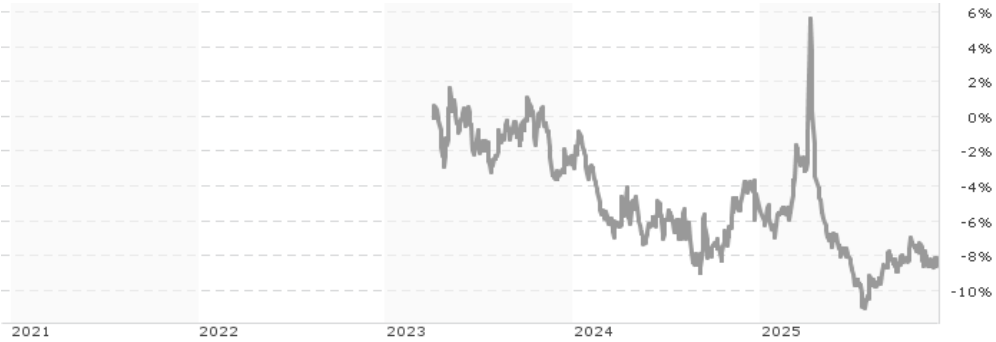
Assenagon Alpha Volatility (I2 USD) / LU2053564873 / A2PR1R / Assenagon AM

Aktuell 11.12.2025 [1]	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
915,90 USD	weltweit	AI Volatility	thesaurierend	Alternative Investm.



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

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

Jahresperformance	
2024	-3,24%

Stammdaten	
Fondart	Einzelfond
Kategorie	Alternative Investments
Fondsunterkategorie	AI Volatility
Ursprungsland	Luxemburg
Tranchenvolumen	(11.12.2025) EUR 8,38 Mio.
Gesamt-Fondsvolumen	(11.12.2025) EUR 1,04 Mrd.
Auflagedatum	04.04.2023
KESt-Meldefonds	Ja
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.
Nachhaltigkeitsfondsart	-
Fondsmanager	Daniel Danon, Tobias Knech
Thema	-

Konditionen	
Ausgabeaufschlag	0,00%
Managementgebühr	0,80%
Depotgebühr	0,15%
Tilgungsgebühr	0,00%
Sonstige lfd. Kosten	(05.03.2025) 1,06%
Transaktionskosten	1,25%

Sonstige Kennzahlen	
Mindestveranlagung	EUR 0,00
Sparplan	Nein
UCITS / OGAW	Ja
Gewinnbeteiligung	15,00%
Umschichtgebühr	-

Fondsgesellschaft

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

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	-0,20%	-0,81%	-3,19%	-4,56%	-5,53%	-	-	-8,41%
Performance p.a.	-	-	-	-4,56%	-2,80%	-	-	-3,21%
Performance p.a. nach max. AGA	-	-	-	-4,56%	-2,81%	-	-	-3,21%
Sharpe Ratio	-0,71	-0,71	-0,56	-0,67	-0,57	-	-	-0,65
Volatilität	6,47%	5,20%	9,85%	9,97%	8,60%	-	-	8,20%
Schlechtester Monat	-	-1,99%	-2,45%	-2,45%	-2,62%	-4,07%	-	-4,07%
Bester Monat	-	+1,95%	+2,51%	+2,51%	+2,76%	+2,76%	-	+2,76%
Maximaler Verlust	-0,97%	-3,74%	-15,83%	-15,83%	-15,83%	-	-	-15,83%

Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Schweiz;

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

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 12.12.2025 13:20

Assenagon Alpha Volatility (I2 USD) / LU2053564873 / A2PR1R / Assenagon AM

Investmentstrategie

Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatiliäts-Strate-gien und einem Basisportfolio. Die Volatilitäts-Strategien nutzen systematisch relative Preisdifferenzen in unterschiedlichen Volatilitäts-segmenten. Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch Terminkontrakte abgesichert werden. Das Basisportfolio des Fonds zielt darauf ab, Wertbeiträge in Höhe einer geldmarktnahen Rendite zu erzielen. Je nach Marktphasen und identifizierten Chancen für die In-vestment-Strategien können, zwischen 0 % und 100 % in das Basisportfolio investiert werden. Zur Umsetzung der Anlagestrategie nutzt der Fonds vor allem Derivate. Eingesetzt werden vor allem Swaps, Optionen, Forwards und Futures, auf Einzeltitel, Körbe von Einzeltiteln, Indi-zes und abgeleitete Größen wie Zinssätze, Volatilität oder Varianz. Derivate können sowohl zu Anlage- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden. Durch den Einsatz von Derivaten kann eine Hebelwirkung im Fonds entstehen. Als Anlageinstrumente können vom Portfolio Management außerdem Aktien, Zertifikate, Termingelder und Sichteinlagen, Schuldverschreibungen, Währungsgeschäfte, Anteile anderer OGA sowie OGAW, und Anleihen von Industrieunternehmen, Staaten und sonstigen Schuldnern eingesetzt werden. Schuldver-schreibungen haben ein Mindestrating von B- oder B3.

Fondsspezifische Informationen

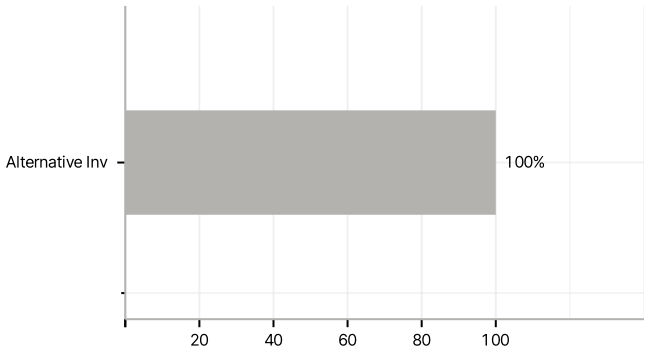
Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Assenagon Alpha Volatility (I2 USD) wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Volatility (I2 USD) kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: die von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder seinen Gebietskörperschaften oder von einem Mitgliedstaat der OECD oder von internationalen Organismen öffentlich-rechtlichen Charakters, denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten der Europäischen Union angehören, oder von anderen von der CSSF anerkannten Staaten (wie z.B. Brasilien, Singapur, Russland, Indonesien oder Südafrika) begeben oder garantiert werden.

Investmentziel

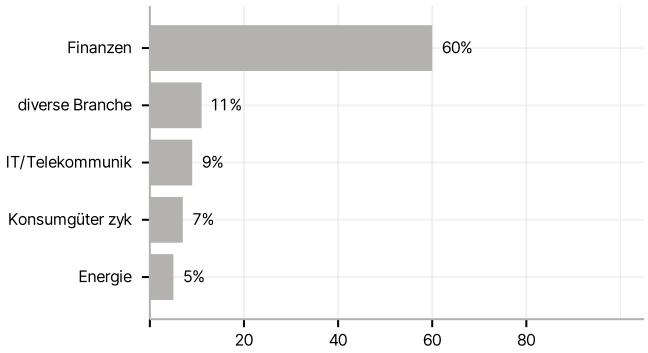
Der Fonds verfolgt das Ziel, mittel- bis langfristig einen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Insbesondere in Marktphasen mit erhöhter Volatilität wird ein positiver Wertzuwachs angestrebt. Zwischenzeitliche Wertschwankungen werden dabei toleriert. Der Fonds wird aktiv verwaltet, ohne dass die Investitionen auf ein bestimmtes Benchmarkuniversum beschränkt sind. Erträge können ausgeschüttet werden.

Veranlagungsstruktur

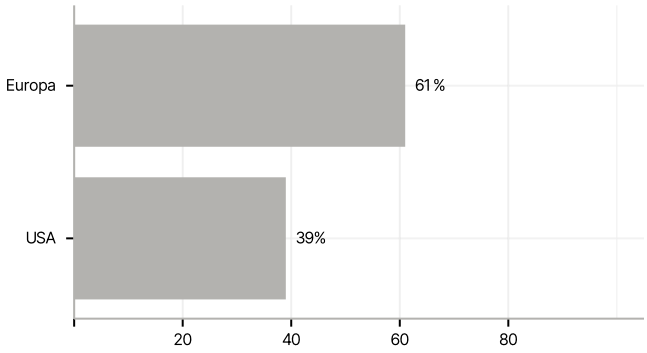
Anlagearten



Branchen



Länder



RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 12.12.2025 13:20