

Assenagon Alpha Volatility (I2 CHF) (LU2001392914)

KAG: Assenagon AM

ISIN: LU2001392914

Rücknahmepreis: 963,76 CHF

Stand: 10.03.2025

Auflagedatum	13.08.21
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	1,088.09 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Volatility
Fondsmanager	Daniel Danon, Tobias...
Kapitalanlagegesellschaft	
Assenagon AM	
IB Heienhaff	
1736 Senningerberg	
Luxemburg	
https://www.assenagon.com	



Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA		+0,09%	-3,96%	-
Performance nach max. AGA		+0,09%	-3,96%	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		-0,32	-0,82	-
Volatilität		+7,65%	+7,96%	-

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

Fondsstrategie

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.

Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatilitäts-Strategien und einem Basisportfolio. Die Volatilitäts-Strategien nutzen 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 Investment-Strategien können, zwischen 0 % und 100 % in das Basisportfolio investiert werden. Zur Umsetzung der Anlagestrategie nutzt der Fonds vor allem Derivate. Eingesetzt werden vor allem Swaps, Optionen, Forwards und Futures, auf Einzeltitel, Körbe von Einzeltiteln, Indizes und abgeleitete Größen wie Zinssätze, Volatilität oder Varianz. Derivate können sowohl zu Anlage- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden. 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 Schuldner eingesetzt werden. Schuldverschreibungen haben ein Mindestrating von B- oder B3.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann überwiegend in Einlagen investiert werden. Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des Assenagon Alpha Volatility (I2 CHF) wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Volatility (I2 CHF) 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.

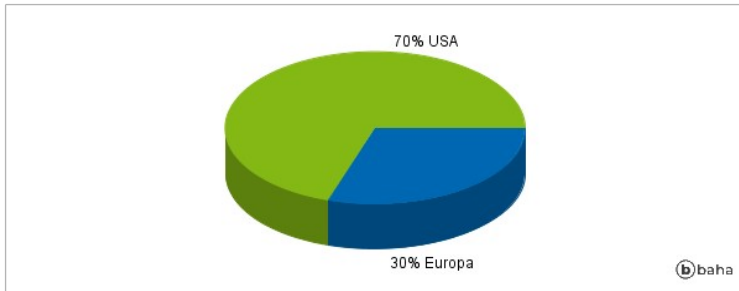
Anlagearten



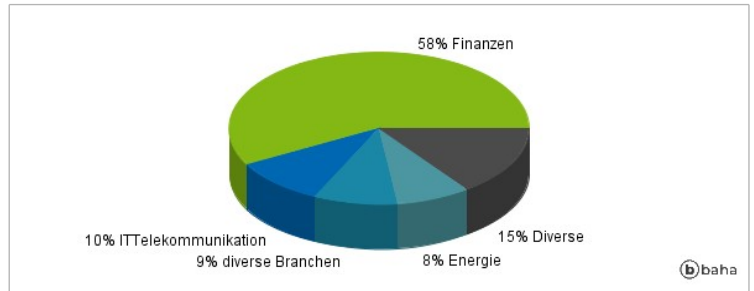
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 03/2025

Erstellt: 12.03.2025 08:23