

Assenagon Alpha Premium (R2) (LU2053562158)

KAG: Assenagon AM

ISIN: LU2053562158

Rücknahmepreis: 60,83 EUR

Stand: 30.10.2024

Auflagedatum	10.12.19
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondsvolumen	221.74 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Volatility
Fondsmanager	n.a.
Kapitalanlagegesellschaft	
Assenagon AM	
IB Heienhaff	
1736 Senningerberg	
Luxemburg	
https://www.assenagon.com	



Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance	vor AGA	+7,85%	+5,06%	-
Performance	nach max. AGA	+7,85%	+5,06%	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		1,27	0,36	-
Volatilität		+3,78%	+5,51%	-

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

Fondsstrategie

Der Fonds verfolgt das Ziel, durch die Vereinnahmung von Risikoprämien am Volatilitätsmarkt mittelfristig einen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Zwischenzeitliche Wertschwankungen werden dabei toleriert. Der Fonds wird aktiv verwaltet, ohne dass die Investitionen auf ein bestimmtes Benchmarkuniversum beschränkt sind. Alle Erträge verbleiben im Fonds und erhöhen den Wert der Anteile.

Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatiliäts-Strategien und einem Basisportfolio. Die Volatiliäts-Strategien nutzen strukturelle oder temporäre Ineffizienzen an den globalen Derivatemärkten. Dazu gehört, dass die für einen Zeitraum erwartete Volatilität oft höher ist als die sich im Zeitverlauf realisierende Volatilität. Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch Terminkontrakte abgesichert werden. Das Basisportfolio des Fonds zielt darauf ab, Wertbeiträge in Höhe des kurzfristigen Rentenmarkts 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.

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 Premium (R2) wurden durch die FMA bewilligt. Der Assenagon Alpha Premium (R2) 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.

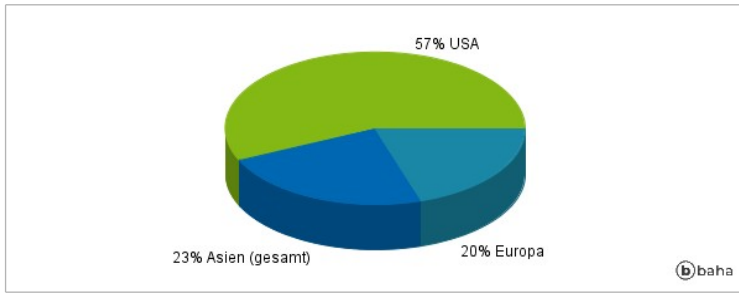
Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 11/2024

Erstellt: 01.11.2024 05:25