apple, Inc. 34,39 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-89.871,81	-0,01
Apple, Inc. 31,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-74.880,59	-0,01
Apple, Inc. 35,68 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-70.246,43	-0,01
Apple, Inc. 29,91 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-141.094,64	-0,01
Apple, Inc. 36,21 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-99.325,45	-0,01
Apple, Inc. 31,97 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-143.264,99	-0,01
Apple, Inc. 27,10 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-28.243,70	0,00
Apple, Inc. 32,63 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-198.998,85	-0,02
Apple, Inc. 34,02 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-111.832,06	-0,01
Apple, Inc. 29,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-167.713,08	-0,01
Apple, Inc. 36,24 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-151.647,85	-0,01
Apple, Inc. 35,72 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-71.666,66	-0,01
Apple, Inc. 30,03 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-135.758,75	-0,01
Apple, Inc. 28,23 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-31.409,48	0,00
Apple, Inc. 33,00 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-118.708,77	-0,01
Apple, Inc. 26,68 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-26.145,80	0,00
Apple, Inc. 30,30 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-94.085,61	-0,01
Apple, Inc. 37,53 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-116.975,35	-0,01
Apple, Inc. 27,65 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-30.637,72	0,00
Apple, Inc. 32,93 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-164.480,30	-0,01
Apple, Inc. 31,07 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-164.075,29	-0,01
Apple, Inc. 30,93 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-76.747,87	-0,01
Apple, Inc. 31,80 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-108.254,28	-0,01
Apple, Inc. 32,44 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-116.884,79	-0,01
Apple, Inc. 27,03 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-24.090,71	0,00
Apple, Inc. 32,07 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-74.794,64	-0,01
Apple, Inc. 33,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-70.344,70	-0,01
Apple, Inc. 36,18 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-151.352,80	-0,01
Apple, Inc. 30,75 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-96.360,42	-0,01
Apple, Inc. 31,67 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-140.496,13	-0,01
Apple, Inc. 31,23 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-133.043,61	-0,01
Apple, Inc. 31,77 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-108.666,34	-0,01
Apple, Inc. 36,30 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-99.520,18	-0,01
Apple, Inc. 35,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-119.132,21	-0,01
Apple, Inc. 35,34 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-133.818,61	-0,01
Apple, Inc. 30,62 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-72.239,51	-0,01
Apple, Inc. 31,03 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-97.286,63	-0,01
Apple, Inc. 30,50 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-117.278,99	-0,01
Apple, Inc. 34,13 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-141.762,14	-0,01
Apple, Inc. 29,97 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-102.054,22	-0,01
Apple, Inc. 31,13 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-127.678,02	-0,01
Apple, Inc. 33,47 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-62.086,21	-0,01
Apple, Inc. 35,59 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-106.179,80	-0,01
Arrow Electronics, Inc. 30,53 %	19.01.2024	1.000.000	USD	1.672,28	0,00
ASML Holding NV 37,40 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-91.880,14	-0,01
Assicurazioni Generali SpA 22,74 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-50.794,66	0,00
Assicurazioni Generali SpA 24,11 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-49.516,02	0,00
Assicurazioni Generali SpA 22,75 %	20.06.2024	2.000.000	EUR	-20.606,28	0,00
Assicurazioni Generali SpA 25,90 %	20.06.2024	800.000	EUR	-36.285,94	0,00
Assicurazioni Generali SpA 27,01 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-94.344,78	-0,01
Assicurazioni Generali SpA 25,71 %	20.06.2024	1.250.000	EUR	-55.206,65	0,00
Assicurazioni Generali SpA 25,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-45.893,50	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 28,44 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.224,94	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-77.250,92	-0,01
AXA S.A. 26,18 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-45.234,60	0,00
AXA S.A. 28,35 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-177.641,55	-0,02
AXA S.A. 27,94 %	21.06.2024	800.000	EUR	-39.966,88	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
AXA S.A. 31,57 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-97.697,17	-0,01
AXA S.A. 31,34 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-156.220,76	-0,01
AXA S.A. 29,58 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-105.264,21	-0,01
AXA S.A. 30,24 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-99.574,78	-0,01
AXA S.A. 28,37 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-57.718,16	0,00
AXA S.A. 26,69 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-83.715,84	-0,01
AXA S.A. 30,47 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-102.180,55	-0,01
AXA S.A. 32,80 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-129.816,52	-0,01
AXA S.A. 27,18 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-73.407,82	-0,01
AXA S.A. 31,02 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-137.167,35	-0,01
AXA S.A. 25,11 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-31.417,27	0,00
AXA S.A. 31,75 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-178.804,38	-0,02
AXA S.A. 32,94 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	221.765,66	0,02
AXA S.A. 26,82 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-59.417,30	-0,01
AXA S.A. 27,55 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-93.315,70	-0,01
AXA S.A. 31,08 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-137.987,13	-0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 31,11 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	74.711,04	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 39,43 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-108.200,86	-0,01
Bank of America Corp. 30,80 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-42.889,07	0,00
Bank of America Corp. 33,09 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-59.178,72	-0,01
Bank of America Corp. 29,24 %	21.06.2024	1.200.000	USD	574,64	0,00
Bank of America Corp. 32,07 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-84.023,53	-0,01
Bank of America Corp. 29,50 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-28.015,54	0,00
Bank of America Corp. 30,90 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-63.761,46	-0,01
Bank of America Corp. 31,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-79.821,81	-0,01
Bank of America Corp. 38,32 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-115.441,15	-0,01
Bank of America Corp. 36,33 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-167.995,98	-0,01
Bank of America Corp. 30,88 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-76.663,31	-0,01
Bank of America Corp. 31,27 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-47.771,97	0,00
Bank of America Corp. 35,42 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-170.047,89	-0,01
Bank of America Corp. 32,74 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-58.500,44	-0,01
Bank of America Corp. 28,17 %	19.01.2024	2.500.000	USD	6.219,80	0,00
Bank of America Corp. 29,31 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-19.838,57	0,00
Bank of America Corp. 34,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-81.608,03	-0,01
Bank of America Corp. 30,25 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-14.334,46	0,00
Bank of America Corp. 36,61 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-155.683,80	-0,01
Bank of America Corp. 37,94 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-104.100,42	-0,01
Bank of America Corp. 36,86 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-146.169,82	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 28,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	16.499,88	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 31,74 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-83.622,61	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 33,84 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-82.833,19	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 36,07 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-142.989,24	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 27,39 %	19.01.2024	2.500.000	USD	25.416,50	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 29,25 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-14.715,35	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 29,07 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-20.243,79	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 34,46 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-67.058,70	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 29,37 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-20.811,51	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 32,59 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-83.105,24	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 29,99 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-16.475,43	0,00
Barclays PLC 36,11 %	15.12.2023	1.269.000	GBP	-73.561,56	-0,01
Barrick Gold Corp. 39,33 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-125.551,41	-0,01
Barrick Gold Corp. 34,15 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-55.829,62	0,00
Barrick Gold Corp. 38,35 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-83.964,12	-0,01
Barrick Gold Corp. 40,32 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-136.531,57	-0,01
Bayer AG 35,98 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-131.165,71	-0,01
Bayer AG 29,66 %	21.06.2024	800.000	EUR	-41.380,62	0,00
Bayer AG 36,34 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-113.899,11	-0,01
Bayer AG 30,89 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-120.529,82	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 30,53 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-186.120,52	-0,02
Bayerische Motoren Werke AG 36,45 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-170.041,98	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Berkshire Hathaway, Inc. 22,68 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-92.241,74	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 22,06 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-64.259,08	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 19,33 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-59.027,50	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 23,40 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-170.780,48	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 18,65 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-18.265,37	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 20,71 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-50.950,65	0,00
Best Buy Co., Inc. 40,36 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-97.121,80	-0,01
Best Buy Co., Inc. 37,05 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-78.740,70	-0,01
Best Buy Co., Inc. 40,11 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-232.189,41	-0,02
Best Buy Co., Inc. 40,36 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-84.089,85	-0,01
Best Buy Co., Inc. 39,51 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-110.989,18	-0,01
BHP Group Ltd. 37,02 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-65.606,06	-0,01
Biogen, Inc. 36,30 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-83.761,33	-0,01
Biogen, Inc. 35,75 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-80.544,56	-0,01
Biogen, Inc. 35,75 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-89.186,16	-0,01
BNP Paribas S.A. 30,79 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-18.834,06	0,00
BNP Paribas S.A. 32,68 %	21.06.2024	800.000	EUR	-43.587,77	0,00
BNP Paribas S.A. 35,80 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-85.337,03	-0,01
BNP Paribas S.A. 31,15 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-33.687,27	0,00
BNP Paribas S.A. 36,41 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-118.377,87	-0,01
BNP Paribas S.A. 37,20 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-102.915,11	-0,01
BNP Paribas S.A. 36,60 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-123.474,46	-0,01
BNP Paribas S.A. 32,85 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-62.759,15	-0,01
BNP Paribas S.A. 37,49 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-90.834,39	-0,01
BNP Paribas S.A. 36,70 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-121.538,95	-0,01
Booking Holdings, Inc. 35,48 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-91.304,33	-0,01
Booking Holdings, Inc. 35,96 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-135.430,19	-0,01
Booking Holdings, Inc. 36,80 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-124.721,06	-0,01
Booking Holdings, Inc. 36,01 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-102.936,58	-0,01
Booking Holdings, Inc. 37,50 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-104.412,85	-0,01
Booking Holdings, Inc. 34,69 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-79.009,64	-0,01
Boston Scientific Corp. 28,17 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-97.213,66	-0,01
Boston Scientific Corp. 26,37 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-55.684,63	0,00
Boston Scientific Corp. 29,50 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-100.447,63	-0,01
Boston Scientific Corp. 33,19 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-163.099,45	-0,01
Boston Scientific Corp. 26,45 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-29.467,76	0,00
Boston Scientific Corp. 28,98 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-46.847,46	0,00
Boston Scientific Corp. 30,16 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-104.038,85	-0,01
Bouygues S.A. 24,91 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-61.492,57	-0,01
Bouygues S.A. 30,17 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-223.019,70	-0,02
Bouygues S.A. 29,24 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-159.449,06	-0,01
Bouygues S.A. 25,66 %	21.06.2024	800.000	EUR	-33.365,02	0,00
Bouygues S.A. 25,54 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-50.472,45	0,00
Bouygues S.A. 25,19 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-44.658,05	0,00
BP PLC 32,15 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-65.891,91	-0,01
BP PLC 29,90 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-31.592,40	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 28,83 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-99.334,99	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 23,60 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-56.201,39	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 24,69 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-69.127,26	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 22,66 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-22.772,93	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 23,85 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-43.587,34	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 23,58 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-36.340,41	0,00
British American Tobacco PLC 25,26 %	15.12.2023	1.302.000	GBP	-87.908,48	-0,01
British American Tobacco PLC 31,18 %	15.12.2023	1.031.600	GBP	-138.307,85	-0,01
British American Tobacco PLC 26,38 %	15.12.2023	1.033.008	GBP	-90.641,60	-0,01
Broadcom, Inc. 37,65 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-81.541,30	-0,01
Broadcom, Inc. 34,30 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-72.226,50	-0,01
Broadcom, Inc. 33,90 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-6.025,71	0,00
Broadcom, Inc. 35,91 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-44.975,35	0,00
Broadcom, Inc. 32,96 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-18.220,30	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Broadcom, Inc. 33,54 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-2.649,72	0,00
Broadcom, Inc. 36,73 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-62.286,66	-0,01
Broadcom, Inc. 36,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-38.436,94	0,00
Broadcom, Inc. 33,88 %	21.06.2024	1.200.000	USD	2.086,46	0,00
Broadcom, Inc. 33,28 %	21.06.2024	1.500.000	USD	5.833,36	0,00
Broadcom, Inc. 33,01 %	21.06.2024	1.500.000	USD	16.085,28	0,00
Broadcom, Inc. 37,39 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-36.748,39	0,00
Broadcom, Inc. 33,85 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-6.441,46	0,00
Broadcom, Inc. 34,49 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-22.424,75	0,00
Broadcom, Inc. 38,46 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-48.678,16	0,00
Broadcom, Inc. 38,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-66.467,39	-0,01
Broadcom, Inc. 34,08 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-9.993,52	0,00
Broadcom, Inc. 34,52 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-27.374,81	0,00
Broadcom, Inc. 36,02 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-35.589,75	0,00
Broadcom, Inc. 34,90 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-16.412,56	0,00
Broadcom, Inc. 33,40 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-13.395,27	0,00
Broadcom, Inc. 34,19 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-1.912,75	0,00
Broadcom, Inc. 33,08 %	21.06.2024	1.600.000	USD	8.526,15	0,00
Broadcom, Inc. 35,45 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-19.059,65	0,00
Broadcom, Inc. 35,39 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-26.839,18	0,00
Broadcom, Inc. 38,24 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-60.251,38	-0,01
Broadcom, Inc. 33,61 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-129,11	0,00
Broadcom, Inc. 35,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-44.452,51	0,00
Broadcom, Inc. 33,44 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-4.580,11	0,00
Broadcom, Inc. 31,98 %	21.06.2024	2.500.000	USD	22.663,55	0,00
Broadcom, Inc. 34,77 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-48.038,30	0,00
Broadcom, Inc. 34,07 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-48.597,54	0,00
Broadcom, Inc. 37,74 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-79.032,25	-0,01
Broadcom, Inc. 33,34 %	21.06.2024	1.200.000	USD	2.404,11	0,00
Broadcom, Inc. 33,40 %	21.06.2024	1.500.000	USD	3.104,73	0,00
Broadcom, Inc. 34,73 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-69.781,30	-0,01
Broadcom, Inc. 36,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-82.087,23	-0,01
Cardinal Health, Inc. 28,90 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-95.902,81	-0,01
Carrefour S.A. 31,52 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-79.775,65	-0,01
Centene Corp. 33,62 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-42.176,99	0,00
Centene Corp. 35,94 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-132.682,81	-0,01
Charles Schwab Corp./The 35,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	72.873,63	0,01
Charles Schwab Corp./The 32,57 %	21.06.2024	1.300.000	USD	104.391,38	0,01
Charles Schwab Corp./The 30,94 %	21.06.2024	2.500.000	USD	223.562,88	0,02
Charles Schwab Corp./The 32,35 %	21.06.2024	1.200.000	USD	101.595,20	0,01
Cheniere Energy, Inc. 37,70 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-216.596,29	-0,02
Cheniere Energy, Inc. 37,86 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-154.597,71	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 40,05 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-145.843,40	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 38,18 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-101.292,15	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 37,94 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-154.183,32	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 37,54 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-111.747,84	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 37,40 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-80.078,10	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 36,15 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-85.831,44	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 35,30 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-60.622,66	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 35,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-111.282,05	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 41,79 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-167.044,27	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 34,30 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-39.095,90	0,00
Cheniere Energy, Inc. 37,17 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-104.351,64	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 35,97 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-88.188,30	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 36,69 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-127.193,35	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 34,85 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-58.192,98	0,00
Cheniere Energy, Inc. 35,01 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-74.229,94	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 38,02 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-125.332,92	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 37,13 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-123.737,83	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 40,12 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-116.715,33	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Cheniere Energy, Inc. 38,26 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-151.883,39	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 38,38 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-154.752,16	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 40,00 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-112.336,69	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 38,79 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-129.007,52	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 35,26 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-63.523,11	-0,01
Cheniere Energy, Inc. 36,42 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-105.189,55	-0,01
Chevron Corp. 29,13 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-45.169,57	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 32,11 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-64.622,82	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,00 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-66.265,09	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 36,87 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-59.903,46	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,31 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-59.398,06	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,55 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-61.422,14	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 33,05 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-39.677,82	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,58 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-51.304,95	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 32,26 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-87.014,10	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 32,98 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-43.773,96	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,88 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-56.587,82	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 33,48 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-86.666,89	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,35 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-107.469,48	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,55 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-91.389,92	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,60 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-42.498,92	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,69 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-72.326,88	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,31 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-117.795,14	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,37 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-94.781,61	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 39,24 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-168.642,89	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 39,71 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-121.985,57	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,35 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-91.609,08	-0,01
Chipotle Mexican Grill, Inc. 41,34 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-107.965,85	-0,01
Chubb Ltd. 23,50 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-50.545,25	0,00
Chubb Ltd. 23,91 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-59.426,51	-0,01
Chubb Ltd. 25,45 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-97.037,78	-0,01
Chubb Ltd. 29,52 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-108.597,45	-0,01
Chubb Ltd. 29,59 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-169.761,93	-0,01
Cigna Corp. 34,96 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-101.617,26	-0,01
Cigna Corp. 36,06 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-176.579,14	-0,02
Cigna Corp. 33,95 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-111.814,77	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,09 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-198.049,95	-0,02
Cisco Systems, Inc. 27,01 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-61.458,37	-0,01
Cisco Systems, Inc. 26,87 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-52.548,59	0,00
Cisco Systems, Inc. 27,25 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-46.575,33	0,00
Cisco Systems, Inc. 28,70 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-165.924,03	-0,01
Cisco Systems, Inc. 28,50 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-159.310,10	-0,01
Cisco Systems, Inc. 29,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-110.115,08	-0,01
Cisco Systems, Inc. 31,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-79.443,93	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,47 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-125.338,69	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,08 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-80.386,36	-0,01
Cisco Systems, Inc. 29,37 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-118.151,84	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,41 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-108.620,58	-0,01
Cisco Systems, Inc. 27,89 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-46.537,30	0,00
Cisco Systems, Inc. 32,33 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-206.524,84	-0,02
Cisco Systems, Inc. 30,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-104.086,01	-0,01
Citigroup, Inc. 32,61 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-52.366,48	0,00
Citigroup, Inc. 37,70 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-161.292,50	-0,01
Citigroup, Inc. 34,92 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-106.239,27	-0,01
Citigroup, Inc. 31,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-23.398,44	0,00
Citigroup, Inc. 34,84 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-119.202,89	-0,01
Citigroup, Inc. 30,11 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-32.314,02	0,00
Citigroup, Inc. 33,93 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-60.587,46	-0,01
Citigroup, Inc. 29,20 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-10.194,68	0,00
Citigroup, Inc. 30,59 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-4.606,91	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Citigroup, Inc. 31,12 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-7.796,47	0,00
Citigroup, Inc. 30,27 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-28.686,99	0,00
Citigroup, Inc. 33,38 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-44.826,62	0,00
Clariant AG 28,15 %	21.06.2024	1.461.300	CHF	-78.696,46	-0,01
Clariant AG 29,75 %	21.06.2024	798.500	CHF	-58.602,32	-0,01
CME Group, Inc. 25,86 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-51.786,32	0,00
CME Group, Inc. 32,36 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-150.712,66	-0,01
CME Group, Inc. 33,54 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-144.019,58	-0,01
CME Group, Inc. 32,80 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-103.153,22	-0,01
CME Group, Inc. 24,08 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-78.614,82	-0,01
CME Group, Inc. 25,95 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-59.110,75	-0,01
CME Group, Inc. 32,23 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-154.142,10	-0,01
CME Group, Inc. 24,36 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-51.308,04	0,00
CME Group, Inc. 30,53 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-131.663,95	-0,01
CME Group, Inc. 26,35 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-45.493,84	0,00
CME Group, Inc. 32,08 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-158.178,27	-0,01
CME Group, Inc. 33,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-138.718,48	-0,01
CME Group, Inc. 31,55 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-194.832,50	-0,02
CME Group, Inc. 31,51 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-139.915,85	-0,01
CME Group, Inc. 33,24 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-129.238,86	-0,01
CME Group, Inc. 25,79 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-63.150,11	-0,01
CME Group, Inc. 24,88 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-46.581,63	0,00
CME Group, Inc. 23,31 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-51.772,61	0,00
CME Group, Inc. 24,27 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-16.298,21	0,00
CME Group, Inc. 24,36 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-72.157,14	-0,01
Coca-Cola Co./The 21,00 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-140.312,11	-0,01
Coca-Cola Co./The 20,82 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-49.064,32	0,00
Coca-Cola Co./The 19,49 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-44.495,56	0,00
Coca-Cola Co./The 18,35 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-37.895,44	0,00
Coca-Cola Co./The 19,37 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-53.440,45	0,00
Coca-Cola Co./The 20,64 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-71.171,84	-0,01
Coca-Cola Co./The 20,18 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-80.074,23	-0,01
Coca-Cola Co./The 20,71 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-73.071,52	-0,01
Coca-Cola Co./The 20,77 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-64.702,91	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 32,10 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-57.821,04	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 34,79 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-97.522,00	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 33,53 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-32.187,97	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 31,40 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-77.051,39	-0,01
Colgate-Palmolive Co. 19,91 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-55.689,53	0,00
Colgate-Palmolive Co. 21,11 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-44.262,05	0,00
Constellation Brands, Inc. 30,84 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-89.148,72	-0,01
Constellation Brands, Inc. 28,73 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-70.106,96	-0,01
Constellation Brands, Inc. 29,34 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-58.903,52	-0,01
Constellation Brands, Inc. 27,48 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-54.642,19	0,00
Constellation Brands, Inc. 28,29 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-182.685,81	-0,02
Constellation Brands, Inc. 24,19 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-16.003,88	0,00
Constellation Brands, Inc. 27,56 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-101.390,51	-0,01
Constellation Brands, Inc. 28,45 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-117.316,79	-0,01
Constellation Brands, Inc. 28,49 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-121.886,27	-0,01
Constellation Brands, Inc. 25,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-128.225,98	-0,01
Constellation Brands, Inc. 32,51 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-131.754,39	-0,01
Constellation Brands, Inc. 26,50 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-94.198,32	-0,01
Constellation Brands, Inc. 26,26 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-137.092,39	-0,01
Constellation Brands, Inc. 26,51 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-143.848,53	-0,01
Constellation Brands, Inc. 30,26 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-140.313,37	-0,01
Constellation Brands, Inc. 30,03 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-65.329,13	-0,01
Constellation Brands, Inc. 26,30 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-50.503,00	0,00
Constellation Brands, Inc. 26,80 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-120.263,28	-0,01
Constellation Brands, Inc. 26,29 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-61.947,87	-0,01
Constellation Brands, Inc. 27,01 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-93.481,11	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Corning, Inc. 31,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-128.268,24	-0,01
Corning, Inc. 32,42 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-55.677,23	0,00
Corning, Inc. 31,11 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-58.148,91	0,00
Corning, Inc. 30,85 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-54.735,21	0,00
Corning, Inc. 28,77 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-68.057,74	-0,01
Credit Agricole S.A. 30,55 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-72.584,61	-0,01
Credit Agricole S.A. 32,44 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-91.890,98	-0,01
Credit Agricole S.A. 33,75 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-104.049,11	-0,01
Credit Agricole S.A. 29,26 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-129.133,10	-0,01
Credit Agricole S.A. 28,99 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-80.746,34	-0,01
Credit Agricole S.A. 33,40 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-130.473,36	-0,01
Credit Agricole S.A. 34,60 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-173.337,99	-0,01
Credit Agricole S.A. 37,30 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-225.393,54	-0,02
Credit Agricole S.A. 40,16 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	360.093,70	0,03
Credit Agricole S.A. 29,92 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-78.630,06	-0,01
Credit Agricole S.A. 33,40 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-314.727,87	-0,03
Credit Agricole S.A. 29,80 %	21.06.2024	800.000	EUR	-40.278,72	0,00
Credit Agricole S.A. 30,27 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-95.727,10	-0,01
Credit Agricole S.A. 31,87 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-174.705,22	-0,01
CSX Corp. 32,51 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-173.062,55	-0,01
CSX Corp. 31,63 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-129.487,41	-0,01
CSX Corp. 31,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-153.943,81	-0,01
CSX Corp. 28,35 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-125.924,70	-0,01
CSX Corp. 27,60 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-112.843,86	-0,01
CSX Corp. 32,02 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-102.910,49	-0,01
CSX Corp. 29,57 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-122.179,69	-0,01
CSX Corp. 30,86 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-76.917,01	-0,01
Cummins, Inc. 28,63 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-64.517,64	-0,01
Cummins, Inc. 32,74 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-166.109,21	-0,01
Cummins, Inc. 29,17 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-75.618,72	-0,01
Cummins, Inc. 32,11 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-151.119,31	-0,01
Cummins, Inc. 33,16 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-126.771,59	-0,01
Cummins, Inc. 29,06 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-64.116,04	-0,01
Cummins, Inc. 33,81 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-105.562,94	-0,01
Cummins, Inc. 30,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-69.911,31	-0,01
Cummins, Inc. 30,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-94.093,64	-0,01
Cummins, Inc. 35,01 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-83.473,75	-0,01
Cummins, Inc. 34,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-81.335,81	-0,01
Cummins, Inc. 35,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-85.003,74	-0,01
Cummins, Inc. 29,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-94.614,82	-0,01
Cummins, Inc. 36,37 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-137.402,27	-0,01
Cummins, Inc. 29,97 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-76.213,07	-0,01
Cummins, Inc. 30,60 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-78.789,00	-0,01
Cummins, Inc. 37,18 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-102.346,39	-0,01
Cummins, Inc. 33,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-99.103,84	-0,01
Cummins, Inc. 34,43 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-99.289,35	-0,01
Cummins, Inc. 30,24 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-48.246,50	0,00
Cummins, Inc. 32,73 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-92.074,02	-0,01
Cummins, Inc. 34,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-120.637,22	-0,01
Cummins, Inc. 28,52 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-24.644,56	0,00
Cummins, Inc. 33,38 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-134.966,73	-0,01
Cummins, Inc. 26,90 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-14.560,38	0,00
Cummins, Inc. 32,60 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-91.290,75	-0,01
CVS Health Corp. 30,04 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-33.374,52	0,00
CVS Health Corp. 31,17 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-51.323,66	0,00
CVS Health Corp. 28,73 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-79.821,70	-0,01
CVS Health Corp. 30,81 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-52.998,62	0,00
CVS Health Corp. 29,45 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-34.074,12	0,00
CVS Health Corp. 30,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-60.327,40	-0,01
CVS Health Corp. 29,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-74.015,31	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
CVS Health Corp. 25,57 %	19.01.2024	1.500.000	USD	13.251,55	0,00
CVS Health Corp. 28,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-32.817,13	0,00
CVS Health Corp. 28,20 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-23.941,06	0,00
CVS Health Corp. 29,15 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-51.327,76	0,00
CVS Health Corp. 26,18 %	21.06.2024	1.300.000	USD	17.238,79	0,00
CVS Health Corp. 28,21 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-25.623,67	0,00
CVS Health Corp. 28,07 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-36.801,51	0,00
Danone S.A. 22,66 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-67.391,99	-0,01
Davide Campari-Milano N.V. 21,62 %	20.06.2024	1.500.000	EUR	-32.784,06	0,00
DAX Index 23,77 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	513.281,78	0,04
DAX Index 20,37 %	15.12.2023	9.000.000	EUR	453.069,99	0,04
DAX Index 23,70 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	425.205,30	0,04
DAX Index 27,98 %	15.12.2023	5.000.000	EUR	-603.567,40	-0,05
DAX Index 23,71 %	15.12.2023	19.200.000	EUR	1.096.684,99	0,09
DAX Index 25,09 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	567.678,96	0,05
Deere & Co. 31,28 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-46.805,29	0,00
Deere & Co. 33,30 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-45.578,72	0,00
Deere & Co. 33,11 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-110.245,11	-0,01
Deere & Co. 33,43 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-93.763,76	-0,01
Deere & Co. 29,72 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-15.152,26	0,00
Deere & Co. 31,31 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-60.069,61	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 42,23 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-179.844,66	-0,02
Delta Air Lines, Inc. 40,35 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-41.955,36	0,00
Delta Air Lines, Inc. 41,74 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-101.609,00	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 38,06 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-14.914,23	0,00
Delta Air Lines, Inc. 43,80 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-113.524,53	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 42,24 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-119.898,00	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 50,71 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-185.276,50	-0,02
Delta Air Lines, Inc. 41,74 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-95.042,35	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 40,84 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-72.955,37	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 37,06 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-14.602,83	0,00
Delta Air Lines, Inc. 41,80 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-112.153,81	-0,01
Deutsche Boerse AG 28,74 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-123.747,37	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,30 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-85.225,19	-0,01
Deutsche Boerse AG 24,50 %	21.06.2024	800.000	EUR	-15.818,66	0,00
Deutsche Boerse AG 27,33 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-78.771,30	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,12 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-99.320,44	-0,01
Deutsche Boerse AG 27,05 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-190.074,63	-0,02
Deutsche Boerse AG 30,22 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	182.410,02	0,02
Deutsche Boerse AG 28,70 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-118.742,10	-0,01
Deutsche Boerse AG 23,70 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-16.577,48	0,00
Deutsche Boerse AG 23,68 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-19.823,63	0,00
Deutsche Boerse AG 27,59 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-136.741,34	-0,01
Deutsche Boerse AG 24,88 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-31.100,70	0,00
Deutsche Boerse AG 31,34 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-125.702,35	-0,01
Deutsche Telekom AG 24,40 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-91.524,57	-0,01
Deutsche Telekom AG 25,00 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-71.506,67	-0,01
Deutsche Telekom AG 19,79 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	36.586,28	0,00
Deutsche Telekom AG 23,14 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-48.152,72	0,00
Deutsche Telekom AG 18,19 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	58.634,31	0,00
Deutsche Telekom AG 23,83 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-91.418,86	-0,01
Deutsche Telekom AG 26,06 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-68.813,25	-0,01
Deutsche Telekom AG 20,10 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	17.511,04	0,00
Deutsche Telekom AG 20,51 %	21.06.2024	800.000	EUR	10.111,03	0,00
Deutsche Telekom AG 27,66 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-103.224,73	-0,01
Deutsche Telekom AG 20,97 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-5.084,28	0,00
Deutsche Telekom AG 21,02 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	7.399,28	0,00
Dexcom, Inc. 43,85 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-80.687,57	-0,01
Dexcom, Inc. 47,67 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-290.109,81	-0,02
Dollar General Corp. 28,70 %	21.06.2024	1.600.000	USD	77.610,27	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Dollar General Corp. 29,10 %	17.01.2025	1.500.000	USD	47.356,79	0,00
Dollar General Corp. 27,84 %	21.06.2024	1.200.000	USD	70.953,29	0,01
Dow, Inc. 37,00 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-130.173,80	-0,01
Dow, Inc. 32,47 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-73.833,56	-0,01
Dow, Inc. 31,59 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-54.599,43	0,00
Dow, Inc. 33,98 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-159.581,30	-0,01
Dow, Inc. 31,71 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-61.213,95	-0,01
Dow, Inc. 34,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-210.413,70	-0,02
Dow, Inc. 32,60 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-105.262,50	-0,01
Dow, Inc. 31,34 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-79.354,59	-0,01
Dow, Inc. 36,30 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-169.717,69	-0,01
Dow, Inc. 33,65 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-121.596,87	-0,01
Dow, Inc. 29,20 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-30.386,21	0,00
Dow, Inc. 34,58 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-128.563,73	-0,01
Dow, Inc. 30,33 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-45.910,40	0,00
Dow, Inc. 32,46 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-137.599,18	-0,01
Dow, Inc. 33,80 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-130.468,12	-0,01
Dow, Inc. 29,93 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-110.861,11	-0,01
Dow, Inc. 31,02 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-76.364,61	-0,01
Dow, Inc. 32,55 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-81.149,43	-0,01
Dow, Inc. 36,00 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-153.153,38	-0,01
Dow, Inc. 30,45 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-92.714,92	-0,01
Dow, Inc. 32,39 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-170.917,05	-0,01
Dow, Inc. 33,10 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-222.966,65	-0,02
Dow, Inc. 31,69 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-57.660,17	0,00
Dow, Inc. 32,30 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-167.870,55	-0,01
DR Horton, Inc. 36,00 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-84.880,28	-0,01
DR Horton, Inc. 37,36 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-71.017,08	-0,01
DR Horton, Inc. 37,83 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-131.126,40	-0,01
DR Horton, Inc. 35,60 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-36.129,55	0,00
Duke Energy Corp. 23,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-24.369,30	0,00
DuPont de Nemours, Inc. 31,90 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-130.286,18	-0,01
DuPont de Nemours, Inc. 31,19 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-44.492,64	0,00
DuPont de Nemours, Inc. 31,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-104.468,65	-0,01
E.ON SE 25,86 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-166.124,82	-0,01
E.ON SE 24,53 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-76.491,88	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,56 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-101.324,39	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,10 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-129.675,13	-0,01
Electronic Arts, Inc. 35,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-125.843,78	-0,01
Electronic Arts, Inc. 27,53 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-34.398,43	0,00
Electronic Arts, Inc. 28,38 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-74.370,67	-0,01
Electronic Arts, Inc. 35,58 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-107.796,32	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,66 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-152.985,54	-0,01
Electronic Arts, Inc. 28,78 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-67.411,53	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,65 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-68.213,71	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,82 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-103.801,25	-0,01
Electronic Arts, Inc. 30,42 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-115.539,87	-0,01
Electronic Arts, Inc. 31,80 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-80.264,06	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,20 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-54.018,21	0,00
Electronic Arts, Inc. 33,67 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-179.498,00	-0,02
Electronic Arts, Inc. 30,69 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-94.787,32	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,11 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-173.753,75	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,78 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-48.696,97	0,00
Electronic Arts, Inc. 32,93 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-126.135,16	-0,01
Electronic Arts, Inc. 32,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-194.877,77	-0,02
Electronic Arts, Inc. 31,06 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-76.863,51	-0,01
Electronic Arts, Inc. 30,75 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-72.773,22	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,24 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-126.293,44	-0,01
Electronic Arts, Inc. 32,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-132.111,02	-0,01
Electronic Arts, Inc. 29,17 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-54.125,17	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Electronic Arts, Inc. 29,66 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-55.363,60	0,00
Electronic Arts, Inc. 30,65 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-47.753,41	0,00
Electronic Arts, Inc. 33,72 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-138.917,24	-0,01
Electronic Arts, Inc. 31,30 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-74.639,89	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,42 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-149.875,02	-0,01
Electronic Arts, Inc. 32,24 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-117.525,48	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,12 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-147.173,76	-0,01
Electronic Arts, Inc. 31,82 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-110.652,69	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-136.238,87	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,41 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-202.400,20	-0,02
Electronic Arts, Inc. 30,44 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-85.920,53	-0,01
Electronic Arts, Inc. 30,82 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-123.935,49	-0,01
Electronic Arts, Inc. 35,07 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-102.094,87	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-228.234,07	-0,02
Elevance Health Inc. 28,66 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-29.302,62	0,00
Emerson Electric Co. 28,64 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-62.769,32	-0,01
Emerson Electric Co. 27,62 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-83.967,51	-0,01
Emerson Electric Co. 28,05 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-101.052,98	-0,01
Emerson Electric Co. 26,52 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-71.409,67	-0,01
Emerson Electric Co. 29,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-152.650,80	-0,01
Emerson Electric Co. 27,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-84.060,01	-0,01
Emerson Electric Co. 26,30 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-40.353,18	0,00
Emerson Electric Co. 32,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-106.661,64	-0,01
Emerson Electric Co. 31,71 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-176.330,29	-0,01
Emerson Electric Co. 32,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-109.265,61	-0,01
Emerson Electric Co. 33,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-78.567,46	-0,01
Emerson Electric Co. 32,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-63.849,05	-0,01
Emerson Electric Co. 30,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-77.123,95	-0,01
Emerson Electric Co. 29,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-66.853,62	-0,01
Emerson Electric Co. 34,57 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-91.605,82	-0,01
Engie SA 25,82 %	21.06.2024	800.000	EUR	-75.263,43	-0,01
Engie SA 25,58 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-163.863,90	-0,01
Enterprise Products Partners LP 22,86 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-57.126,87	0,00
Enterprise Products Partners LP 22,16 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-103.017,64	-0,01
Enterprise Products Partners LP 20,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-81.025,59	-0,01
Enterprise Products Partners LP 24,95 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-165.022,36	-0,01
Enterprise Products Partners LP 25,02 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-98.772,85	-0,01
Enterprise Products Partners LP 20,43 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-125.227,86	-0,01
Enterprise Products Partners LP 23,96 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-83.041,83	-0,01
Enterprise Products Partners LP 24,05 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-86.194,55	-0,01
Enterprise Products Partners LP 23,12 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-43.057,08	0,00
Enterprise Products Partners LP 22,48 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-127.861,19	-0,01
Enterprise Products Partners LP 21,24 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-40.557,35	0,00
Enterprise Products Partners LP 22,77 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-69.802,66	-0,01
EOG Resources, Inc. 40,85 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-100.232,04	-0,01
Euro Stoxx 50® Index 20,37 %	15.12.2023	9.000.000	EUR	439.273,35	0,04
Euro Stoxx 50® Index 19,19 %	21.06.2024	11.250.000	EUR	320.791,16	0,03
Euro Stoxx 50® Index 28,06 %	15.12.2023	5.000.000	EUR	-593.454,65	-0,05
Euro Stoxx 50® Index 23,73 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	514.943,25	0,04
Euro Stoxx 50® Index 19,60 %	21.06.2024	9.900.000	EUR	346.224,68	0,03
Euro Stoxx 50® Index 23,60 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	415.464,83	0,04
Euro Stoxx 50® Index 25,46 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	678.837,68	0,06
Euro Stoxx 50® Index 25,00 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	557.018,56	0,05
Euro Stoxx 50® Index 22,09 %	21.06.2024	17.500.000	EUR	937.913,90	0,08
EURO STOXX Banks EUR Price Index 36,29 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-133.549,36	-0,01
Exelon Corp. 28,48 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-71.509,01	-0,01
Exelon Corp. 24,11 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-70.677,00	-0,01
Ferrari NV 27,26 %	20.06.2024	2.000.000	EUR	-25.513,28	0,00
Ferrari NV 26,87 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-15.212,29	0,00
Ferrari NV 25,74 %	20.06.2024	1.500.000	EUR	6.391,98	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Fifth Third Bancorp 40,05 %	19.01.2024	1.300.000	USD	6.324,00	0,00
Fifth Third Bancorp 39,59 %	19.01.2024	1.300.000	USD	13.389,16	0,00
Fifth Third Bancorp 36,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	96.950,92	0,01
Fifth Third Bancorp 35,83 %	21.06.2024	1.200.000	USD	82.693,03	0,01
Fifth Third Bancorp 41,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	13.972,19	0,00
FirstEnergy Corp. 22,32 %	21.06.2024	2.500.000	USD	21.607,20	0,00
Fiserv, Inc. 32,50 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-111.468,33	-0,01
Fiserv, Inc. 31,09 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-150.347,04	-0,01
Fiserv, Inc. 33,24 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-142.176,03	-0,01
Fiserv, Inc. 26,96 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-65.164,91	-0,01
Fortinet, Inc. 43,04 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-147.270,51	-0,01
Fortinet, Inc. 39,00 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-48.905,54	0,00
Freeport-McMoRan, Inc. 45,72 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-68.601,20	-0,01
Freeport-McMoRan, Inc. 49,52 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-184.346,05	-0,02
Garmin Ltd. 27,08 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-52.081,50	0,00
Garmin Ltd. 28,95 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-69.828,74	-0,01
Garmin Ltd. 29,76 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-148.988,86	-0,01
Garmin Ltd. 25,33 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-32.501,96	0,00
Garmin Ltd. 28,95 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-206.126,67	-0,02
Garmin Ltd. 29,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-110.973,40	-0,01
General Electric Co. 36,97 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-88.415,49	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 28,68 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-155.917,55	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 29,02 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-77.218,02	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 30,06 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-51.585,05	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-86.142,79	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 29,19 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-120.917,73	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 27,69 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-40.073,65	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,72 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-87.493,14	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 30,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-59.045,22	-0,01
Glencore PLC 36,34 %	21.06.2024	1.305.000	GBP	-65.025,19	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,53 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-75.483,20	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 26,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-43.716,56	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 37,90 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-137.510,37	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-109.371,52	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 31,97 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-136.254,37	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,19 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-60.482,92	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,77 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-214.230,45	-0,02
Goldman Sachs Group, Inc. 27,92 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-65.879,79	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,61 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-101.695,53	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,58 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-167.498,02	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,23 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-128.196,70	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 32,08 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-79.762,41	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 32,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-154.398,46	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 32,15 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-110.727,10	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-94.085,93	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,71 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-186.685,28	-0,02
Goldman Sachs Group, Inc. 34,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-107.662,72	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 27,70 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-35.017,47	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 37,48 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-159.353,21	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 31,94 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-77.994,42	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,52 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-154.519,75	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-138.362,85	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,34 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-107.722,08	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,83 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-56.037,45	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 29,94 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-56.751,29	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 31,36 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-94.494,22	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,49 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-36.230,61	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 28,94 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-55.514,45	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 35,03 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-126.026,03	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,52 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-76.427,99	-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 VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Goldman Sachs Group, Inc. 33,17 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-106.899,22	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 29,54 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-54.411,87	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-173.094,79	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,20 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-94.966,02	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,97 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-85.512,99	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,22 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-107.380,88	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,07 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-105.302,32	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,20 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-79.669,97	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-143.502,79	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,52 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-86.274,41	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 30,60 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-75.484,72	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-97.475,01	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,60 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-76.666,10	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,97 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-144.822,88	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,88 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-166.650,17	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,01 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-160.681,21	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,34 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-119.418,68	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 27,66 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-51.360,08	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,32 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-171.101,83	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 37,35 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-108.290,08	-0,01
HCA Healthcare, Inc. 31,05 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-58.436,10	-0,01
HCA Healthcare, Inc. 33,00 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-179.015,29	-0,02
HCA Healthcare, Inc. 32,96 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-142.936,50	-0,01
HeidelbergCement AG 31,55 %	21.06.2024	800.000	EUR	-56.253,86	0,00
HeidelbergCement AG 38,73 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-178.622,21	-0,02
Henkel AG & Co. KGaA 20,80 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-59.988,49	-0,01
Hershey Co./The 21,22 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-49.100,10	0,00
Hershey Co./The 22,66 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-94.450,82	-0,01
Hess Corp. 47,15 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-279.191,15	-0,02
Hess Corp. 41,25 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-98.327,58	-0,01
Hess Corp. 40,34 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-82.415,06	-0,01
Hess Corp. 40,77 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-77.013,92	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 34,95 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-16.105,89	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 42,54 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-99.190,04	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 32,28 %	21.06.2024	1.500.000	USD	19.603,49	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 34,39 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-7.301,60	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 43,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-166.920,10	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 31,75 %	21.06.2024	1.200.000	USD	19.778,78	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 33,11 %	21.06.2024	2.000.000	USD	15.088,67	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 42,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-150.003,66	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 40,40 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-81.373,20	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 34,12 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-87.003,54	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 33,53 %	17.01.2025	1.300.000	USD	14.421,35	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 35,45 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-67.033,82	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 37,75 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-143.550,52	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 36,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-75.001,82	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 35,94 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-112.964,89	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 35,42 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-22.048,78	0,00
Holcim Ltd. 27,61 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-68.409,11	-0,01
Holcim Ltd. 28,69 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-142.705,54	-0,01
Holcim Ltd. 26,78 %	21.06.2024	2.467.500	CHF	-133.938,48	-0,01
Holcim Ltd. 33,02 %	15.12.2023	984.000	CHF	-136.950,73	-0,01
Holcim Ltd. 25,44 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	-79.900,19	-0,01
Holcim Ltd. 29,98 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-135.500,61	-0,01
Home Depot, Inc./The 30,05 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-50.043,23	0,00
Honda Motor Co. Ltd. 26,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-80.740,35	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,18 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-91.212,06	-0,01
Honeywell International, Inc. 30,04 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-163.181,90	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,61 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-183.596,70	-0,02
Honeywell International, Inc. 28,13 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-149.826,40	-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 VOLATILITY

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Honeywell International, Inc. 32,27 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-126.701,86	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-186.992,82	-0,02
Honeywell International, Inc. 27,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-116.924,51	-0,01
Honeywell International, Inc. 33,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-113.353,21	-0,01
Honeywell International, Inc. 24,65 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-55.269,79	0,00
Honeywell International, Inc. 29,13 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-140.354,83	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,74 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-129.103,14	-0,01
Honeywell International, Inc. 32,51 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-106.562,71	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-80.684,15	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-73.018,26	-0,01
Honeywell International, Inc. 32,07 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-125.420,52	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-79.515,54	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,20 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-151.798,12	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-102.867,75	-0,01
HSBC Holdings PLC 34,87 %	15.12.2023	1.031.600	GBP	-148.153,66	-0,01
HSBC Holdings PLC 31,08 %	15.12.2023	1.033.008	GBP	-104.494,54	-0,01
Hugo Boss AG 30,48 %	21.06.2024	800.000	EUR	-39.091,43	0,00
Hugo Boss AG 33,75 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-94.820,53	-0,01
Hugo Boss AG 30,69 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-61.485,40	-0,01
Humana, Inc. 29,72 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-6.916,52	0,00
Humana, Inc. 32,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.369,54	-0,01
Humana, Inc. 27,92 %	21.06.2024	1.500.000	USD	8.131,99	0,00
Humana, Inc. 34,11 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-71.671,51	-0,01
Humana, Inc. 30,83 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-34.310,18	0,00
Humana, Inc. 32,89 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-85.975,23	-0,01
Humana, Inc. 30,85 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-35.427,95	0,00
Humana, Inc. 30,35 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-31.965,42	0,00
Iberdrola S.A. 20,70 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-51.070,34	0,00
Iberdrola S.A. 23,92 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-158.957,42	-0,01
Infineon Technologies AG 37,92 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-43.517,81	0,00
Infineon Technologies AG 38,30 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-46.539,43	0,00
ING Groep NV 38,67 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-129.574,42	-0,01
ING Groep NV 39,50 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-94.451,98	-0,01
ING Groep NV 32,91 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-30.549,10	0,00
ING Groep NV 31,63 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	1.325,66	0,00
ING Groep NV 39,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-138.601,80	-0,01
Intercontinental Exchange, Inc. 24,05 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-34.778,42	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 32,06 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-203.811,76	-0,02
Intercontinental Exchange, Inc. 26,08 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-103.960,09	-0,01
International Business Machines Corp. 24,76 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-76.191,15	-0,01
International Business Machines Corp. 26,43 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-46.718,02	0,00
International Business Machines Corp. 30,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-115.767,10	-0,01
International Business Machines Corp. 25,62 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-60.235,89	-0,01
International Business Machines Corp. 26,08 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-77.362,99	-0,01
International Paper 31,27 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-16.660,82	0,00
International Paper 29,46 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-22.421,50	0,00
International Paper 34,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-62.015,17	-0,01
International Paper 26,71 %	19.01.2024	2.000.000	USD	16.865,31	0,00
International Paper 34,73 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-152.991,22	-0,01
International Paper 28,35 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-10.909,49	0,00
Intesa Sanpaolo SpA 36,35 %	20.06.2024	1.500.000	EUR	-106.173,40	-0,01
Intesa Sanpaolo SpA 31,95 %	20.06.2024	800.000	EUR	-24.067,49	0,00
Intuitive Surgical, Inc. 35,22 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-52.037,70	0,00
Intuitive Surgical, Inc. 34,95 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-98.352,94	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 33,22 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-69.040,08	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 34,40 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-74.574,03	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 36,21 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-102.826,56	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 36,75 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-87.831,26	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 32,87 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-50.076,23	0,00
Johnson & Johnson 18,25 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-11.089,16	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Johnson & Johnson 24,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-96.406,64	-0,01
Johnson & Johnson 18,69 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-78.434,41	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,51 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-143.477,53	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,12 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-157.243,92	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,05 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-177.737,99	-0,02
JPMorgan Chase & Co. 26,30 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-22.132,50	0,00
JPMorgan Chase & Co. 35,12 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-120.467,52	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,37 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-173.458,34	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 28,65 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-93.209,90	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,17 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-109.778,36	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 28,14 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-30.220,06	0,00
JPMorgan Chase & Co. 28,89 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-93.850,36	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 35,07 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-109.783,84	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,45 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-28.511,74	0,00
JPMorgan Chase & Co. 26,89 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-61.285,30	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 27,32 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-50.477,55	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,10 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-133.385,74	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,30 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-38.156,07	0,00
JPMorgan Chase & Co. 27,14 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-57.480,89	0,00
JPMorgan Chase & Co. 27,90 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-50.188,94	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,19 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-124.212,28	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,19 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-99.231,40	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,15 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-124.110,51	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,58 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-139.226,56	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 35,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-130.630,32	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-104.003,80	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-97.204,54	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,75 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-39.642,71	0,00
JPMorgan Chase & Co. 27,21 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-57.290,26	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,56 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-101.125,97	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,46 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-39.114,73	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,16 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-77.292,77	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 26,28 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-25.900,38	0,00
JPMorgan Chase & Co. 28,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-91.619,31	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,69 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-70.349,20	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,64 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-112.355,84	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,86 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-157.645,25	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 27,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-52.575,02	0,00
JPMorgan Chase & Co. 29,60 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-158.416,74	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,37 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-103.343,03	-0,01
Juniper Networks, Inc. 31,31 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-57.405,98	0,00
K+S AG 43,89 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-84.798,00	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 30,97 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-108.198,48	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 27,12 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-32.005,95	0,00
Kinder Morgan, Inc. 27,12 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-46.430,64	0,00
Kinder Morgan, Inc. 26,94 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-155.883,68	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 32,16 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-183.300,71	-0,02
Kinder Morgan, Inc. 31,34 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-188.202,06	-0,02
Kinder Morgan, Inc. 28,62 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-76.971,78	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 28,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-196.731,30	-0,02
Kinder Morgan, Inc. 33,42 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-282.046,29	-0,02
Kinder Morgan, Inc. 31,54 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-116.717,78	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 25,65 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-19.387,52	0,00
Kinder Morgan, Inc. 26,50 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-50.234,03	0,00
Kinder Morgan, Inc. 27,84 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-59.933,67	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 28,58 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-76.305,25	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 33,25 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-142.237,13	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 28,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-196.997,04	-0,02
Kinder Morgan, Inc. 28,39 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-150.927,94	-0,01
Koninklijke Ahold Delhaize N.V. 23,91 %	21.06.2024	800.000	EUR	-47.811,92	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Kraft Heinz Co./The 23,93 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-48.295,60	0,00
Kraft Heinz Co./The 25,93 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-96.277,20	-0,01
Kraft Heinz Co./The 26,35 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-81.243,69	-0,01
Kraft Heinz Co./The 25,35 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-57.220,52	0,00
Kraft Heinz Co./The 25,69 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-165.851,39	-0,01
Kraft Heinz Co./The 26,63 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-64.478,73	-0,01
Kraft Heinz Co./The 28,19 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-183.118,33	-0,02
Las Vegas Sands Corp. 42,45 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-93.987,17	-0,01
Las Vegas Sands Corp. 43,29 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-70.606,07	-0,01
Las Vegas Sands Corp. 39,98 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-93.588,78	-0,01
Las Vegas Sands Corp. 42,34 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-104.976,68	-0,01
Las Vegas Sands Corp. 38,44 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-27.468,84	0,00
Las Vegas Sands Corp. 39,25 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-50.324,93	0,00
Las Vegas Sands Corp. 40,53 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-43.491,07	0,00
Lennar Corp. 38,03 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-132.122,60	-0,01
Lennar Corp. 39,19 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-150.364,80	-0,01
Lennar Corp. 37,80 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-101.509,17	-0,01
Lennar Corp. 39,22 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-115.554,84	-0,01
Lennar Corp. 37,55 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-79.185,94	-0,01
Lennar Corp. 37,49 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-75.022,99	-0,01
Lennar Corp. 36,59 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-81.442,52	-0,01
Lennar Corp. 38,87 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-78.534,95	-0,01
Lennar Corp. 37,32 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-116.991,29	-0,01
Lennar Corp. 38,11 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-110.225,71	-0,01
Lloyds Banking Group PLC 31,89 %	21.06.2024	703.400	GBP	-29.519,38	0,00
Lloyds Banking Group PLC 33,94 %	21.06.2024	1.097.100	GBP	-71.392,36	-0,01
Louisiana-Pacific Corp. 42,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-164.447,79	-0,01
Louisiana-Pacific Corp. 42,24 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-178.193,20	-0,02
Louisiana-Pacific Corp. 36,95 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-50.218,55	0,00
Lowe's Cos., Inc. 32,88 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-57.739,67	0,00
Lowe's Cos., Inc. 36,84 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-118.078,96	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 38,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-95.313,82	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 33,59 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-129.483,59	-0,01
Lowe's Cos., Inc. 33,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-66.149,04	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 40,61 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-90.048,08	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 38,96 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-74.915,46	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 39,28 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-80.234,99	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 38,37 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-70.177,43	-0,01
Marriott International, Inc. 34,75 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-127.772,78	-0,01
Marriott International, Inc. 30,96 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-33.032,74	0,00
Marriott International, Inc. 31,35 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-45.132,82	0,00
Marriott International, Inc. 32,76 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-107.489,69	-0,01
Marriott International, Inc. 33,80 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-83.169,46	-0,01
Marriott International, Inc. 33,99 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-55.695,13	0,00
Marriott International, Inc. 33,45 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-77.603,46	-0,01
Marriott International, Inc. 30,80 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-61.911,82	-0,01
Marriott International, Inc. 34,33 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-116.238,00	-0,01
Mastercard, Inc. 28,95 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-118.406,45	-0,01
Mastercard, Inc. 28,66 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-68.389,82	-0,01
Mastercard, Inc. 29,24 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-116.809,64	-0,01
Mastercard, Inc. 28,25 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-66.426,04	-0,01
Mastercard, Inc. 27,84 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-92.742,13	-0,01
Mastercard, Inc. 30,95 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-196.417,96	-0,02
McDonald's Corp. 22,37 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-80.857,26	-0,01
McDonald's Corp. 25,92 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-109.420,33	-0,01
McDonald's Corp. 25,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-114.783,45	-0,01
McDonald's Corp. 20,91 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-42.798,19	0,00
McDonald's Corp. 23,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-90.521,75	-0,01
McDonald's Corp. 26,72 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-91.188,84	-0,01
McDonald's Corp. 27,63 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-129.558,00	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
McDonald's Corp. 23,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-98.600,64	-0,01
McDonald's Corp. 22,34 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-131.981,77	-0,01
McDonald's Corp. 20,73 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-46.177,02	0,00
McDonald's Corp. 25,12 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-92.577,89	-0,01
McDonald's Corp. 26,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-132.042,22	-0,01
McDonald's Corp. 25,10 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-122.525,41	-0,01
McDonald's Corp. 25,38 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-196.431,73	-0,02
McDonald's Corp. 23,46 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-114.773,70	-0,01
McDonald's Corp. 27,03 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-236.579,65	-0,02
McDonald's Corp. 23,02 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-80.584,13	-0,01
McDonald's Corp. 22,39 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-63.619,34	-0,01
McDonald's Corp. 26,09 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-193.551,64	-0,02
McDonald's Corp. 27,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-127.085,93	-0,01
McDonald's Corp. 27,21 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-122.896,88	-0,01
McDonald's Corp. 20,98 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-108.015,84	-0,01
McDonald's Corp. 23,87 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-115.651,09	-0,01
McDonald's Corp. 22,8 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-168.050,50	-0,01
Mckesson Corp. 28,34 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-73.997,00	-0,01
Mercedes-Benz Group AG 39,32 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-168.152,45	-0,01
Meta Platforms, Inc. 41,60 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-4.458,68	0,00
MetLife, Inc. 32,46 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-7.202,78	0,00
MetLife, Inc. 34,36 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-68.357,95	-0,01
MetLife, Inc. 26,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	132.682,49	0,01
MetLife, Inc. 26,42 %	19.01.2024	2.000.000	USD	122.600,35	0,01
MetLife, Inc. 35,06 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-62.726,93	-0,01
MetLife, Inc. 35,86 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-72.877,82	-0,01
MetLife, Inc. 28,53 %	19.01.2024	1.500.000	USD	50.085,00	0,00
MetLife, Inc. 35,46 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-55.069,34	0,00
MetLife, Inc. 32,54 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-44.552,12	0,00
MetLife, Inc. 36,95 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-57.596,42	0,00
MetLife, Inc. 27,19 %	19.01.2024	2.000.000	USD	93.798,48	0,01
MetLife, Inc. 35,55 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-46.362,14	0,00
MetLife, Inc. 30,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-19.890,23	0,00
MetLife, Inc. 33,91 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-56.361,84	0,00
MetLife, Inc. 27,56 %	21.06.2024	1.300.000	USD	57.829,18	0,00
MetLife, Inc. 34,18 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-83.479,94	-0,01
MetLife, Inc. 26,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	88.181,46	0,01
MetLife, Inc. 35,08 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-50.796,84	0,00
MetLife, Inc. 27,56 %	21.06.2024	1.200.000	USD	55.886,02	0,00
MetLife, Inc. 36,45 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-78.568,72	-0,01
MetLife, Inc. 26,90 %	21.06.2024	2.000.000	USD	91.615,89	0,01
MetLife, Inc. 29,37 %	19.01.2024	2.500.000	USD	62.045,55	0,01
MGM Resorts International 40,94 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-66.710,06	-0,01
MGM Resorts International 42,66 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-90.075,47	-0,01
MGM Resorts International 43,51 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-82.938,44	-0,01
MGM Resorts International 43,00 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-117.780,03	-0,01
MGM Resorts International 38,60 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-60.051,30	-0,01
MGM Resorts International 41,96 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-131.341,39	-0,01
MGM Resorts International 41,78 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-129.190,58	-0,01
MGM Resorts International 41,02 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-89.056,65	-0,01
MGM Resorts International 46,48 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-257.127,17	-0,02
MGM Resorts International 39,30 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-50.421,69	0,00
MGM Resorts International 38,60 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-48.425,10	0,00
MGM Resorts International 37,51 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-26.176,02	0,00
Micron Technology, Inc. 47,97 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-129.941,87	-0,01
Micron Technology, Inc. 49,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-96.568,76	-0,01
Micron Technology, Inc. 47,74 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-63.389,83	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,44 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-136.600,24	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,23 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-87.976,48	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,74 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-108.712,55	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Micron Technology, Inc. 48,75 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-94.774,28	-0,01
Microsoft Corp. 33,53 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-25.710,64	0,00
Microsoft Corp. 28,01 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-19.737,19	0,00
Microsoft Corp. 31,77 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-23.953,48	0,00
Microsoft Corp. 30,69 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-83.352,52	-0,01
Microsoft Corp. 33,97 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-29.952,70	0,00
Microsoft Corp. 32,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-26.901,89	0,00
Microsoft Corp. 32,38 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-19.234,31	0,00
Microsoft Corp. 33,17 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-75.535,91	-0,01
Microsoft Corp. 34,14 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-41.636,03	0,00
Microsoft Corp. 33,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-40.210,62	0,00
Mondelez International, Inc. 21,65 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-88.041,48	-0,01
Mondelez International, Inc. 21,54 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-53.539,99	0,00
Mondelez International, Inc. 23,29 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-126.367,57	-0,01
Mondelez International, Inc. 21,73 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-109.872,45	-0,01
Mondelez International, Inc. 25,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-97.246,81	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,18 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-226.676,14	-0,02
Monster Beverage Corp. 28,70 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-22.321,92	0,00
Monster Beverage Corp. 28,35 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-78.054,06	-0,01
Monster Beverage Corp. 29,08 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-168.389,09	-0,01
Monster Beverage Corp. 37,39 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-129.629,43	-0,01
Monster Beverage Corp. 30,08 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-146.341,57	-0,01
Monster Beverage Corp. 29,85 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-84.540,21	-0,01
Monster Beverage Corp. 38,50 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-137.714,71	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,72 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-155.630,08	-0,01
Monster Beverage Corp. 36,25 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-178.133,94	-0,02
Monster Beverage Corp. 28,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-80.664,59	-0,01
Monster Beverage Corp. 27,74 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-15.289,24	0,00
Monster Beverage Corp. 29,85 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-37.831,68	0,00
Monster Beverage Corp. 30,48 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-120.168,10	-0,01
Monster Beverage Corp. 28,33 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-65.019,08	-0,01
Monster Beverage Corp. 29,78 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-153.915,53	-0,01
Monster Beverage Corp. 31,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-140.897,89	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,51 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-135.664,82	-0,01
Monster Beverage Corp. 29,35 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-54.461,04	0,00
Monster Beverage Corp. 28,70 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-93.869,04	-0,01
Monster Beverage Corp. 27,26 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-53.222,48	0,00
Monster Beverage Corp. 37,41 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-194.944,85	-0,02
Monster Beverage Corp. 34,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-122.178,44	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,73 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-137.294,27	-0,01
Monster Beverage Corp. 31,95 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-88.110,58	-0,01
Morgan Stanley 32,69 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-76.640,98	-0,01
Morgan Stanley 35,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-102.070,21	-0,01
Morgan Stanley 30,69 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-46.036,58	0,00
Morgan Stanley 30,43 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-29.347,10	0,00
Morgan Stanley 34,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-94.498,58	-0,01
Morgan Stanley 32,06 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-53.885,50	0,00
Morgan Stanley 30,25 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-37.935,53	0,00
Morgan Stanley 36,18 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-157.861,27	-0,01
Morgan Stanley 33,27 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-141.931,09	-0,01
Morgan Stanley 34,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-95.566,18	-0,01
Morgan Stanley 33,31 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-123.898,21	-0,01
Morgan Stanley 30,05 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-41.604,55	0,00
Morgan Stanley 28,60 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-23.057,97	0,00
Morgan Stanley 30,87 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-52.944,47	0,00
Morgan Stanley 33,55 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-153.408,20	-0,01
Morgan Stanley 34,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-93.268,34	-0,01
Morgan Stanley 35,78 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-174.285,06	-0,01
Morgan Stanley 33,20 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-76.242,30	-0,01
Morgan Stanley 28,88 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-33.479,85	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Morgan Stanley 34,55 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-152.978,39	-0,01
Morgan Stanley 32,85 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-160.492,57	-0,01
Morgan Stanley 29,56 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-68.051,53	-0,01
Morgan Stanley 30,99 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-38.082,06	0,00
Morgan Stanley 33,67 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-66.968,30	-0,01
Morgan Stanley 30,19 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-66.561,71	-0,01
Morgan Stanley 35,78 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-141.098,08	-0,01
Morgan Stanley 29,85 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-49.475,95	0,00
Morgan Stanley 34,44 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-122.694,48	-0,01
Morgan Stanley 30,40 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-49.819,75	0,00
Morgan Stanley 31,15 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-92.433,43	-0,01
Morgan Stanley 31,66 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-74.052,30	-0,01
Morgan Stanley 30,80 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-66.411,92	-0,01
Morgan Stanley 36,85 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-167.488,69	-0,01
Morgan Stanley 38,80 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-128.478,17	-0,01
Morgan Stanley 34,09 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-112.873,33	-0,01
Morgan Stanley 30,13 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-53.375,00	0,00
Morgan Stanley 38,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-151.969,76	-0,01
Morgan Stanley 35,66 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-111.345,22	-0,01
Morgan Stanley 40,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-115.515,74	-0,01
Morgan Stanley 29,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-75.575,98	-0,01
Morgan Stanley 36,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-207.335,47	-0,02
Morgan Stanley 31,30 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-51.168,57	0,00
Morgan Stanley 29,51 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-65.741,13	-0,01
Morgan Stanley 29,89 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-19.038,79	0,00
Morgan Stanley 34,43 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-94.730,49	-0,01
Morgan Stanley 35,98 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-186.032,45	-0,02
Morgan Stanley 33,73 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-90.809,84	-0,01
Morgan Stanley 37,01 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-84.357,27	-0,01
Morgan Stanley 36,39 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-157.839,71	-0,01
Morgan Stanley 38,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-140.727,15	-0,01
Morgan Stanley 32,08 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-51.798,01	0,00
Motorola Solutions, Inc. 32,07 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-153.275,47	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 37,35 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-146.177,66	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 35,67 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-106.637,96	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 30,28 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-122.464,46	-0,01
Münchener Rückversicherungs AG 25,98 %	21.06.2024	800.000	EUR	-41.833,99	0,00
Münchener Rückversicherungs AG 30,28 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-155.767,74	-0,01
Münchener Rückversicherungs AG 30,79 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-109.070,21	-0,01
NASDAQ 100 Index 29,02 %	19.01.2024	5.280.000	USD	213.610,46	0,02
NASDAQ 100 Index 30,03 %	19.01.2024	12.000.000	USD	598.771,84	0,05
NASDAQ 100 Index 31,56 %	19.01.2024	4.200.000	USD	299.842,73	0,03
NASDAQ 100 Index 29,63 %	19.01.2024	4.500.000	USD	207.620,56	0,02
NASDAQ 100 Index 24,90 %	21.06.2024	13.500.000	USD	418.831,75	0,04
NASDAQ 100 Index 29,62 %	19.01.2024	12.500.000	USD	576.360,68	0,05
Nestle S.A. 18,03 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-25.291,39	0,00
Nestle S.A. 18,42 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	-62.733,29	-0,01
NetApp, Inc. 35,39 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-49.355,64	0,00
NetApp, Inc. 36,75 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-64.626,50	-0,01
NetApp, Inc. 39,58 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-137.831,20	-0,01
NetApp, Inc. 37,73 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-68.285,06	-0,01
NetApp, Inc. 35,20 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-62.517,21	-0,01
Netflix, Inc. 48,20 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-165.971,09	-0,01
Netflix, Inc. 44,35 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-77.392,46	-0,01
Newmont Corp. 39,42 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-100.449,30	-0,01
Nokia Oyj 32,48 %	20.06.2024	800.000	EUR	20.844,46	0,00
Nokia Oyj 31,30 %	20.06.2024	1.800.000	EUR	75.469,39	0,01
Nokia Oyj 29,35 %	20.06.2024	1.500.000	EUR	83.718,06	0,01
Norfolk Southern Corp. 31,17 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-118.390,02	-0,01
Novartis AG 20,18 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-22.383,14	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Novartis AG 21,74 %	15.12.2023	984.000	CHF	-35.002,41	0,00
Novartis AG 20,95 %	15.12.2023	1.491.000	CHF	-40.033,69	0,00
NXP Semiconductors NV 40,05 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-94.109,49	-0,01
NXP Semiconductors NV 37,95 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-42.539,50	0,00
NXP Semiconductors NV 37,53 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-43.291,66	0,00
NXP Semiconductors NV 42,40 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-134.662,68	-0,01
Occidental Petroleum Corp. 37,70 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-66.161,36	-0,01
Occidental Petroleum Corp. 39,38 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-104.754,17	-0,01
Occidental Petroleum Corp. 37,86 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-99.323,81	-0,01
Occidental Petroleum Corp. 36,10 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-25.618,00	0,00
Orange S.A. 20,75 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-40.148,56	0,00
Orange S.A. 21,88 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-81.968,61	-0,01
Orange S.A. 22,65 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-125.473,78	-0,01
Orange S.A. 21,12 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-136.083,96	-0,01
Orange S.A. 21,36 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-42.870,90	0,00
Orange S.A. 22,71 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-90.690,06	-0,01
Orange S.A. 19,14 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-34.931,66	0,00
Orange S.A. 28,86 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	240.191,30	0,02
PACCAR , Inc. 28,62 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-60.215,97	-0,01
Packaging Corp. of America 34,22 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-68.790,15	-0,01
Palo Alto Networks 37,42 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-14.627,88	0,00
Palo Alto Networks 37,81 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-22.381,77	0,00
Palo Alto Networks 37,46 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-19.474,51	0,00
Palo Alto Networks 39,13 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-43.001,42	0,00
Palo Alto Networks 37,84 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-28.717,95	0,00
Palo Alto Networks 36,75 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-21.142,38	0,00
Palo Alto Networks 38,40 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-43.893,38	0,00
Palo Alto Networks 41,55 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-119.072,14	-0,01
PepsiCo, Inc. 19,44 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-58.492,36	-0,01
PepsiCo, Inc. 20,06 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-45.412,56	0,00
PepsiCo, Inc. 21,93 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-94.355,13	-0,01
PepsiCo, Inc. 20,69 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-101.664,66	-0,01
PepsiCo, Inc. 22,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-107.069,05	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,94 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-112.047,64	-0,01
PepsiCo, Inc. 19,23 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-31.199,88	0,00
PepsiCo, Inc. 26,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-100.168,77	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-69.432,71	-0,01
PepsiCo, Inc. 20,10 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-45.265,50	0,00
PepsiCo, Inc. 21,03 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-52.083,66	0,00
PepsiCo, Inc. 21,12 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-40.080,57	0,00
Petroleo Brasileiro S.A. 42,2 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-87.474,38	-0,01
Petroleo Brasileiro S.A. 48,50 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-169.890,12	-0,01
Petroleo Brasileiro S.A. 49,81 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-201.640,86	-0,02
Petroleo Brasileiro S.A. 40,00 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-26.168,23	0,00
PG&E Corp. 32,05 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-46.703,67	0,00
PG&E Corp. 33,72 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-97.560,72	-0,01
PG&E Corp. 29,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-75.726,39	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 42,11 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-200.715,24	-0,02
Pioneer Natural Resources Co. 40,38 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-105.812,90	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 37,29 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-135.826,95	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 37,49 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-130.956,70	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 35,29 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-64.126,67	-0,01
Pioneer Natural Resources Co. 33,07 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-39.158,87	0,00
PNC Financial Services Group, Inc./The 35,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-6.094,49	0,00
PNC Financial Services Group, Inc./The 29,29 %	21.06.2024	1.500.000	USD	88.134,74	0,01
Porsche Automobil Holding SE 34,65 %	21.06.2024	800.000	EUR	-56.229,70	0,00
Porsche Automobil Holding SE 35,99 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-100.162,56	-0,01
Porsche Automobil Holding SE 35,52 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-98.347,00	-0,01
Procter & Gamble Co./The 21,03 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-49.082,57	0,00
Prudential Financial, Inc. 30,85 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-24.156,17	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Prudential Financial, Inc. 28,74 %	19.01.2024	2.500.000	USD	21.692,39	0,00
Prudential Financial, Inc. 32,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-48.452,65	0,00
Prudential Financial, Inc. 31,16 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-47.068,21	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,77 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-158.613,26	-0,01
Prudential Financial, Inc. 39,77 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-94.312,43	-0,01
Prudential Financial, Inc. 30,49 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-21.025,00	0,00
Prudential Financial, Inc. 38,86 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-88.943,12	-0,01
Prudential Financial, Inc. 29,62 %	19.01.2024	2.000.000	USD	11.710,48	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-79.466,25	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-117.553,53	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-117.767,46	-0,01
Prudential Financial, Inc. 32,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-39.814,91	0,00
Prudential Financial, Inc. 28,41 %	19.01.2024	2.500.000	USD	30.359,21	0,00
Prudential Financial, Inc. 29,82 %	21.06.2024	1.300.000	USD	4.063,69	0,00
Prudential Financial, Inc. 38,31 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-123.091,00	-0,01
Prudential Financial, Inc. 35,45 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-57.139,70	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,97 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-118.999,04	-0,01
Prudential Financial, Inc. 31,06 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-22.046,00	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,17 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-55.302,73	0,00
Prudential Financial, Inc. 35,38 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-146.779,61	-0,01
Prudential Financial, Inc. 31,65 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-48.643,63	0,00
Prudential Financial, Inc. 29,69 %	19.01.2024	1.500.000	USD	9.069,47	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-93.898,34	-0,01
Prudential Financial, Inc. 31,86 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-56.440,56	0,00
Prudential Financial, Inc. 29,18 %	21.06.2024	2.500.000	USD	13.201,31	0,00
Prudential Financial, Inc. 30,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-32.545,48	0,00
Prudential Financial, Inc. 30,78 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-3.930,53	0,00
Prudential Financial, Inc. 36,98 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-87.544,63	-0,01
Prudential Financial, Inc. 33,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-58.832,16	-0,01
Prudential Financial, Inc. 31,27 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-33.595,77	0,00
Prudential Financial, Inc. 36,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-87.186,25	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,46 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.117,38	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,22 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-164.463,67	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,90 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-85.674,54	-0,01
Prudential Financial, Inc. 28,49 %	21.06.2024	2.500.000	USD	43.785,38	0,00
Prudential Financial, Inc. 36,22 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-84.037,10	-0,01
PulteGroup, Inc. 40,08 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-125.331,16	-0,01
PulteGroup, Inc. 39,19 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-143.038,48	-0,01
PulteGroup, Inc. 37,10 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-44.107,29	0,00
PulteGroup, Inc. 37,55 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-70.080,53	-0,01
PulteGroup, Inc. 38,33 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-123.829,90	-0,01
PulteGroup, Inc. 36,76 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-53.725,87	0,00
PulteGroup, Inc. 38,52 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-191.408,58	-0,02
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-59.872,40	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,50 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-31.885,37	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,91 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-56.878,02	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,86 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-25.144,36	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,32 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-11.634,67	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,26 %	21.06.2024	1.500.000	USD	3.957,36	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,72 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-33.690,04	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 34,74 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-75.090,58	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 34,58 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-42.099,88	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,45 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-30.930,91	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,21 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-20.503,34	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,54 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-12.551,73	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,84 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-22.695,08	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,04 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-29.490,19	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,31 %	21.06.2024	1.200.000	USD	1.574,14	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,73 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-46.859,77	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,30 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-25.082,35	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,69 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-13.639,80	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,74 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-30.635,58	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,32 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-3.607,11	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,93 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-26.996,25	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 30,70 %	17.01.2025	2.000.000	USD	17.484,82	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,48 %	17.01.2025	2.500.000	USD	5.656,72	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 34,47 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-40.239,77	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,11 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-37.837,08	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 30,43 %	17.01.2025	3.000.000	USD	37.407,56	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,05 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-25.079,88	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,80 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-5.172,32	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,83 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-23.785,12	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,14 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-402,90	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 32,99 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-21.375,30	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,08 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-15.584,74	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,50 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-4.733,00	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 30,85 %	17.01.2025	1.750.000	USD	16.751,83	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,11 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-1.005,85	0,00
Regions Financial Corp. 34,18 %	21.06.2024	1.200.000	USD	76.575,90	0,01
Regions Financial Corp. 35,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	25.684,80	0,00
Rio Tinto PLC 36,07 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-155.945,30	-0,01
Rio Tinto PLC 32,04 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-67.356,97	-0,01
Rio Tinto PLC 35,70 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-66.585,14	-0,01
Rio Tinto PLC 34,18 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-63.868,57	-0,01
Rio Tinto PLC 35,70 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-66.059,49	-0,01
Rio Tinto PLC 37,47 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-91.786,52	-0,01
Rio Tinto PLC 32,55 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-51.533,60	0,00
Rio Tinto PLC 38,45 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-173.134,50	-0,01
Roche Holding AG 22,53 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-81.430,46	-0,01
Roche Holding AG 19,57 %	21.06.2024	2.467.500	CHF	-68.476,36	-0,01
Roche Holding AG 18,94 %	15.12.2023	1.976.000	CHF	-58.259,74	0,00
Roche Holding AG 23,89 %	15.12.2023	984.000	CHF	-73.879,84	-0,01
Roche Holding AG 19,30 %	21.06.2024	1.243.900	CHF	-29.303,44	0,00
Roche Holding AG 19,45 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	-52.170,02	0,00
Ross Stores, Inc. 31,10 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-34.203,81	0,00
RWE AG 29,51 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-94.351,71	-0,01
S&P 500 Index 20,60 %	21.06.2024	20.000.000	USD	803.245,28	0,07
S&P 500 Index 21,05 %	19.01.2024	42.500.000	USD	2.224.150,04	0,19
S&P 500 Index 19,23 %	21.06.2024	28.500.000	USD	785.582,52	0,07
S&P 500 Index 18,55 %	17.01.2025	33.250.000	USD	423.315,17	0,04
S&P 500 Index 22,45 %	21.06.2024	18.676.000	USD	994.050,89	0,08
S&P 500 Index 19,00 %	17.01.2025	30.000.000	USD	486.891,21	0,04
S&P 500 Index 25,45 %	19.01.2024	27.500.000	USD	1.682.503,19	0,14
S&P 500 Index 20,49 %	21.06.2024	30.000.000	USD	1.139.233,09	0,10
S&P 500 Index 27,40 %	15.12.2023	20.263.300	USD	1.950.321,27	0,17
S&P 500 Index 18,10 %	17.01.2025	30.000.000	USD	278.302,39	0,02
S&P 500 Index 24,94 %	19.01.2024	16.500.000	USD	946.601,82	0,08
S&P 500 Index 21,12 %	21.06.2024	26.064.000	USD	1.094.348,04	0,09
S&P 500 Index 27,88 %	19.01.2024	16.000.000	USD	1.486.518,79	0,13
S&P 500 Index 20,42 %	21.06.2024	10.890.000	USD	431.835,82	0,04
S&P 500 Index 25,17 %	19.01.2024	20.000.000	USD	1.192.814,67	0,10
S&P 500 Index 22,54 %	19.01.2024	24.000.000	USD	1.554.260,24	0,13
S&P 500 Index 25,01 %	19.01.2024	8.000.000	USD	458.170,71	0,04
S&P 500 Index 21,90 %	19.01.2024	33.000.000	USD	1.997.431,62	0,17
S&P 500 Index 18,40 %	17.01.2025	40.000.000	USD	463.931,43	0,04
S&P 500 Index 20,51 %	19.01.2024	37.500.000	USD	1.920.304,88	0,16
S&P 500 Index 25,90 %	19.01.2024	25.200.000	USD	2.037.454,88	0,17
S&P 500 Index 22,76 %	21.06.2024	37.500.000	USD	2.231.970,78	0,19
S&P 500 Index 20,53 %	21.06.2024	57.000.000	USD	2.281.095,06	0,19
S&P 500 Index 20,62 %	19.01.2024	48.000.000	USD	2.358.621,01	0,20

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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index 26,62 %	19.01.2024	15.000.000	USD	1.173.081,40	0,10
S&P 500 Index 23,31 %	19.01.2024	22.500.000	USD	1.558.962,10	0,13
S&P 500 Index 18,95 %	17.01.2025	35.000.000	USD	559.328,87	0,05
S&P 500 Index 20,72 %	17.01.2025	30.800.000	USD	933.440,73	0,08
S&P 500 Index 20,55 %	17.01.2025	30.000.000	USD	898.603,95	0,08
S&P 500 Index 24,87 %	19.01.2024	12.500.000	USD	695.991,64	0,06
S&P 500 Index 27,16 %	19.01.2024	19.500.000	USD	1.694.079,21	0,14
S&P 500 Index 26,10 %	19.01.2024	24.000.000	USD	2.009.573,89	0,17
S&P 500 Index 22,02 %	21.06.2024	38.671.200	USD	1.921.505,64	0,16
S&P 500 Index 24,39 %	19.01.2024	22.500.000	USD	1.688.889,81	0,14
S&P 500 Index 20,95 %	17.01.2025	30.000.000	USD	962.008,16	0,08
S&P 500 Index 25,98 %	19.01.2024	16.000.000	USD	1.204.669,47	0,10
S&P 500 Index 21,45 %	17.01.2025	22.500.000	USD	827.118,98	0,07
S&P 500 Index 19,96 %	21.06.2024	12.219.800	USD	440.480,33	0,04
S&P 500 Index 26,06 %	19.01.2024	16.800.000	USD	1.272.480,66	0,11
S&P 500 Index 21,62 %	19.01.2024	37.500.000	USD	2.175.065,99	0,18
S&P 500 Index 23,47 %	21.06.2024	25.000.000	USD	1.618.255,73	0,14
S&P 500 Index 26,40 %	19.01.2024	19.000.000	USD	1.557.506,45	0,13
S&P 500 Index 20,90 %	17.01.2025	32.000.000	USD	1.018.011,22	0,09
S&P 500 Index 24,32 %	19.01.2024	21.120.000	USD	1.072.617,43	0,09
S&P 500 Index 20,51 %	21.06.2024	40.500.000	USD	1.563.208,31	0,13
S&P 500 Index 23,58 %	19.01.2024	18.000.000	USD	802.081,49	0,07
S&P 500 Index 24,27 %	19.01.2024	25.000.000	USD	1.870.953,94	0,16
S&P 500 Index 20,00 %	17.01.2025	37.500.000	USD	935.330,77	0,08
S&P 500 Index 25,07 %	19.01.2024	27.500.000	USD	2.015.135,23	0,17
S&P 500 Index 18,78 %	17.01.2025	25.000.000	USD	379.856,33	0,03
S&P 500 Index 20,20 %	21.06.2024	31.500.000	USD	1.127.851,87	0,10
S&P 500 Index 22,90 %	21.06.2024	42.000.000	USD	2.516.442,13	0,21
S&P 500 Index 20,75 %	19.01.2024	35.000.000	USD	1.748.312,87	0,15
S&P 500 Index 25,46 %	19.01.2024	21.000.000	USD	1.291.538,11	0,11
S&P 500 Index 20,66 %	21.06.2024	20.800.000	USD	861.334,48	0,07
S&P 500 Index 18,65 %	17.01.2025	28.000.000	USD	393.144,63	0,03
S&P 500 Index 21,97 %	19.01.2024	55.000.000	USD	3.349.013,52	0,28
S&P 500 Index 25,99 %	19.01.2024	18.000.000	USD	1.196.566,92	0,10
S&P 500 Index 19,67 %	17.01.2025	28.600.000	USD	626.834,66	0,05
S&P 500 Index 20,55 %	21.06.2024	36.000.000	USD	1.473.313,36	0,12
S&P 500 Index 25,38 %	15.12.2023	8.000.000	USD	486.743,98	0,04
S&P 500 Index 20,50 %	21.06.2024	50.000.000	USD	2.037.346,93	0,17
S&P 500 Index 24,98 %	15.12.2023	15.433.080	USD	1.169.611,60	0,10
S&P 500 Index 21,41 %	19.01.2024	25.000.000	USD	1.398.483,28	0,12
S&P 500 Index 25,83 %	19.01.2024	19.500.000	USD	1.256.209,13	0,11
S&P 500 Index 26,03 %	19.01.2024	20.800.000	USD	1.371.060,50	0,12
S&P 500 Index 21,43 %	21.06.2024	45.000.000	USD	2.132.466,68	0,18
S&P 500 Index 20,54 %	21.06.2024	30.000.000	USD	1.164.403,67	0,10
S&P 500 Index 24,35 %	19.01.2024	15.000.000	USD	774.847,07	0,07
S&P 500 Index 21,00 %	21.06.2024	31.200.000	USD	1.339.201,52	0,11
S&P 500 Index 22,32 %	21.06.2024	20.000.000	USD	1.116.109,44	0,09
S&P 500 Index 22,03 %	21.06.2024	19.260.000	USD	1.034.010,26	0,09
S&P 500 Index 25,24 %	19.01.2024	19.200.000	USD	1.231.769,04	0,10
S&P 500 Index 21,66 %	21.06.2024	16.000.000	USD	816.251,95	0,07
S&P 500 Index 20,80 %	21.06.2024	28.500.000	USD	1.247.646,15	0,11
S&P 500 Index 24,11 %	15.12.2023	16.731.000	USD	842.890,91	0,07
S&P 500 Index 27,13 %	19.01.2024	21.600.000	USD	1.956.323,09	0,17
S&P 500 Index 20,11 %	19.01.2024	30.000.000	USD	1.399.571,77	0,12
S&P 500 Index 20,57 %	21.06.2024	17.600.000	USD	738.977,87	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index 20,44 %	21.06.2024	32.500.000	USD	1.193.282,04	0,10
S&P 500 Index 27,37 %	19.01.2024	21.600.000	USD	2.011.872,50	0,17
S&P 500 Index 26,84 %	15.12.2023	14.745.000	USD	1.327.356,25	0,11
S&P 500 Index 21,29 %	21.06.2024	20.000.000	USD	878.418,52	0,07
S&P 500 Index 24,00 %	19.01.2024	20.000.000	USD	971.138,77	0,08
S&P 500 Index 24,33 %	19.01.2024	22.500.000	USD	1.158.122,64	0,10
S&P 500 Index 21,00 %	21.06.2024	22.500.000	USD	1.028.355,81	0,09
S&P 500 Index 21,30 %	21.06.2024	19.200.000	USD	919.463,36	0,08
S&P 500 Index 23,60 %	19.01.2024	24.000.000	USD	1.087.440,22	0,09
S&P 500 Index 23,10 %	21.06.2024	19.500.000	USD	1.228.051,20	0,10
S&P 500 Index 23,57 %	19.01.2024	20.000.000	USD	897.215,95	0,08
S&P 500 Index 20,13 %	21.06.2024	27.000.000	USD	1.011.468,26	0,09
S&P 500 Index 24,75 %	19.01.2024	20.000.000	USD	1.105.982,95	0,09
S&P 500 Index 21,33 %	21.06.2024	26.965.000	USD	1.306.319,55	0,11
S&P 500 Index 24,32 %	19.01.2024	22.500.000	USD	1.191.512,36	0,10
S&P 500 Index 20,90 %	21.06.2024	40.000.000	USD	1.746.372,13	0,15
S&P 500 Index 20,81 %	21.06.2024	22.642.900	USD	999.267,50	0,08
S&P 500 Index 19,95 %	19.01.2024	37.500.000	USD	1.654.640,58	0,14
S&P 500 Index 20,61 %	21.06.2024	18.000.000	USD	764.678,61	0,06
S&P 500 Index 23,30 %	19.01.2024	25.000.000	USD	1.069.104,72	0,09
S&P 500 Index 21,34 %	21.06.2024	30.000.000	USD	1.443.420,17	0,12
S&P 500 Index 25,71 %	19.01.2024	19.500.000	USD	1.344.554,68	0,11
S&P 500 Index 19,71 %	19.01.2024	35.000.000	USD	1.459.851,60	0,12
S&P 500 Index 22,30 %	21.06.2024	19.500.000	USD	1.091.009,28	0,09
S&P 500 Index 19,89 %	21.06.2024	26.400.000	USD	932.652,96	0,08
S&P 500 Index 25,95 %	15.12.2023	15.075.000	USD	1.238.599,73	0,10
S&P 500 Index 25,79 %	15.12.2023	13.172.000	USD	1.061.018,36	0,09
S&P 500 Index 24,90 %	19.01.2024	21.000.000	USD	1.219.896,35	0,10
S&P 500 Index 23,67 %	19.01.2024	22.500.000	USD	1.018.491,07	0,09
S&P Global, Inc. 30,75 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-128.817,83	-0,01
S&P Global, Inc. 34,84 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-113.236,12	-0,01
Safran S.A. 30,51 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-82.763,84	-0,01
Safran S.A. 30,38 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-125.828,48	-0,01
salesforce.com, Inc. 38,11 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-93.695,78	-0,01
salesforce.com, Inc. 36,07 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-47.253,37	0,00
Sanofi 24,11 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-23.685,25	0,00
SAP SE 30,82 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-118.812,77	-0,01
SAP SE 32,96 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-144.742,90	-0,01
SAP SE 27,92 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-133.153,32	-0,01
Schneider Electric SE 32,45 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-69.315,81	-0,01
Schneider Electric SE 31,37 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-34.021,26	0,00
Schneider Electric SE 29,99 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-56.226,90	0,00
Schneider Electric SE 34,89 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-97.893,23	-0,01
Schneider Electric SE 33,15 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-76.516,18	-0,01
Schneider Electric SE 34,36 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-74.361,71	-0,01
Schneider Electric SE 29,99 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-71.049,77	-0,01
Seagate Technology PLC 42,53 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-52.682,68	0,00
Sempra Energy 27,70 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-49.446,43	0,00
Sempra Energy 29,68 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-58.643,21	-0,01
Sempra Energy 29,38 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-72.637,64	-0,01
Sempra Energy 28,64 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-64.768,55	-0,01
Sempra Energy 27,47 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-101.163,04	-0,01
Sempra Energy 27,31 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-50.912,71	0,00
Siemens Energy AG 36,80 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	262.385,60	0,02
Skyworks Solutions, Inc. 39,38 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-105.133,36	-0,01
Skyworks Solutions, Inc. 42,37 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-98.369,55	-0,01
Skyworks Solutions, Inc. 39,78 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-70.947,18	-0,01
Skyworks Solutions, Inc. 36,90 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-33.321,41	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 39,34 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-93.458,66	-0,01
Skyworks Solutions, Inc. 44,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-71.706,48	-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 VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Societe Generale S.A. 41,02 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-104.702,65	-0,01
Societe Generale S.A. 37,28 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-42.179,56	0,00
Societe Generale S.A. 42,55 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-136.545,01	-0,01
Societe Generale S.A. 37,58 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-52.623,24	0,00
Societe Generale S.A. 43,91 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-104.211,90	-0,01
Societe Generale S.A. 38,81 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-58.616,15	-0,01
Sony Group Corp. 30,32 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-92.541,38	-0,01
Sony Group Corp. 31,30 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-54.040,01	0,00
Sony Group Corp. 30,85 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-43.438,39	0,00
Sony Group Corp. 33,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-96.184,50	-0,01
Sony Group Corp. 31,66 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-79.142,44	-0,01
Sony Group Corp. 33,97 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-121.704,80	-0,01
Sony Group Corp. 31,51 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-94.282,27	-0,01
Sony Group Corp. 32,60 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-56.060,68	0,00
Sony Group Corp. 29,54 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-76.817,07	-0,01
Sony Group Corp. 29,05 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-25.217,18	0,00
Sony Group Corp. 33,52 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-139.334,97	-0,01
Southwest Airlines Co. 42,33 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-201.344,49	-0,02
Starbucks Corp. 30,46 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-86.873,44	-0,01
Starbucks Corp. 31,28 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-83.913,11	-0,01
Starbucks Corp. 30,83 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-59.619,28	-0,01
Starbucks Corp. 33,20 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-109.424,90	-0,01
Starbucks Corp. 31,59 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-70.027,15	-0,01
State Street Corp. 41,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-77.158,86	-0,01
State Street Corp. 35,34 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-38.353,18	0,00
Stellantis NV 33,89 %	20.06.2024	2.000.000	EUR	-94.904,92	-0,01
Stellantis NV 34,78 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-70.750,88	-0,01
Stellantis NV 33,80 %	20.06.2024	1.250.000	EUR	-62.026,32	-0,01
Swiss Life Holding AG 27,80 %	15.12.2023	1.190.600	CHF	-74.994,91	-0,01
Swiss Life Holding AG 24,20 %	21.06.2024	1.984.000	CHF	-21.032,39	0,00
Swiss Life Holding AG 24,30 %	21.06.2024	798.500	CHF	-19.128,97	0,00
Swiss Life Holding AG 29,67 %	15.12.2023	1.491.000	CHF	-122.594,53	-0,01
Swiss Life Holding AG 24,11 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	-19.482,91	0,00
Swiss Life Holding AG 28,25 %	15.12.2023	1.478.000	CHF	-99.968,75	-0,01
Swiss Life Holding AG 27,14 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-72.279,50	-0,01
Swiss Life Holding AG 28,96 %	15.12.2023	984.000	CHF	-74.559,82	-0,01
Swiss Life Holding AG 23,41 %	15.12.2023	1.976.000	CHF	-17.424,51	0,00
Swiss Life Holding AG 26,73 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-47.486,18	0,00
Swiss Life Holding AG 26,00 %	21.06.2024	2.467.500	CHF	-72.158,47	-0,01
Swiss Re AG 27,91 %	15.12.2023	1.552.500	CHF	-89.126,97	-0,01
Swiss Re AG 27,00 %	21.06.2024	798.500	CHF	-37.377,40	0,00
Swiss Re AG 28,42 %	15.12.2023	1.478.000	CHF	-102.443,39	-0,01
Swiss Re AG 28,57 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-131.412,59	-0,01
Swiss Re AG 25,94 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-45.423,59	0,00
Swiss Re AG 30,87 %	15.12.2023	2.034.400	CHF	-191.945,22	-0,02
Swiss Re AG 27,65 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-71.866,69	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 36,91 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-101.295,20	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 37,98 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-141.546,70	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 37,98 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-69.663,96	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 34,63 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-44.176,12	0,00
Take-Two Interactive Software, Inc. 38,72 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-80.182,73	-0,01
Take-Two Interactive Software, Inc. 34,91 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-75.971,96	-0,01
Telefonica S.A. 25,21 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-72.346,46	-0,01
Telefonica S.A. 28,95 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-82.750,28	-0,01
Texas Instruments, Inc. 33,58 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-82.136,30	-0,01
TJX Cos., Inc./The 30,08 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-151.372,54	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,08 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-10.602,08	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,00 %	17.01.2025	3.000.000	USD	-11.382,56	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,73 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-23.795,98	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,41 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-109.651,39	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
T-Mobile US, Inc. 29,04 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-27.109,34	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,49 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-48.954,59	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,76 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-216.423,53	-0,02
T-Mobile US, Inc. 34,30 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-91.130,65	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,14 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-65.959,46	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-132.542,12	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,42 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-82.046,08	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,85 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-18.959,08	0,00
T-Mobile US, Inc. 30,17 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-151.690,56	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,58 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-104.566,14	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,79 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-53.802,42	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,41 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-26.953,04	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-78.433,74	-0,01
T-Mobile US, Inc. 26,72 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-5.222,82	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-130.747,57	-0,01
T-Mobile US, Inc. 26,47 %	17.01.2025	2.000.000	USD	2.528,30	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,95 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-49.225,17	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,76 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-27.438,48	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,64 %	21.06.2024	1.600.000	USD	-23.962,64	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,15 %	19.01.2024	3.000.000	USD	-156.005,28	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,40 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-9.463,62	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,49 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-129.269,46	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-85.962,76	-0,01
T-Mobile US, Inc. 31,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-91.582,40	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,14 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-56.616,64	0,00
T-Mobile US, Inc. 35,50 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-122.444,80	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,76 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-141.086,32	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,62 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-31.643,73	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,21 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-46.218,46	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,09 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-110.170,02	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,64 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-170.103,21	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,60 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-30.188,54	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-98.807,52	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,30 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-35.117,05	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,06 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-27.406,55	0,00
T-Mobile US, Inc. 31,55 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-109.571,44	-0,01
T-Mobile US, Inc. 26,93 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-12.588,64	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,21 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-118.060,52	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,98 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-58.036,56	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,30 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-118.143,10	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,94 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-30.659,84	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,58 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-25.645,52	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,29 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-41.650,55	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,57 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-38.242,59	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.040,75	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,92 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-135.692,45	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,10 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-28.289,24	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,99 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-44.166,40	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,23 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-169.972,01	-0,01
T-Mobile US, Inc. 28,30 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-28.242,35	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-106.421,97	-0,01
T-Mobile US, Inc. 26,98 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-19.445,04	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,93 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-133.892,92	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,66 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-22.193,63	0,00
T-Mobile US, Inc. 27,55 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-17.841,21	0,00
T-Mobile US, Inc. 31,44 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-149.570,36	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-150.964,68	-0,01
Toll Brothers Finance Corp. 37,45 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-70.377,44	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 31,75 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-72.349,76	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 32,16 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-74.025,47	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Travelers Cos., Inc./The 30,06 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-74.129,48	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 31,41 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-101.662,99	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 23,60 %	19.01.2024	2.500.000	USD	9.676,40	0,00
Travelers Cos., Inc./The 31,34 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-86.968,06	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 30,21 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-70.231,75	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 28,78 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-125.509,41	-0,01
Tyson Foods, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-26.260,71	0,00
Tyson Foods, Inc. 32,40 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-32.185,52	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,70 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-5.873,64	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,42 %	17.01.2025	1.500.000	USD	41.745,56	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,33 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-15.461,69	0,00
Tyson Foods, Inc. 28,20 %	19.01.2024	2.500.000	USD	24.222,96	0,00
Tyson Foods, Inc. 34,69 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-44.942,74	0,00
Tyson Foods, Inc. 30,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-8.967,39	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	2.467,99	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-467,83	0,00
Tyson Foods, Inc. 28,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	14.360,25	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,28 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-32.507,26	0,00
Tyson Foods, Inc. 33,05 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-35.045,12	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-30.445,42	0,00
U.S. Bancorp 30,20 %	19.01.2024	2.000.000	USD	227.051,57	0,02
U.S. Bancorp 31,71 %	19.01.2024	1.000.000	USD	66.785,18	0,01
U.S. Bancorp 30,97 %	19.01.2024	1.200.000	USD	85.401,28	0,01
U.S. Bancorp 33,00 %	19.01.2024	1.000.000	USD	53.551,91	0,00
U.S. Bancorp 32,41 %	19.01.2024	1.600.000	USD	115.047,78	0,01
U.S. Bancorp 30,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	122.072,36	0,01
U.S. Bancorp 30,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	185.479,93	0,02
UBS Group AG 31,46 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	23.478,30	0,00
UBS Group AG 32,27 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	3.701,59	0,00
UniCredit SpA 41,22 %	20.06.2024	1.250.000	EUR	-50.791,35	0,00
Union Pacific Corp. 33,24 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-139.710,27	-0,01
Union Pacific Corp. 30,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-71.834,72	-0,01
Union Pacific Corp. 30,43 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-84.648,62	-0,01
Union Pacific Corp. 29,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-78.317,96	-0,01
Union Pacific Corp. 30,09 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-102.131,15	-0,01
Union Pacific Corp. 30,36 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-64.649,56	-0,01
Union Pacific Corp. 28,87 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-63.299,26	-0,01
United Rentals, Inc. 43,16 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-65.676,72	-0,01
United Rentals, Inc. 37,62 %	21.06.2024	1.300.000	USD	24.366,66	0,00
United Rentals, Inc. 37,59 %	21.06.2024	1.500.000	USD	32.449,15	0,00
United Rentals, Inc. 40,34 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-826,53	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 26,14 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-11.639,48	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-73.365,72	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 32,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-77.386,18	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 29,08 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-77.786,31	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 26,55 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-52.479,56	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 26,45 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-15.242,75	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 28,11 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-37.476,28	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 32,62 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-210.708,62	-0,02
UnitedHealth Group, Inc. 30,68 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-149.594,06	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 30,76 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-155.492,25	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,87 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-154.639,69	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 29,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-73.172,38	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 27,48 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-22.349,22	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,30 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-108.953,57	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 27,37 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-48.385,34	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 25,87 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-25.285,49	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 32,29 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-89.958,75	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,16 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-100.679,93	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-103.509,58	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
UnitedHealth Group, Inc. 25,95 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-10.463,72	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,01 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-88.337,21	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-105.323,71	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 27,18 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-44.873,05	0,00
Vale S.A. 37,22 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-1.143,25	0,00
Vale S.A. 42,45 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-63.450,75	-0,01
Vale S.A. 41,16 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-48.674,56	0,00
Vale S.A. 39,06 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-14.437,52	0,00
Vale S.A. 42,85 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-96.124,33	-0,01
Vale S.A. 39,21 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-36.821,94	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 33,05 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-102.114,36	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 31,01 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-122.946,77	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 32,42 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-50.288,56	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 37,32 %	21.06.2024	3.000.000	USD	-217.903,66	-0,02
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 32,59 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-52.874,22	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 35,34 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-71.755,87	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 34,32 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-126.338,88	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 38,80 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-152.191,18	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 30,64 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-30.924,07	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 31,61 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-58.847,10	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 34,12 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-207.035,84	-0,02
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 34,08 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-71.206,68	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 33,80 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-56.898,10	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 33,28 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-61.589,33	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 31,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-103.729,45	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 37,84 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-171.686,45	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 30,89 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-32.130,83	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 35,69 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-120.898,50	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 32,33 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-39.060,81	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 36,80 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-139.904,46	-0,01
Vinci S.A. 25,81 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-80.730,88	-0,01
Vinci S.A. 31,68 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-214.823,06	-0,02
Vinci S.A. 30,79 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-113.145,70	-0,01
Vinci S.A. 27,50 %	21.06.2024	2.500.000	EUR	-143.980,90	-0,01
Vinci S.A. 31,43 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-118.048,98	-0,01
Vinci S.A. 30,40 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-141.852,85	-0,01
Vinci S.A. 26,49 %	21.06.2024	1.250.000	EUR	-59.265,05	-0,01
Vinci S.A. 26,41 %	21.06.2024	800.000	EUR	-38.346,46	0,00
Vinci S.A. 32,90 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-159.300,96	-0,01
Vinci S.A. 31,16 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-174.062,37	-0,01
Vinci S.A. 30,56 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-131.253,54	-0,01
Vinci S.A. 30,28 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-202.471,04	-0,02
Vinci S.A. 26,02 %	21.06.2024	1.200.000	EUR	-51.832,31	0,00
Vinci S.A. 26,01 %	21.06.2024	1.800.000	EUR	-76.673,25	-0,01
Visa, Inc. 27,12 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-78.108,21	-0,01
Visa, Inc. 29,69 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-192.169,29	-0,02
Visa, Inc. 28,82 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-138.598,44	-0,01
Visa, Inc. 28,70 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-67.464,85	-0,01
Visa, Inc. 26,31 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-53.673,49	0,00
VMware, Inc. 39,21 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-47.451,47	0,00
VMware, Inc. 33,11 %	21.06.2024	2.000.000	USD	43.057,23	0,00
VMware, Inc. 32,59 %	21.06.2024	1.200.000	USD	26.921,60	0,00
Volkswagen AG 36,81 %	21.06.2024	2.000.000	EUR	-165.705,06	-0,01
Volkswagen AG 31,78 %	21.06.2024	1.500.000	EUR	-52.782,33	0,00
Walmart, Inc. 23,75 %	21.06.2024	1.000.000	USD	-50.153,38	0,00
Waste Management, Inc. 26,18 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-110.829,38	-0,01
Waste Management, Inc. 26,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-95.894,88	-0,01
Waste Management, Inc. 26,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-115.850,47	-0,01
Waste Management, Inc. 29,81 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-108.288,14	-0,01
Williams Cos., Inc./The 25,95 %	17.01.2025	1.500.000	USD	-6.499,72	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Williams Cos., Inc./The 30,96 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-74.434,02	-0,01
Williams Cos., Inc./The 29,60 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-132.216,85	-0,01
Williams Cos., Inc./The 29,24 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-61.882,81	-0,01
Williams Cos., Inc./The 26,85 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-20.633,96	0,00
Williams Cos., Inc./The 31,37 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-97.556,82	-0,01
Williams Cos., Inc./The 33,31 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-152.402,18	-0,01
Williams Cos., Inc./The 28,53 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-136.628,29	-0,01
Williams Cos., Inc./The 34,69 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-233.869,39	-0,02
Williams Cos., Inc./The 29,53 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-97.953,09	-0,01
Williams Cos., Inc./The 27,74 %	21.06.2024	1.300.000	USD	-38.424,20	0,00
Williams Cos., Inc./The 29,05 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-65.969,68	-0,01
Williams Cos., Inc./The 29,48 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-72.962,54	-0,01
Williams Cos., Inc./The 32,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-104.503,10	-0,01
Williams Cos., Inc./The 30,82 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-118.670,76	-0,01
Williams Cos., Inc./The 29,05 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-148.872,11	-0,01
Williams Cos., Inc./The 33,66 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-211.778,07	-0,02
Williams Cos., Inc./The 26,91 %	17.01.2025	1.300.000	USD	-18.469,53	0,00
Williams Cos., Inc./The 34,99 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-187.816,46	-0,02
Williams Cos., Inc./The 32,41 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-212.589,92	-0,02
Williams Cos., Inc./The 28,99 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-112.365,17	-0,01
Williams Cos., Inc./The 31,10 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-91.785,10	-0,01
Williams Cos., Inc./The 29,09 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-80.607,55	-0,01
Williams Cos., Inc./The 27,36 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-43.192,78	0,00
Williams Cos., Inc./The 28,22 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-94.986,25	-0,01
Williams Cos., Inc./The 28,77 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-63.481,75	-0,01
Williams Cos., Inc./The 27,55 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-45.340,01	0,00
Williams Cos., Inc./The 32,24 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-176.866,51	-0,02
Workday, Inc. 39,45 %	17.01.2025	2.200.000	USD	-102.410,73	-0,01
Workday, Inc. 36,95 %	17.01.2025	2.500.000	USD	-66.154,05	-0,01
Workday, Inc. 39,84 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-88.168,85	-0,01
Workday, Inc. 40,65 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-81.336,63	-0,01
Workday, Inc. 36,74 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-45.323,87	0,00
Workday, Inc. 37,60 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-53.064,14	0,00
Workday, Inc. 39,25 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-63.889,93	-0,01
Workday, Inc. 37,90 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-67.967,55	-0,01
Workday, Inc. 39,03 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-75.158,10	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 38,90 %	17.01.2025	1.750.000	USD	-74.642,51	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 37,57 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-61.918,65	-0,01
Yum! Brands, Inc. 29,74 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-195.912,99	-0,02
Yum! Brands, Inc. 30,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-138.607,87	-0,01
Yum! Brands, Inc. 22,54 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-55.594,56	0,00
Yum! Brands, Inc. 27,34 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-145.946,31	-0,01
Yum! Brands, Inc. 25,09 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-77.934,96	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,16 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-222.879,73	-0,02
Yum! Brands, Inc. 22,38 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-99.703,35	-0,01
Yum! Brands, Inc. 24,14 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-50.200,04	0,00
Yum! Brands, Inc. 25,64 %	21.06.2024	1.500.000	USD	-67.161,41	-0,01
Yum! Brands, Inc. 22,46 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-79.921,25	-0,01
Yum! Brands, Inc. 22,06 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-93.057,10	-0,01
Yum! Brands, Inc. 25,55 %	17.01.2025	2.000.000	USD	-43.553,86	0,00
Yum! Brands, Inc. 30,21 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-107.837,75	-0,01
Yum! Brands, Inc. 27,78 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-127.493,30	-0,01
Yum! Brands, Inc. 24,14 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-66.712,32	-0,01
Yum! Brands, Inc. 21,98 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-17.820,55	0,00
Yum! Brands, Inc. 31,82 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-146.767,83	-0,01
Yum! Brands, Inc. 22,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-62.867,34	-0,01
Yum! Brands, Inc. 25,82 %	21.06.2024	2.000.000	USD	-87.028,95	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,18 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-106.470,87	-0,01
Yum! Brands, Inc. 29,84 %	21.06.2024	2.500.000	USD	-205.323,39	-0,02
Yum! Brands, Inc. 24,73 %	21.06.2024	1.200.000	USD	-43.234,31	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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Yum! Brands, Inc. 31,78 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-147.999,08	-0,01
Yum! Brands, Inc. 28,13 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-118.607,85	-0,01
Zurich Insurance Group AG 23,14 %	21.06.2024	1.981.900	CHF	-97.883,26	-0,01
Zurich Insurance Group AG 22,71 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-53.898,94	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,70 %	21.06.2024	1.984.000	CHF	-87.762,75	-0,01
Zurich Insurance Group AG 22,30 %	21.06.2024	798.500	CHF	-38.643,49	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,40 %	21.06.2024	1.243.900	CHF	-62.269,58	-0,01
Zurich Insurance Group AG 26,43 %	15.12.2023	2.034.400	CHF	-192.326,69	-0,02
Zurich Insurance Group AG 22,79 %	21.06.2024	2.467.500	CHF	-114.416,03	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,69 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-95.264,25	-0,01
Zurich Insurance Group AG 23,74 %	15.12.2023	1.552.500	CHF	-87.592,36	-0,01
Zurich Insurance Group AG 25,10 %	15.12.2023	1.190.600	CHF	-101.316,77	-0,01
Zurich Insurance Group AG 23,39 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-90.497,23	-0,01
Zurich Insurance Group AG 22,06 %	15.12.2023	2.916.000	CHF	-142.288,72	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,79 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-139.894,38	-0,01
Zurich Insurance Group AG 21,46 %	15.12.2023	1.976.000	CHF	-84.690,61	-0,01
Zurich Insurance Group AG 27,94 %	15.12.2023	1.963.300	CHF	223.764,40	0,02
Summe Volatility Swaps				7.067.802,22	0,60
				7.067.802,22	0,60
Differenzkontrakte		Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland					
Allianz SE		19.251.607	EUR	-11.404,34	0,00
Bayerische Motoren Werke AG		-2.443.226	EUR	87.676,46	0,01
Mercedes-Benz Group AG		-2.659.652	EUR	-79.498,63	-0,01
				-3.226,51	0,00
Frankreich					
AXA S.A.		-1.618.017	EUR	83.417,83	0,01
BNP Paribas S.A.		-249.733	EUR	21.868,46	0,00
Credit Agricole S.A.		2.084.844	EUR	225.961,33	0,02
				331.247,62	0,03
Schweiz					
ABB Ltd.		-6.648.609	CHF	-15.837,61	0,00
Zurich Insurance Group AG		-6.750.665	CHF	-18.913,00	0,00
				-34.750,61	0,00
Vereinigte Staaten					
American Express Co.		-6.513.815	USD	150.590,34	0,01
Apple, Inc.		35.508.632	USD	-1.374.393,43	-0,12
Bank of America Corp.		13.248.926	USD	18.791,59	0,00
Citigroup, Inc.		-13.502.787	USD	-279.002,97	-0,02
Goldman Sachs Group, Inc.		-2.226.831	USD	25.467,37	0,00
JPMorgan Chase & Co.		42.907.517	USD	-899.938,78	-0,08
Starbucks Corp.		-5.439.333	USD	-71.534,81	-0,01
T-Mobile US Inc.		3.849.432	USD	-156.667,07	-0,01
				-2.586.687,76	-0,23
Summe Differenzkontrakte				-2.293.417,26	-0,20

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 2023 (FORTSETZUNG)**

Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder, Optionen, Volatility Swaps und Differenzkontrakte (Anschaffungskosten EUR 912.799.918,64)	944.669.609,99	80,06
Bankguthaben	237.227.415,48	20,11
Sonstige Vermögenswerte	127.331.334,87	10,79
Sonstige Verbindlichkeiten	-129.304.435,38	-10,96
Summe Nettoteilfondsvermögen	1.179.923.924,96	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 2023 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	366.282.874,80
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	341.194,55
Unrealisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	217.951,36
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	7.067.802,22
Tagesgelder (Erl. 2)	505.094.122,00
Optionen (Erl. 2)	68.518.228,23
Bankguthaben (Erl. 2) *	237.227.415,48
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	78.199.518,92
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	44.967.968,07
Zinsforderungen	3.185.620,84
Gebühren für Differenzkontrakte	419.041,15
Sonstige Forderungen	39,98
Summe Aktiva	1.311.521.777,60
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	113.435.710,56
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	14.177.101,97
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	2.293.417,26
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	725.432,86
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	117.132,14
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	41.746,57
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	28.683,44
Zinsverbindlichkeiten	326.462,50
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	230.910,13
Sonstige Verbindlichkeiten	221.255,21
Summe Passiva	131.597.852,64
Summe Nettoteilfondsvermögen	1.179.923.924,96

Anteilklassen	I	I2 CHF	I2 SPEZ	I2 USD**	I GBP	P	R
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	745.648,11	40.534,00	71.010,00	0,00	27.338,42	253.424,51	1.702.422,80
Zeichnungen	217.547,38	116.458,46	0,00	3.333,59	1.929,33	31.438,00	624.559,00
Rücknahmen	158.347,44	90.271,00	18.010,00	0,00	2.445,40	108.022,00	167.425,51
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	804.848,05	66.721,46	53.000,00	3.333,59	26.822,35	176.840,51	2.159.556,29

* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.

** Die Anteilklasse I2 USD wurde am 4. April 2023 neu aufgelegt.

Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichts.

ASSENAGON ALPHA VOLATILITY
AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS
FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2023 BIS ZUM 30. JUNI 2023 IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	1.057.115.589,14
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	1.688.141,22
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	6.471.807,05
Bankzinsen (Erl. 2) *	2.934.916,40
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.196.886,68
Summe Erträge	13.291.751,35
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	1.279.502,36
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	841.321,54
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	1.585.134,73
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	4.224.910,29
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	717.359,17
Performance Fee (Erl. 3)	230.909,21
Prüfungskosten	28.196,18
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	81.352,10
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	6.296.570,71
Transaktionskosten (Erl. 10)	273.723,17
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	636.379,32
Summe Aufwendungen	16.195.358,78
Nettogewinn/(-verlust)	-2.903.607,43
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	927.575.692,35
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-992.301.216,14
Realisierter Nettoverlust	-67.629.131,22
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	120.705.137,11
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	-21.959.635,77
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	31.116.370,12
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	401.650.426,82
Rücknahme von Anteilen	-309.958.461,12
Summe Nettofondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	1.179.923.924,96

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

Statistische Angaben

Teilfondsangaben in EUR

Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 30.06.2023	1.179.923.924,96
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 31.12.2022	1.057.115.589,14
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 31.12.2021	1.172.697.765,00

Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2023	31.12.2022	31.12.2021
I	1.120,53	1.096,96	1.035,41
I2 CHF	1.063,27	1.038,88	945,23
I2 SPEZ	976,10	951,80	891,32
I2 USD*	903,36	–	–
I GBP	1.211,14	1.140,13	1.117,83
P	51,13	50,24	47,79
R	51,33	50,26	47,45

Umlaufende Anteile zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2023	31.12.2022	31.12.2021
I	804.848,05	745.648,11	723.855,27
I2 CHF	66.721,46	40.534,00	170.948,28
I2 SPEZ	53.000,00	71.010,00	97.510,00
I2 USD*	3.333,59	–	–
I GBP	26.822,35	27.338,42	23.706,30
P	176.840,51	253.424,51	201.657,51
R	2.159.556,29	1.702.422,80	2.920.700,06

* Die Anteilklasse I2 USD wurde am 4. April 2023 neu aufgelegt.

Finanzaufstellung

ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
Deutschland					
DE0001141794	Bundesobligation 0 %, 05.04.2024	10.000.000	EUR	9.746.630,00	13,13
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	4.900.000	EUR	4.775.500,80	6,43
DE0001102333	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 15.02.2024	5.200.000	EUR	5.149.565,20	6,94
DE0001102325	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2 %, 15.08.2023	5.200.000	EUR	5.192.402,80	6,99
DE0001104867	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.12.2023	5.400.000	EUR	5.317.218,00	7,16
DE0001104883	Bundesschatzanweisungen 0,2 %, 14.06.2024	2.500.000	EUR	2.426.130,00	3,27
DE0001104909	Bundesschatzanweisungen 2,2 %, 12.12.2024	6.000.000	EUR	5.905.680,00	7,96
DE000BU22007	Bundesschatzanweisungen 2,5 %, 13.03.2025	7.500.000	EUR	7.407.562,50	9,98
				45.920.689,30	61,86
Summe Festverzinsliche Wertpapiere				45.920.689,30	61,86

Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind. 45.920.689,30 61,86

Tagesgelder					
Kontrahent	Zinssatz		Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutschland					
	Bayerische Landesbank 3,30 %, Tagesgeld		EUR	2.000.000,00	2,70
	DZ Bank AG 3,35 %, Tagesgeld		EUR	6.000.000,00	8,08
	DekaBank 3,33 %, Tagesgeld		EUR	6.000.000,00	8,08
	Landesbank Baden Württemberg 3,30 %, Tagesgeld		EUR	3.000.000,00	4,04
				17.000.000,00	22,90
Summe Tagesgelder				17.000.000,00	22,90

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ABB Ltd. 24,67 %	20.12.2024	550.000	CHF	-16.104,43	-0,02
Abbott Laboratories 25,18 %	19.01.2024	130.000	USD	-4.817,21	-0,01
Abbott Laboratories 24,79 %	19.01.2024	90.000	USD	-2.926,29	0,00
AbbVie, Inc. 25,73 %	19.01.2024	170.000	USD	-4.304,33	-0,01
AbbVie, Inc. 24,83 %	19.01.2024	130.000	USD	-1.998,31	0,00
Accenture PLC 30,13 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.063,80	-0,01
Accenture PLC 28,57 %	19.01.2024	120.000	USD	-4.149,43	-0,01
Adobe, Inc. 36,64 %	19.01.2024	80.000	USD	-1.818,75	0,00
Adobe, Inc. 38,62 %	15.09.2023	170.000	USD	-4.953,45	-0,01
Adobe, Inc. 34,76 %	19.01.2024	110.000	USD	-676,41	0,00
Adobe, Inc. 38,85 %	19.01.2024	190.000	USD	-8.626,90	-0,01
Adobe, Inc. 37,52 %	21.06.2024	190.000	USD	-8.141,95	-0,01
Adobe, Inc. 40,20 %	19.01.2024	190.000	USD	-10.790,31	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Adobe, Inc. 36,15 %	19.01.2024	180.000	USD	-4.428,75	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 52,73 %	19.01.2024	130.000	USD	-4.390,54	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 52,37 %	21.06.2024	160.000	USD	-9.080,90	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 54,65 %	19.01.2024	130.000	USD	-6.598,89	-0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 48,52 %	19.01.2024	150.000	USD	-856,12	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 49,30 %	15.09.2023	130.000	USD	-1.127,43	0,00
Alphabet, Inc. 33,31 %	19.01.2024	510.000	USD	-20.956,73	-0,03
Alphabet, Inc. 33,19 %	19.01.2024	500.000	USD	-19.565,82	-0,03
Alphabet, Inc. 35,45 %	15.09.2023	460.000	USD	-28.556,17	-0,04
Alphabet, Inc. 37,17 %	19.01.2024	510.000	USD	-25.996,06	-0,03
Alphabet, Inc. 36,31 %	19.01.2024	500.000	USD	-21.418,35	-0,03
Alphabet, Inc. 32,45 %	17.01.2025	590.000	USD	-11.720,49	-0,02
Alphabet, Inc. 32,12 %	19.01.2024	390.000	USD	-3.547,03	0,00
Alphabet, Inc. 32,12 %	19.01.2024	350.000	USD	-3.483,95	0,00
Alphabet, Inc. 32,90 %	17.01.2025	510.000	USD	-11.852,74	-0,02
Alphabet, Inc. 35,58 %	15.09.2023	460.000	USD	-28.916,01	-0,04
Alphabet, Inc. 34,89 %	19.01.2024	240.000	USD	-13.830,82	-0,02
Alphabet, Inc. 37,26 %	19.01.2024	510.000	USD	-27.096,52	-0,04
Alphabet, Inc. 34,77 %	19.01.2024	270.000	USD	-15.094,71	-0,02
Alphabet, Inc. 31,80 %	21.06.2024	480.000	USD	-10.026,75	-0,01
Alphabet, Inc. 31,97 %	21.06.2024	470.000	USD	-10.229,23	-0,01
Alphabet, Inc. 36,99 %	19.01.2024	510.000	USD	-25.684,91	-0,03
Amazon.com, Inc. 38,40 %	19.01.2024	590.000	USD	-22.469,94	-0,03
Amazon.com, Inc. 36,14 %	17.01.2025	900.000	USD	-19.061,60	-0,03
Amazon.com, Inc. 38,83 %	19.01.2024	830.000	USD	-45.583,22	-0,06
Amazon.com, Inc. 43,34 %	19.01.2024	840.000	USD	-66.151,88	-0,09
Amazon.com, Inc. 43,97 %	19.01.2024	810.000	USD	-67.721,06	-0,09
Amazon.com, Inc. 39,60 %	19.01.2024	420.000	USD	-27.086,08	-0,04
Amazon.com, Inc. 40,37 %	15.09.2023	810.000	USD	-58.575,16	-0,08
Amazon.com, Inc. 36,97 %	21.06.2024	820.000	USD	-26.004,49	-0,04
American Electric Power Co., Inc. 26,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-2.567,84	0,00
American Electric Power Co., Inc. 24,40 %	19.01.2024	60.000	USD	-1.796,84	0,00
Amgen, Inc. 25,37 %	21.06.2024	100.000	USD	-790,94	0,00
Amgen, Inc. 23,38 %	19.01.2024	140.000	USD	-2.379,29	0,00
Amgen, Inc. 24,35 %	19.01.2024	180.000	USD	-5.126,80	-0,01
Amgen, Inc. 27,31 %	19.01.2024	170.000	USD	-9.009,39	-0,01
Amgen, Inc. 25,26 %	15.09.2023	140.000	USD	-5.917,24	-0,01
Analog Devices, Inc. 31,98 %	15.09.2023	100.000	USD	-4.858,09	-0,01
Analog Devices, Inc. 31,16 %	19.01.2024	110.000	USD	-3.630,67	0,00
Analog Devices, Inc. 33,71 %	19.01.2024	100.000	USD	-5.494,36	-0,01
Analog Devices, Inc. 35,19 %	19.01.2024	100.000	USD	-6.490,79	-0,01
Analog Devices, Inc. 31,42 %	21.06.2024	80.000	USD	-2.145,96	0,00
Apple, Inc. 29,80 %	19.01.2024	1.710.000	USD	-125.386,77	-0,17
Apple, Inc. 29,33 %	19.01.2024	1.450.000	USD	-90.825,22	-0,12
Apple, Inc. 30,76 %	19.01.2024	1.100.000	USD	-88.194,03	-0,12
Apple, Inc. 36,93 %	19.01.2024	1.570.000	USD	-203.001,32	-0,27
Apple, Inc. 31,33 %	15.09.2023	1.580.000	USD	-154.510,75	-0,21
Apple, Inc. 27,39 %	17.01.2025	2.180.000	USD	-36.677,87	-0,05
Apple, Inc. 26,32 %	21.06.2024	1.510.000	USD	-26.329,44	-0,04
Apple, Inc. 34,25 %	19.01.2024	1.560.000	USD	-166.511,55	-0,22
Applied Materials, Inc. 41,47 %	19.01.2024	120.000	USD	-7.304,73	-0,01
Applied Materials, Inc. 40,77 %	21.06.2024	100.000	USD	-3.321,78	0,00
Applied Materials, Inc. 42,43 %	15.09.2023	100.000	USD	-8.575,24	-0,01
ASML Holding NV 47,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-7.768,37	-0,01
ASML Holding NV 40,21 %	15.09.2023	60.000	USD	-5.240,79	-0,01
ASML Holding NV 45,70 %	19.01.2024	70.000	USD	-8.688,00	-0,01
AT&T, Inc. 26,22 %	19.01.2024	70.000	USD	873,75	0,00
AT&T, Inc. 24,18 %	19.01.2024	100.000	USD	2.570,70	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 25,94 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.192,18	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 28,14 %	15.09.2023	100.000	USD	-7.354,16	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Automatic Data Processing, Inc. 24,62 %	21.06.2024	80.000	USD	-1.410,49	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 28,47 %	19.01.2024	120.000	USD	-7.738,09	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 27,35 %	19.01.2024	120.000	USD	-6.659,89	-0,01
Bank of America Corp. 29,52 %	19.01.2024	120.000	USD	-494,30	0,00
Bank of America Corp. 27,96 %	19.01.2024	170.000	USD	657,73	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 21,25 %	19.01.2024	270.000	USD	-13.105,41	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 19,73 %	19.01.2024	380.000	USD	-13.305,65	-0,02
Berkshire Hathaway, Inc. 19,33 %	17.01.2025	480.000	USD	-6.563,35	-0,01
Booking Holdings, Inc. 33,22 %	21.06.2024	80.000	USD	-2.891,72	0,00
Booking Holdings, Inc. 33,18 %	19.01.2024	110.000	USD	-6.837,64	-0,01
Booking Holdings, Inc. 38,86 %	19.01.2024	100.000	USD	-11.523,42	-0,02
Booking Holdings, Inc. 36,89 %	15.09.2023	100.000	USD	-10.716,53	-0,01
Booking Holdings, Inc. 42,00 %	19.01.2024	100.000	USD	-14.163,48	-0,02
Bristol-Myers Squibb Co. 22,52 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.694,38	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 23,90 %	19.01.2024	70.000	USD	-2.922,97	0,00
Broadcom, Inc. 36,12 %	19.01.2024	280.000	USD	-10.302,09	-0,01
Broadcom, Inc. 37,92 %	21.06.2024	300.000	USD	-15.217,43	-0,02
Broadcom, Inc. 35,10 %	19.01.2024	280.000	USD	-8.588,65	-0,01
Broadcom, Inc. 32,03 %	19.01.2024	160.000	USD	139,11	0,00
Broadcom, Inc. 33,56 %	19.01.2024	120.000	USD	-998,00	0,00
Broadcom, Inc. 31,15 %	19.01.2024	290.000	USD	3.805,89	0,01
Broadcom, Inc. 33,39 %	15.09.2023	250.000	USD	154,11	0,00
Charter Communications Operating LLC 44,50 %	19.01.2024	60.000	USD	-6.099,81	-0,01
Charter Communications Operating LLC 40,81 %	19.01.2024	70.000	USD	-4.849,66	-0,01
Charter Communications Operating LLC 37,31 %	15.09.2023	60.000	USD	-2.236,81	0,00
Chevron Corp. 28,26 %	19.01.2024	220.000	USD	-8.362,29	-0,01
Chevron Corp. 30,34 %	19.01.2024	140.000	USD	-8.117,25	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 33,99 %	20.12.2024	740.000	CHF	-21.370,28	-0,03
Cisco Systems, Inc. 25,97 %	19.01.2024	130.000	USD	-5.279,88	-0,01
Cisco Systems, Inc. 26,48 %	19.01.2024	100.000	USD	-5.150,98	-0,01
Cisco Systems, Inc. 27,09 %	15.09.2023	220.000	USD	-14.594,96	-0,02
Cisco Systems, Inc. 29,02 %	19.01.2024	240.000	USD	-16.355,22	-0,02
Cisco Systems, Inc. 28,56 %	19.01.2024	240.000	USD	-15.553,75	-0,02
Cisco Systems, Inc. 25,44 %	19.01.2024	230.000	USD	-9.223,52	-0,01
Cisco Systems, Inc. 24,12 %	21.06.2024	180.000	USD	-2.048,67	0,00
Coca-Cola Co./The 19,34 %	19.01.2024	160.000	USD	-8.408,93	-0,01
Coca-Cola Co./The 19,05 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.641,36	-0,01
Comcast Corp. 29,04 %	19.01.2024	80.000	USD	-3.187,74	0,00
Comcast Corp. 35,13 %	19.01.2024	200.000	USD	-18.241,33	-0,02
Comcast Corp. 34,55 %	19.01.2024	180.000	USD	-15.340,50	-0,02
Comcast Corp. 28,35 %	19.01.2024	120.000	USD	-3.725,69	0,00
Comcast Corp. 30,43 %	15.09.2023	180.000	USD	-9.762,63	-0,01
Comcast Corp. 29,16 %	19.01.2024	180.000	USD	-7.051,95	-0,01
Comcast Corp. 27,60 %	21.06.2024	140.000	USD	-2.505,92	0,00
ConocoPhillips 36,63 %	19.01.2024	100.000	USD	-4.078,91	-0,01
Costco Wholesale Corp. 25,25 %	19.01.2024	150.000	USD	-7.948,97	-0,01
Costco Wholesale Corp. 27,05 %	15.09.2023	240.000	USD	-20.371,58	-0,03
Costco Wholesale Corp. 30,11 %	19.01.2024	250.000	USD	-21.123,54	-0,03
Costco Wholesale Corp. 24,87 %	19.01.2024	240.000	USD	-12.026,59	-0,02
Costco Wholesale Corp. 28,71 %	19.01.2024	260.000	USD	-21.403,77	-0,03
Costco Wholesale Corp. 26,69 %	19.01.2024	110.000	USD	-7.283,94	-0,01
Costco Wholesale Corp. 22,77 %	21.06.2024	190.000	USD	-2.665,88	0,00
CSX Corp. 31,48 %	19.01.2024	80.000	USD	-6.203,02	-0,01
CSX Corp. 30,45 %	15.09.2023	70.000	USD	-5.967,43	-0,01
CSX Corp. 31,06 %	19.01.2024	80.000	USD	-6.077,59	-0,01
Danaher Corp. 30,58 %	19.01.2024	80.000	USD	-3.918,51	-0,01
Danaher Corp. 27,61 %	19.01.2024	120.000	USD	-2.902,37	0,00
Eli Lilly and Co. 31,90 %	19.01.2024	120.000	USD	-8.025,19	-0,01
Eli Lilly and Co. 31,42 %	19.01.2024	180.000	USD	-10.925,85	-0,01
Exxon Mobil Corp. 29,30 %	19.01.2024	330.000	USD	-7.545,40	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Exxon Mobil Corp. 30,65 %	19.01.2024	220.000	USD	-8.485,84	-0,01
Fiserv, Inc. 26,97 %	15.09.2023	80.000	USD	-3.196,62	0,00
Fiserv, Inc. 30,25 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.780,71	-0,01
Fiserv, Inc. 26,44 %	19.01.2024	80.000	USD	-2.623,43	0,00
Fiserv, Inc. 32,00 %	19.01.2024	80.000	USD	-5.939,40	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 29,97 %	19.01.2024	130.000	USD	-8.855,70	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 27,77 %	21.06.2024	80.000	USD	-1.387,22	0,00
Gilead Sciences, Inc. 27,44 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.387,08	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 27,90 %	15.09.2023	110.000	USD	-7.357,74	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 28,77 %	19.01.2024	130.000	USD	-7.874,01	-0,01
Holcim Ltd. 24,75 %	20.12.2024	300.000	CHF	-8.570,93	-0,01
Home Depot, Inc./The 29,44 %	19.01.2024	160.000	USD	-9.956,08	-0,01
Home Depot, Inc./The 27,81 %	19.01.2024	220.000	USD	-7.406,11	-0,01
Honeywell International, Inc. 23,37 %	21.06.2024	110.000	USD	-1.719,59	0,00
Honeywell International, Inc. 24,45 %	19.01.2024	90.000	USD	-4.025,57	-0,01
Honeywell International, Inc. 25,35 %	15.09.2023	140.000	USD	-8.651,38	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,15 %	19.01.2024	170.000	USD	-11.132,89	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,22 %	19.01.2024	180.000	USD	-13.016,96	-0,02
Honeywell International, Inc. 25,12 %	19.01.2024	70.000	USD	-3.630,49	0,00
Honeywell International, Inc. 24,27 %	19.01.2024	150.000	USD	-6.334,15	-0,01
Intel Corp. 40,87 %	21.06.2024	120.000	USD	-4.682,84	-0,01
Intel Corp. 38,02 %	15.09.2023	110.000	USD	1.724,73	0,00
Intel Corp. 37,99 %	19.01.2024	120.000	USD	928,13	0,00
Intel Corp. 41,36 %	19.01.2024	130.000	USD	-2.831,67	0,00
Intel Corp. 39,65 %	19.01.2024	150.000	USD	-1.064,75	0,00
Intuit, Inc. 41,06 %	15.09.2023	120.000	USD	-10.176,95	-0,01
Intuit, Inc. 43,69 %	19.01.2024	130.000	USD	-12.439,34	-0,02
Intuit, Inc. 42,34 %	19.01.2024	140.000	USD	-11.974,15	-0,02
Intuit, Inc. 37,02 %	21.06.2024	110.000	USD	-5.882,97	-0,01
Intuit, Inc. 38,10 %	19.01.2024	130.000	USD	-6.924,31	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 36,11 %	15.09.2023	90.000	USD	-6.450,16	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 34,26 %	19.01.2024	90.000	USD	-4.468,83	-0,01
Intuitive Surgical, Inc. 33,42 %	21.06.2024	100.000	USD	-2.709,24	0,00
Johnson & Johnson 18,09 %	19.01.2024	300.000	USD	-6.061,67	-0,01
Johnson & Johnson 19,90 %	19.01.2024	200.000	USD	-8.199,97	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 25,87 %	19.01.2024	280.000	USD	-2.911,96	0,00
JPMorgan Chase & Co. 27,81 %	19.01.2024	200.000	USD	-4.661,95	-0,01
Keurig Dr Pepper, Inc. 21,72 %	15.09.2023	50.000	USD	-2.201,32	0,00
Keurig Dr Pepper, Inc. 23,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-3.266,55	0,00
Keurig Dr Pepper, Inc. 23,79 %	19.01.2024	60.000	USD	-3.770,65	-0,01
KLA Corp. 46,00 %	19.01.2024	70.000	USD	-6.315,98	-0,01
KLA Corp. 39,77 %	15.09.2023	60.000	USD	-2.482,20	0,00
KLA Corp. 42,65 %	19.01.2024	70.000	USD	-4.489,23	-0,01
Kraft Heinz Co./The 29,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-5.653,92	-0,01
Kraft Heinz Co./The 25,62 %	19.01.2024	60.000	USD	-3.925,62	-0,01
Lam Research Corp. 42,82 %	21.06.2024	70.000	USD	-3.024,00	0,00
Lam Research Corp. 50,63 %	19.01.2024	70.000	USD	-8.208,61	-0,01
Lam Research Corp. 43,51 %	15.09.2023	70.000	USD	-4.568,84	-0,01
Lam Research Corp. 49,09 %	19.01.2024	80.000	USD	-8.533,23	-0,01
Linde PLC 25,96 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.114,67	-0,01
Linde PLC 26,89 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.653,98	-0,01
Lonza Group AG 29,36 %	20.12.2024	390.000	CHF	-9.138,40	-0,01
Marriott International, Inc. 31,82 %	15.09.2023	60.000	USD	-3.000,04	0,00
Marriott International, Inc. 35,68 %	19.01.2024	60.000	USD	-4.839,34	-0,01
Marriott International, Inc. 38,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-6.094,60	-0,01
McDonald's Corp. 20,93 %	19.01.2024	100.000	USD	-5.480,47	-0,01
McDonald's Corp. 21,32 %	19.01.2024	140.000	USD	-8.057,90	-0,01
MercadoLibre, Inc. 53,38 %	15.09.2023	60.000	USD	-7.699,23	-0,01
Merck & Co., Inc. 24,45 %	19.01.2024	180.000	USD	-5.601,72	-0,01
Merck & Co., Inc. 24,59 %	19.01.2024	130.000	USD	-4.413,88	-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 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Meta Platforms, Inc. 43,72 %	21.06.2024	520.000	USD	-11.984,01	-0,02
Meta Platforms, Inc. 54,51 %	19.01.2024	330.000	USD	-32.028,56	-0,04
Meta Platforms, Inc. 45,53 %	19.01.2024	190.000	USD	-11.153,99	-0,01
Meta Platforms, Inc. 46,27 %	15.09.2023	410.000	USD	-29.094,43	-0,04
Meta Platforms, Inc. 42,05 %	17.01.2025	480.000	USD	-3.347,46	0,00
Meta Platforms, Inc. 53,42 %	19.01.2024	350.000	USD	-29.877,98	-0,04
Meta Platforms, Inc. 46,03 %	19.01.2024	220.000	USD	-3.548,92	0,00
Meta Platforms, Inc. 45,10 %	19.01.2024	470.000	USD	-25.112,10	-0,03
Micron Technology, Inc. 43,35 %	15.09.2023	70.000	USD	-3.293,81	0,00
Micron Technology, Inc. 47,10 %	19.01.2024	70.000	USD	-4.551,63	-0,01
Micron Technology, Inc. 44,57 %	19.01.2024	70.000	USD	-3.290,39	0,00
Microsoft Corp. 29,71 %	19.01.2024	1.660.000	USD	-47.997,25	-0,06
Microsoft Corp. 32,49 %	19.01.2024	1.580.000	USD	-73.640,63	-0,10
Microsoft Corp. 33,53 %	19.01.2024	1.680.000	USD	-88.883,84	-0,12
Microsoft Corp. 28,92 %	17.01.2025	1.970.000	USD	-36.473,13	-0,05
Microsoft Corp. 31,33 %	15.09.2023	1.550.000	USD	-68.980,91	-0,09
Microsoft Corp. 27,40 %	19.01.2024	1.240.000	USD	-3.064,83	0,00
Microsoft Corp. 29,57 %	21.06.2024	1.620.000	USD	-49.083,15	-0,07
Microsoft Corp. 31,07 %	19.01.2024	930.000	USD	-39.838,57	-0,05
Moderna, Inc. 59,55 %	19.01.2024	90.000	USD	-11.056,03	-0,01
Moderna, Inc. 54,84 %	15.09.2023	70.000	USD	-7.405,77	-0,01
Moderna, Inc. 64,50 %	19.01.2024	80.000	USD	-13.398,71	-0,02
Mondelez International, Inc. 23,71 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.818,97	-0,01
Mondelez International, Inc. 22,99 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.233,49	-0,01
Mondelez International, Inc. 20,40 %	15.09.2023	100.000	USD	-3.448,74	0,00
Mondelez International, Inc. 20,92 %	19.01.2024	100.000	USD	-3.015,10	0,00
Mondelez International, Inc. 20,97 %	21.06.2024	80.000	USD	-429,15	0,00
Monster Beverage Corp. 29,62 %	19.01.2024	60.000	USD	-4.313,57	-0,01
Monster Beverage Corp. 31,28 %	19.01.2024	60.000	USD	-5.184,72	-0,01
Monster Beverage Corp. 27,86 %	15.09.2023	60.000	USD	-3.864,67	-0,01
NASDAQ 100 Index 27,68 %	19.01.2024	15.000.000	USD	911.762,70	1,23
NASDAQ 100 Index 28,89 %	19.01.2024	15.000.000	USD	1.061.361,64	1,43
NASDAQ 100 Index 24,85 %	19.01.2024	15.000.000	USD	648.154,54	0,87
NASDAQ 100 Index 23,90 %	21.06.2024	15.000.000	USD	294.790,29	0,40
NASDAQ 100 Index 26,00 %	15.09.2023	15.000.000	USD	993.789,60	1,34
Nestle S.A. 17,92 %	20.12.2024	1.930.000	CHF	-51.580,40	-0,07
Netflix, Inc. 57,13 %	19.01.2024	160.000	USD	-25.674,41	-0,03
Netflix, Inc. 44,97 %	21.06.2024	160.000	USD	-7.734,99	-0,01
Netflix, Inc. 46,54 %	15.09.2023	160.000	USD	-13.275,84	-0,02
Netflix, Inc. 55,23 %	19.01.2024	170.000	USD	-24.631,26	-0,03
Netflix, Inc. 45,69 %	19.01.2024	70.000	USD	-4.256,75	-0,01
Netflix, Inc. 46,13 %	19.01.2024	160.000	USD	-9.767,33	-0,01
Netflix, Inc. 43,74 %	19.01.2024	110.000	USD	-5.180,27	-0,01
NextEra Energy, Inc. 26,58 %	19.01.2024	100.000	USD	-4.006,17	-0,01
NextEra Energy, Inc. 27,55 %	19.01.2024	70.000	USD	-3.522,11	0,00
NIKE, Inc. 34,06 %	19.01.2024	80.000	USD	-3.235,34	0,00
NIKE, Inc. 32,63 %	19.01.2024	110.000	USD	-3.373,23	0,00
Novartis AG 19,26 %	20.12.2024	1.850.000	CHF	-39.801,28	-0,05
NVIDIA Corp. 54,92 %	21.06.2024	880.000	USD	-69.457,93	-0,09
NVIDIA Corp. 57,81 %	19.01.2024	440.000	USD	-24.282,18	-0,03
NVIDIA Corp. 51,37 %	19.01.2024	650.000	USD	-12.288,42	-0,02
NVIDIA Corp. 50,50 %	17.01.2025	770.000	USD	-30.030,81	-0,04
NVIDIA Corp. 53,37 %	19.01.2024	260.000	USD	-6.815,32	-0,01
NVIDIA Corp. 52,45 %	15.09.2023	550.000	USD	-8.753,77	-0,01
NVIDIA Corp. 50,36 %	19.01.2024	330.000	USD	2.228,81	0,00
NVIDIA Corp. 55,39 %	19.01.2024	470.000	USD	-16.353,81	-0,02
Oracle Corp. 29,89 %	19.01.2024	60.000	USD	-2.202,11	0,00
Palo Alto Networks 36,89 %	15.09.2023	60.000	USD	-1.996,17	0,00
PayPal Holdings, Inc. 48,72 %	19.01.2024	110.000	USD	-9.852,84	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 43,62 %	21.06.2024	60.000	USD	-2.078,77	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 PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
PayPal Holdings, Inc. 41,23 %	19.01.2024	100.000	USD	-1.564,97	0,00
PayPal Holdings, Inc. 50,80 %	19.01.2024	100.000	USD	-10.883,52	-0,01
PayPal Holdings, Inc. 44,39 %	15.09.2023	90.000	USD	-4.891,35	-0,01
PepsiCo, Inc. 20,62 %	15.09.2023	260.000	USD	-16.087,44	-0,02
PepsiCo, Inc. 20,03 %	19.01.2024	160.000	USD	-7.235,46	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,97 %	19.01.2024	300.000	USD	-18.469,90	-0,02
PepsiCo, Inc. 22,30 %	19.01.2024	310.000	USD	-19.646,07	-0,03
PepsiCo, Inc. 19,40 %	19.01.2024	120.000	USD	-4.706,46	-0,01
PepsiCo, Inc. 18,48 %	19.01.2024	270.000	USD	-8.293,64	-0,01
PepsiCo, Inc. 18,27 %	21.06.2024	210.000	USD	-1.962,56	0,00
Pfizer, Inc. 26,92 %	19.01.2024	170.000	USD	-7.375,87	-0,01
Pfizer, Inc. 26,15 %	19.01.2024	120.000	USD	-3.928,10	-0,01
Philip Morris International, Inc. 22,81 %	19.01.2024	110.000	USD	-4.225,72	-0,01
Philip Morris International, Inc. 23,79 %	19.01.2024	80.000	USD	-3.758,95	-0,01
Procter & Gamble Co./The 20,09 %	19.01.2024	220.000	USD	-7.829,18	-0,01
Procter & Gamble Co./The 20,49 %	19.01.2024	160.000	USD	-6.261,93	-0,01
QUALCOMM, Inc. 43,32 %	19.01.2024	150.000	USD	-12.593,23	-0,02
QUALCOMM, Inc. 38,33 %	19.01.2024	100.000	USD	-4.941,87	-0,01
QUALCOMM, Inc. 41,81 %	19.01.2024	160.000	USD	-11.926,03	-0,02
QUALCOMM, Inc. 38,38 %	19.01.2024	160.000	USD	-7.398,90	-0,01
QUALCOMM, Inc. 37,67 %	21.06.2024	110.000	USD	-3.453,20	0,00
QUALCOMM, Inc. 38,78 %	19.01.2024	70.000	USD	-3.779,43	-0,01
QUALCOMM, Inc. 38,64 %	15.09.2023	150.000	USD	-8.933,80	-0,01
Raytheon Technologies Corp. 25,35 %	19.01.2024	70.000	USD	-3.392,04	0,00
Raytheon Technologies Corp. 25,21 %	19.01.2024	100.000	USD	-4.858,58	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 31,58 %	15.09.2023	90.000	USD	-3.079,30	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 35,14 %	19.01.2024	90.000	USD	-5.060,91	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 33,06 %	19.01.2024	90.000	USD	-4.255,98	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 30,89 %	19.01.2024	90.000	USD	-1.807,19	0,00
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 29,87 %	21.06.2024	70.000	USD	1.708,24	0,00
Roche Holding AG 19,62 %	20.12.2024	1.860.000	CHF	-44.169,76	-0,06
S&P 500 Index 19,64 %	19.01.2024	17.500.000	USD	719.293,95	0,97
S&P 500 Index 21,00 %	19.01.2024	12.500.000	USD	698.780,71	0,94
S&P 500 Index 18,80 %	17.01.2025	15.000.000	USD	229.752,43	0,31
salesforce.com, Inc. 38,53 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.630,09	-0,01
salesforce.com, Inc. 36,73 %	19.01.2024	110.000	USD	-4.679,33	-0,01
Starbucks Corp. 28,18 %	19.01.2024	140.000	USD	-4.093,16	-0,01
Starbucks Corp. 28,72 %	15.09.2023	130.000	USD	-5.179,90	-0,01
Starbucks Corp. 27,62 %	21.06.2024	100.000	USD	-1.139,30	0,00
Starbucks Corp. 32,93 %	19.01.2024	150.000	USD	-11.503,61	-0,02
Starbucks Corp. 33,75 %	19.01.2024	140.000	USD	-11.480,70	-0,02
Swiss Market Index 16,04 %	20.12.2024	12.500.000	CHF	79.897,50	0,11
Swiss Re AG 25,45 %	20.12.2024	240.000	CHF	-3.452,19	0,00
Synopsys, Inc. 38,51 %	19.01.2024	60.000	USD	-5.296,99	-0,01
Synopsys, Inc. 33,74 %	15.09.2023	60.000	USD	-2.616,73	0,00
Synopsys, Inc. 40,00 %	19.01.2024	60.000	USD	-6.148,22	-0,01
Tesla, Inc. 64,11 %	19.01.2024	270.000	USD	-24.536,26	-0,03
Tesla, Inc. 61,12 %	21.06.2024	530.000	USD	-22.807,95	-0,03
Tesla, Inc. 65,01 %	15.09.2023	520.000	USD	-56.467,20	-0,08
Tesla, Inc. 63,14 %	19.01.2024	530.000	USD	-43.179,99	-0,06
Tesla, Inc. 72,83 %	19.01.2024	360.000	USD	-51.311,37	-0,07
Tesla, Inc. 55,81 %	17.01.2025	540.000	USD	2.114,94	0,00
Tesla, Inc. 71,40 %	19.01.2024	370.000	USD	-47.741,28	-0,06
Tesla, Inc. 58,40 %	19.01.2024	290.000	USD	-9.327,91	-0,01
Texas Instruments, Inc. 29,27 %	19.01.2024	110.000	USD	-4.431,36	-0,01
Texas Instruments, Inc. 30,47 %	15.09.2023	170.000	USD	-9.831,81	-0,01
Texas Instruments, Inc. 32,14 %	19.01.2024	200.000	USD	-13.421,95	-0,02
Texas Instruments, Inc. 30,38 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.169,29	-0,01
Texas Instruments, Inc. 29,07 %	21.06.2024	130.000	USD	-3.232,87	0,00
Texas Instruments, Inc. 29,50 %	19.01.2024	180.000	USD	-7.481,61	-0,01

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

ASSENAGON ALPHA PREMIUM

WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 30. JUNI 2023 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Texas Instruments, Inc. 33,18 %	19.01.2024	180.000	USD	-12.837,38	-0,02
Thermo Fisher Scientific, Inc. 30,46 %	19.01.2024	110.000	USD	-7.249,93	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 28,73 %	19.01.2024	150.000	USD	-7.675,62	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,69 %	19.01.2024	230.000	USD	-12.893,46	-0,02
T-Mobile US, Inc. 26,50 %	19.01.2024	200.000	USD	-4.157,20	-0,01
T-Mobile US, Inc. 27,72 %	21.06.2024	130.000	USD	-2.377,68	0,00
T-Mobile US, Inc. 30,68 %	19.01.2024	210.000	USD	-13.285,82	-0,02
T-Mobile US, Inc. 28,32 %	15.09.2023	200.000	USD	-8.330,25	-0,01
UBS Group AG 33,68 %	20.12.2024	580.000	CHF	-17.809,23	-0,02
UnitedHealth Group, Inc. 25,85 %	19.01.2024	310.000	USD	-5.220,34	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 25,47 %	17.01.2025	370.000	USD	566,15	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 25,85 %	19.01.2024	220.000	USD	-4.523,47	-0,01
Verizon Communications, Inc. 24,57 %	19.01.2024	80.000	USD	-3.030,90	0,00
Verizon Communications, Inc. 24,27 %	19.01.2024	110.000	USD	-4.004,71	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 30,44 %	19.01.2024	80.000	USD	-4.260,02	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 34,61 %	19.01.2024	90.000	USD	-7.954,96	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 31,86 %	15.09.2023	80.000	USD	-6.994,09	-0,01
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 34,12 %	21.06.2024	70.000	USD	-2.703,90	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 37,06 %	19.01.2024	90.000	USD	-9.900,19	-0,01
Walmart, Inc. 22,56 %	19.01.2024	100.000	USD	-5.885,37	-0,01
Walmart, Inc. 21,95 %	19.01.2024	130.000	USD	-6.852,76	-0,01
Walt Disney Co./The 33,21 %	19.01.2024	90.000	USD	-4.271,28	-0,01
Walt Disney Co./The 32,93 %	19.01.2024	130.000	USD	-5.729,43	-0,01
Wells Fargo & Co. 30,42 %	19.01.2024	90.000	USD	1.475,83	0,00
Wells Fargo & Co. 28,67 %	19.01.2024	120.000	USD	3.045,09	0,00
Zurich Insurance Group AG 20,85 %	20.12.2024	620.000	CHF	-14.624,80	-0,02
Summe Volatility Swaps				1.347.912,82	1,82
Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder und Volatility Swaps (Anschaffungskosten EUR 63.716.514,77)				64.268.602,12	86,58
Bankguthaben				9.519.783,59	12,83
Sonstige Vermögenswerte				14.491.348,34	19,52
Sonstige Verbindlichkeiten				-14.053.410,62	-18,93
Summe Nettoteilfondsvermögen				74.226.323,43	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 2023 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	45.920.689,30
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	46.946,38
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	1.347.912,82
Tagesgelder (Erl. 2)	17.000.000,00
Bankguthaben (Erl. 2) *	9.519.783,59
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	14.064.728,14
Zinsforderungen	379.673,82
Summe Aktiva	88.279.734,05
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	13.776.002,20
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	57,02
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	35.890,99
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	5.328,90
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	2.662,61
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	7.321,40
Zinsverbindlichkeiten	13.082,50
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	180.309,50
Sonstige Verbindlichkeiten	32.755,50
Summe Passiva	14.053.410,62
Summe Nettoteilfondsvermögen	74.226.323,43

Anteilklassen	I	I2R	IS	P	R	RS
Umlaufende Anteile zu Beginn der Geschäftsperiode	16.085,00	1.030,00	43.788,97	2.000,00	4.000,00	128.181,00
Zeichnungen	1.699,85	0,00	11.146,00	0,00	6.629,00	0,00
Rücknahmen	150,00	0,00	14.195,00	0,00	31,00	0,00
Umlaufende Anteile am Ende der Geschäftsperiode	17.634,85	1.030,00	40.739,97	2.000,00	10.598,00	128.181,00

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

ASSENAGON ALPHA PREMIUM
AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS
FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2023 BIS ZUM 30. JUNI 2023 IN EUR

Nettoteilfondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	72.732.452,15
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	271.053,32
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	338.831,93
Bankzinsen (Erl. 2) *	66.918,95
Summe Erträge	676.804,20
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	199.979,73
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	97.970,82
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	15.756,51
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	234.185,01
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	50.803,45
Performance Fee (Erl. 3)	180.309,50
Prüfungskosten	7.196,56
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	5.507,70
Transaktionskosten (Erl. 10)	126,32
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	130.117,90
Summe Aufwendungen	921.953,50
Nettogewinn/(-verlust)	-245.149,30
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	25.083.614,37
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-21.722.251,24
Realisierter Nettogewinn	3.116.213,83
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-9.039.218,57
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	8.779.903,22
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	2.856.898,48
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	14.209.810,32
Rücknahme von Anteilen	-15.572.837,52
Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	74.226.323,43

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

Statistische Angaben

Teilfondsangaben in EUR	
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 30.06.2023	74.226.323,43
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2022	72.732.452,15
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2021	111.517.394,10

Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2023	31.12.2022	31.12.2021
I	1.139,18	1.098,84	1.057,33
I2R	1.142,13	1.100,17	1.057,25
IS	1.102,36	1.062,50	1.041,26
P	55,76	53,94	52,21
R	56,88	54,87	52,82
RS	57,23	55,17	53,01

Umlaufende Anteile zum Stichtag

Anteilklasse	30.06.2023	31.12.2022	31.12.2021
I	17.634,85	16.085,00	34.271,66
I2R	1.030,00	1.030,00	1.030,00
IS	40.739,97	43.788,97	64.400,97
P	2.000,00	2.000,00	2.000,00
R	10.598,00	4.000,00	4.000,00
RS	128.181,00	128.181,00	128.622,00

Konsolidierte Darstellung

ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS PER 30. JUNI 2023 IN EUR

Aktiva	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	412.203.564,10
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	388.140,93
Unrealisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	217.951,36
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	8.415.715,04
Tagesgelder (Erl. 2)	522.094.122,00
Optionen (Erl. 2)	68.518.228,23
Bankguthaben (Erl. 2) *	246.747.199,07
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	92.264.247,06
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	44.967.968,07
Zinsforderungen	3.565.294,66
Gebühren für Differenzkontrakte	419.041,15
Sonstige Forderungen	39,98
Summe Aktiva	1.399.801.511,65
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	127.211.712,76
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	14.177.158,99
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	2.293.417,26
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	761.323,85
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	122.461,04
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	44.409,18
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	36.004,84
Zinsverbindlichkeiten	339.545,00
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	411.219,63
Sonstige Verbindlichkeiten	254.010,71
Summe Passiva	145.651.263,26
Summe Nettofondsvermögen	1.254.150.248,39

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

AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS FÜR DIE GESCHÄFTSPERIODE VOM 1. JANUAR 2023 BIS ZUM 30. JUNI 2023 IN EUR

Nettofondsvermögen zu Beginn der Geschäftsperiode	1.129.848.041,29
Erträge	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	1.959.194,54
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	6.810.638,98
Bankzinsen (Erl. 2) *	3.001.835,35
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.196.886,68
Summe Erträge	13.968.555,55
Aufwendungen	
Abschreibung des Agios	1.479.482,09
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	841.321,54
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	1.683.105,55
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	15.756,51
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	4.459.095,30
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	768.162,62
Performance Fee (Erl. 3)	411.218,71
Prüfungskosten	35.392,74
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	86.859,80
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	6.296.570,71
Transaktionskosten (Erl. 10)	273.849,49
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	766.497,22
Summe Aufwendungen	17.117.312,28
Nettogewinn/(-verlust)	-3.148.756,73
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	952.659.306,72
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-1.014.023.467,38
Realisierter Nettoverlust	-64.512.917,39
Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	111.665.918,54
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	-13.179.732,55
Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva	33.973.268,60
Entwicklung des Kapitals	
Ausgabe von Anteilen	415.860.237,14
Rücknahme von Anteilen	-325.531.298,64
Summe Nettofondsvermögen am Ende der Geschäftsperiode	1.254.150.248,39

* 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, in der jeweils gültigen Fassung, welcher die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) erfüllt.

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

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

Gegenwärtig besteht der Teilfonds Assenagon Alpha Volatility aus den Anteilklassen:

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

Gegenwärtig besteht der Teilfonds Assenagon Alpha Premium aus den Anteilklassen:

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

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

2. Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

Allgemeines

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

Bewertung der Anlagen

Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

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

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

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

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

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

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

Erträge

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

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren

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

3. Kosten

Alle Teilfonds

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

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

Für den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Verwaltungsgebühren

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

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

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

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

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

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

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

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

Für die abgelaufene Geschäftsperiode sind Performance Fees in Höhe von EUR 230.909,21 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee (esma34-39-992 Nr.5) sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Halbjahresberichts erläutert.

Verwahrstellen- und Administrationsgebühren und sonstige Kosten des Fonds

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

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

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

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

Für den Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Verwaltungsgebühren

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

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

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

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

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

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

An den beiden ersten Geschäftsjahresenden wird der Hurdle-Index auf den höheren Wert von a) dem für das jeweilige Geschäftsjahresende errechneten Hurdle-Index-Wert und b) dem Anteilswert der jeweiligen Anteilsklasse 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 180.309,50 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee (esma34-39-992 Nr.5) sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Halbjahresberichts erläutert.

Verwahrstellen- und Administrationsgebühren und sonstige Kosten des Fonds

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

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

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

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

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

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

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

Verwässerungsabgabe

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

Wenn Ausgaben, Rücknahmen und Umtausche in einem Teilfonds die Verwaltungsgesellschaft veranlassen, zugrundeliegende Anlagen dieses Teilfonds zu kaufen und/oder zu verkaufen, kann der Wert dieser Anlagen durch Geld-/Briefspannen, Handelskosten und damit verbundene Aufwendungen einschließlich Transaktionsgebühren, 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 Umtausch von Anteilen eine Verwässerungsabgabe von bis zu zwei (2) Prozent des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteile erheben, wenn ihrer Meinung nach die bestehenden Anteilinhaber (bei Ausgaben und Umtausch) oder die verbleibenden Anteilinhaber (bei Rücknahmen und Umtausch) nachteilig beeinträchtigt werden könnten.

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

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

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

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

In der abgelaufenen Geschäftsperiode wurde keine Verwässerungsabgabe angewendet.

4. Finanzterminkontrakte

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 30. Juni 2023 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index Future	EUR	15.09.2023	-1.440	-1.113.354,99	-0,09
DAX Index Future	EUR	15.09.2023	-34	-155.449,98	-0,01
EURO FX Currency Future	USD	18.09.2023	442	938.642,30	0,08
Nasdaq 100 E-Mini Future	USD	15.09.2023	-8	-87.787,35	-0,01
S&P 500 E-Mini Future	USD	15.09.2023	259	738.397,96	0,06
Swiss Market Index Future	CHF	15.09.2023	21	20.746,61	0,00
				341.194,55	0,03

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Die am 30. Juni 2023 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
EURO FX Currency Future	USD	18.09.2023	22	46.946,38	0,06
				46.946,38	0,06

5. Devisentermingeschäfte

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 30. Juni 2023 ausstehenden Devisengeschäfte des Investmentportfolios werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
17.012.764,73	EUR	16.500.000,00	CHF	15.09.2023	39.499,17	0,00
14.319.129,99	EUR	15.500.000,00	USD	15.09.2023	164.124,46	0,01
					203.623,63	0,01

Die am 30. Juni 2023 ausstehenden Devisentermingeschäfte für währungsgesicherte Anteilklassen werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/Verlust (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
69.991.070,00	CHF	71.728.763,86	EUR	21.08.2023	170.069,79	0,01
27.956.970,00	GBP	32.668.739,88	EUR	21.08.2023	-161.655,80	-0,01
3.316.430,00	USD	3.026.497,58	EUR	21.08.2023	5.913,74	0,00
					14.327,73	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 (I2 CHF, I2R, I2 SPEZ, I2 USD) und ausschüttende (I, I GBP, IS, P, R und RS) Anteile ausgegeben.

In der Geschäftsperiode vom 1. Januar 2023 bis zum 30. Juni 2023 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 2023 umgerechnet:

Britische Pfund	0,858143	= 1 Euro
Hong Kong Dollar	8,549731	= 1 Euro
Japanische Yen	157,687687	= 1 Euro
Schweizer Franken	0,97606316	= 1 Euro
US-Dollar	1,091000	= 1 Euro

10. Transaktionskosten

Die Transaktionskosten resultierend aus den Käufen und Verkäufen der Wertpapiere und Derivate für die am 30. Juni 2023 endende Geschäftsperiode werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Transaktionskosten (EUR)
Assenagon Alpha Volatility	2.153.699,89
Assenagon Alpha Premium	256,64

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

11. Besicherung der Derivate

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

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

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BNP Paribas S.A. Paris	Barmittel	27.770.000,00
Citigroup Global Markets Europe AG	Barmittel	1.550.000,00
Credit Suisse Bank (Europe)	Barmittel	14.860.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	2.390.000,00
Société Générale (Paris)	Barmittel	4.870.000,00
UBS AG	Barmittel	17.340.000,00

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)
Goldman Sachs Bank Europe SE	Barmittel	21.660.000,00
HSBC Continental Europe	Barmittel	1.550.000,00
JP Morgan SE	Barmittel	39.730.000,00

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
HSBC Continental Europe	Barmittel	270.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	430.000,00
UBS AG	Barmittel	600.000,00

12. Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

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

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

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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

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

13. Wesentliche Ereignisse im Laufe der Geschäftsperiode

Die KoppaKontor GmbH, vertreten durch Herrn Dr. Immo Querner, wurde per 1. Juni 2023 zum Vorsitzenden des Verwaltungsrates ernannt.

Herr Hans Günther bleibt Mitglied des Verwaltungsrates.

Die für das Jahr 2023 zu erwartende Konjunkturerholung wurde durch den Russisch-Ukrainischen Krieg ausgebremst. Die Sanktionen des Westens gegenüber Russland wirken sich negativ auf Produktion, Lieferketten und Handel insbesondere in den europäischen Volkswirtschaften aus und treiben die Preise weiter nach oben. Unternehmen stellen den Handel mit Russland komplett ein oder haben Schwierigkeiten, Finanzkanäle zu finden, über die sie bestehende Lieferketten aufrechterhalten können. Hinzu kommt die hohe Abhängigkeit vieler Länder von russischen Energieträgern wie Erdgas und Öl. Das Fondsmanagement hat zu Beginn der Ukraine-Krise die Portfolio-Unternehmen auf Russland Exposure überprüft. Minimale Exposures wurden frühzeitig geschlossen.

14. Wesentliche Ereignisse nach Bilanzstichtag 30. Juni 2023

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'Île
1204 Genf
Schweiz

Bezugsort für maßgebliche Dokumente

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

Total Expense Ratio

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

	Anteilklasse	Total Expense Ratio per 30. Juni 2023 (inkl. Performance Fee)	Performance Fee per 30. Juni 2023
Assenagon Alpha Volatility	I	1,09 %	0,00 %
	I2 CHF	1,50 %	0,45 %
	I2 SPEZ	0,29 %	0,00 %
	I2 USD*	1,05 %	-
	I GBP	1,09 %	0,00 %
	P	1,83 %	-
Assenagon Alpha Premium	R	1,13 %	0,00 %
	I	1,55 %	0,38%
	I2R	1,36 %	-
	IS	1,55 %	0,57 %
	P	2,28 %	0,42 %
	R	1,80 %	0,56 %
	RS	1,62 %	0,61 %

* Die Anteilklasse I2 USD wurde am 4. April 2023 neu aufgelegt.

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 Asset Management Association Switzerland in der aktuell gültigen Fassung berechnet. Gemäß Ziffer 8. dieser Richtlinie wird bei neu gegründeten kollektiven Kapitalanlagen der Betriebsaufwand annualisiert, um vergleichbare Ergebnisse zu erhalten.

Risikomanagementverfahren

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	70,98 % ⁽¹⁾
Minimum	34,95 % ⁽¹⁾
Durchschnitt	57,72 % ⁽¹⁾
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	1.129,74 % ⁽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	111,85 % ⁽¹⁾
Minimum	41,41 % ⁽¹⁾
Durchschnitt	71,38 % ⁽¹⁾
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	432,56 % ⁽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
- Ausdrückliche Berücksichtigung und Bewertung von Leistungen im Zusammenhang mit Nachhaltigkeit und ESG

Die Leitsätze des Vergütungssystems berücksichtigen, dass:

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

Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr 2022

Assenagon Asset Management S.A.	Angaben in Euro
Personalbestand Jahresdurchschnitt	81
Gesamtvergütung	12,307 Mio.
– davon feste Vergütung	8,0 – 8,5 Mio.
– davon variable Vergütung	3,5 – 4,0 Mio.
Gesamtvergütung an die Geschäftsführer	1,0 – 1,5 Mio.
Gesamtvergütung an weitere Risikoträger	5,5 – 6,0 Mio.

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

Sonstige Angaben

Aufgelaufene Performance Fee innerhalb der Berichtsperiode

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

Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee in %*
I	14.054,52	0,00 %
I2 CHF	215.419,97	0,30 %
I2 SPEZ	-0,03	0,00 %
I2 USD*	0,00	0,00 %
I GBP	1.123,23	0,00 %
P	0,00	0,00 %
R	311,52	0,00 %
insgesamt	230.909,21	

* Die Anteilklasse I2 USD wurde am 4. April 2023 neu aufgelegt.

Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee in %*
I	42.390,67	0,21 %
I2R	0,00	0,00 %
IS	119.002,50	0,26 %
P	205,49	0,18 %
R	768,86	0,13 %
RS	17.942,02	0,24 %
insgesamt	180.309,50	

* Die relative Performance Fee ergibt sich als Summe aus

- der Summe der täglichen Kristallisierungen aus Anteilscheinrückgaben relativ zum Nettovermögen der Anteilklasse des Vortages und
- der aufgelaufenen Performance Fee Abgrenzung zum Geschäftsjahresende relativ zum Nettovermögen der Anteilklasse am Geschäftsjahresende

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

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

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

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

Der Assenagon Alpha unterhielt keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamttrendite-Swaps in der Geschäftsperiode zum 30. Juni 2023. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannten Regulierung finden daher keine Anwendung.

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

Assenagon Alpha Volatility

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

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

Assenagon Alpha Premium

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

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

assenagon

Assenagon Asset Management S.A.

Aerogolf Center

1B Heienhaff

1736 Senningerberg

Luxemburg

Telefon +352 27049-100

Telefax +352 27049-111

www.assenagon.com

© 2023