

Halbjahres-
bericht

Assenagon I

Ungeprüfter Halbjahresbericht zum 31. März 2021

– Anlagefonds nach Luxemburger Recht –

"Fonds commun de placement" ("FCP") gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen

RCS-Nr. K80

Der vorliegende Bericht für den Umbrella-Fonds
"Assenagon I"

umfasst folgenden Teilfonds:

- Multi Asset Conservative

Inhalt

Informationen an die Anleger	4
Hinweis zum Halbjahresbericht	4
Zusätzliche Informationen für die Schweiz	4
Verwaltung, Vertrieb und Beratung	5
Assenagon I – Multi Asset Conservative	6
Zusammensetzung des Nettoteilfondsvermögens	6
Währungsübersicht des Teilfonds	6
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	6
Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	7
Vermögensaufstellung des Teilfonds	7
Verpflichtungen aus Derivaten	11
Devisenkurse (in Mengennotiz)	11
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	12
Vermögensentwicklung des Teilfonds	13
Entwicklung im Jahresvergleich	13
Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht	14
Allgemein	14
Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze	14
Erträge	15
Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren	15
Kosten	15
Ausweis der Kontrahenten	16
Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes	16
Ertragsverwendung	16
Besteuerung (Taxe d'abonnement)	16
Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds	16
Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraumes	17
Wichtige Ereignisse nach dem Berichtszeitraumes	17
Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und deren Weiterverwendung	17
Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz	18
Allgemein	18
Bezugsort für maßgebliche Dokumente	18
Total Expense Ratio	18

Das zusammengefasste Fondsvermögen des Investmentfonds Assenagon I besteht zum 31. März 2020 ausschließlich aus dem Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative.

Informationen an die Anleger

Die geprüften Jahresberichte werden spätestens vier Monate nach Ablauf eines jeden Geschäftsjahres und die ungeprüften Halbjahresberichte spätestens zwei Monate nach Ablauf der ersten Hälfte des Geschäftsjahres veröffentlicht.

Das Geschäftsjahr des Fonds beginnt am 1. Oktober eines jeden Jahres und endet am 30. September des darauffolgenden Jahres.

Zeichnungen können nur auf Basis des jeweils gültigen Verkaufsprospektes (nebst Anhängen) und der jeweils gültigen Wesentlichen Anlegerinformationen (KID), sowie mit dem zuletzt erschienenen Jahresbericht und, wenn der Stichtag des letzteren länger als acht Monate zurückliegt, zusätzlich mit dem jeweils aktuellen Halbjahresbericht, erfolgen.

Die Berichte sowie der jeweils gültige Verkaufsprospekt/Emissionsdokument (nebst Anhängen) und die jeweils gültigen Wesentlichen Anlegerinformationen (KID) sind bei der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft und den Zahl- und Informationsstellen kostenlos erhältlich.

Die Assenagon Asset Management S.A. bestätigt, sich während des Berichtszeitraums in ihrer Tätigkeit für den Fonds in allen wesentlichen Belangen an die von der ALFI im "ALFI Code of Conduct for Luxembourg Investment Funds" von 2009 (in der letzten Fassung vom Juni 2013) festgelegten Grundsätze gehalten zu haben.

Hinweis zum Halbjahresbericht

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, Schweiz. Die aktuellen Anteilspreise können unter www.fundinfo.com abgerufen werden.

Die in diesem Bericht enthaltenen Angaben und Zahlen sind vergangenheitsbezogen und geben keinen Hinweis auf die zukünftige Entwicklung.

Verwaltung, Vertrieb und Beratung

Verwaltungsgesellschaft

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

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

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

Zentralverwaltungsstelle (bis 30. November 2020)

LRI Invest S.A.
9A, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.lri-group.lu

Zentralverwaltungsstelle (seit 1. Dezember 2020)

Apex Fund Services S.A.
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.apexfundservices.com

Zahlstelle sowie Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Baader Bank AG
Weihestephaner Straße 4
85716 Unterschleißheim
Deutschland
www.baaderbank.de

Zahlstelle in der Republik Schweiz

BANQUE CANTONALE DE GENÈVE
17, quai de l'Île
1204 Genf
Schweiz
www.bcge.ch

Zahlstelle in dem Großherzogtum Luxemburg

European Depositary Bank SA
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.europeandepositorybank.com

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Verwahrstelle sowie Register- und Transferstelle

European Depositary Bank SA
3, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.europeandepositorybank.com

Aufsichtsbehörde in dem Großherzogtum Luxemburg

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

Vertreter in der Schweiz

CARNEGIE FUND SERVICES S.A.
11, rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz
www.carnegie-fund-services.ch

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstelle in der Republik Österreich

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG
Am Belvedere 1
1100 Wien
Österreich
www.sparkasse.at/erstebank/privatkunden

Vertriebsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

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

Abschlussprüfer

Deloitte Audit, Société à responsabilité limitée
20 Boulevard de Kockelscheuer
1821 Luxemburg
Luxemburg
www.deloitte.lu

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Zusammensetzung des Nettoteilfondsvermögens

Assenagon I – Multi Asset Conservative per 31. März 2021

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	143.493.188,00
(Wertpapiereinstandskosten EUR 134.670.150,91)	
Derivate	-785.584,44
Bankguthaben	52.289.835,48
Sonstige Vermögensgegenstände	0,01
Summe Aktiva	194.997.439,05
Bankverbindlichkeiten	-133.578,60
Zinsverbindlichkeiten	-34.634,57
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.048.853,32
Summe Passiva	-1.217.066,49
Nettoteilfondsvermögen	193.780.372,56

Währungsübersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Währung	Kurswert in Mio. EUR	In % des Nettoteil- fondsvermögens
EUR	175,38	90,51
USD	17,01	8,78
SEK	0,74	0,38
GBP	0,31	0,16
CHF	0,26	0,13
JPY	0,05	0,02
HKD	0,03	0,02
Summe	193,78	100,00

Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	In % des Nettoteil- fondsvermögens
Wertpapier-Investmentanteile	137,78	71,10
Indezertifikate	5,71	2,95
Summe	143,49	74,05

Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Länder	Kurswert in Mio. EUR	In % des Nettoteil- fondsvermögens
Luxemburg	99,99	51,59
Irland	41,50	21,42
Bundesrepublik Deutschland	1,22	0,63
Frankreich	0,69	0,36
Liechtenstein	0,09	0,05
Summe	143,49	74,05

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Vermögensaufstellung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative zum 30. September 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Kurs zum 31.03.2021	Kurswert in EUR	In % des Nettoteil- fonds- vermögens
Amtlich gehandelte Wertpapiere/Regulierter Markt						
Indezertifikate						
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Gold	IE00B579F325	STK	37.500,00	EUR 140,6200	5.273.250,00	2,72
iShares Physical Metals PLC OPEN END ZT 11(11/O.End)Platin	IE00B4LHWP62	STK	30.000,00	USD 17,1388	437.473,41	0,23
Wertpapier-Investmentanteile						
A.I.I.S.-All.Europ.Micro Cap Inhaber-Ant. IT (EUR)Acc. o.N.	LU0594339896	ANT	235,00	EUR 4.561,9100	1.072.048,85	0,55
AGIF-Allianz Credit Opportuni. Inhaber-Anteile IT(EUR) o.N.	LU1505874849	ANT	3.500,00	EUR 1.046,3800	3.662.330,00	1,89
Alpha UC.-Fair Oaks H.G.Cre.Fd Namens-Anteile E Cap. EUR o.N.	LU2009875944	ANT	200,00	EUR 1.012,5500	202.510,00	0,10
Amundi Fds-Europ. Equity Value Act. Nom. I2 Unh. EUR Acc. oN	LU1883315480	ANT	800,00	EUR 2.198,1300	1.758.504,00	0,91
AS SICAV I - China A Share Eq. Actions Nom. I Acc EUR o.N.	LU1129205529	ANT	67.000,00	EUR 22,5812	1.512.940,40	0,78
Assenagon Alpha Volatility Inhaber-Anteile I o.N.	LU0575255335	ANT	2.700,00	EUR 1.151,2200	3.108.294,00	1,60
AXA World Fd.-US Dy.High YL.Bd Nam.-Ant.I Cap.EUR Hed.o.N.	LU1105451345	ANT	23.200,00	EUR 144,1900	3.345.208,00	1,73
BAKERSTEEL GBL - Electrum Fund Act. au Port. I EUR Acc. oN	LU1923360827	ANT	9.000,00	EUR 153,5500	1.381.950,00	0,71
Berenberg European Micro Cap Namens-Anteile M o.N.	LU1637618825	ANT	6.000,00	EUR 179,1100	1.074.660,00	0,55
BNP Pari.Flexi I-ABS Europe IG Nam.-Anteile I Cap.EUR o.N	LU1815417339	ANT	5.700,00	EUR 1.187,0900	6.766.413,00	3,49
Carmignac Portf.-Credit Namens-Ant. W EUR Acc. o.N.	LU1623763148	ANT	30.500,00	EUR 145,8200	4.447.510,00	2,29
Eleva Leaders Sm.&Mid-C.Europe Actions Nom. I Cap.EUR o.N.	LU1920216006	ANT	270,00	EUR 1.689,8000	456.246,00	0,24
Eleva UCITS-Eleva Abs.Ret.Eur. Nam.-Ant. S EUR acc. o.N.	LU1331974276	ANT	3.700,00	EUR 1.335,4500	4.941.165,00	2,55
F.Sent.Inv.GLU.-FSSA Jap.Equ. Reg. Shs VI EUR Acc. oN	IE00BFY84Q86	ANT	119.500,00	EUR 23,6129	2.821.741,55	1,46
Fed.He.IF-F.H.As.Ex-Jap.Equ.Fd Reg. Shs F Dist.EUR o.N.	IE00B831WC11	ANT	290.000,00	EUR 4,9853	1.445.737,00	0,75
Focus Fund Growth Equities HI Inhaber-Anteile I	DE000A2PF0Y9	ANT	715,00	EUR 1.700,8500	1.216.107,75	0,63

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Kurs zum 31.03.2021	Kurswert in EUR	In % des Nettoteil- fonds- vermögens
Fundsmith SICAV-Equity Fund Inhaber-Anteile I Dis.o.N.	LU0690374532	ANT	81.000,00 EUR	47,1310	3.817.611,00	1,97
GAM STAR Fd PLC-GAM St.Cat Bd. Regist. Shares M Acc.EUR o.N.	IE00BZ5Z4Q84	ANT	300.000,00 EUR	10,4282	3.128.460,00	1,61
Heptagon Fd-Kop.Gl.All-Cap Eq. Reg. Shares CE Acc. EUR o.N.	IE00BH4GY991	ANT	7.000,00 EUR	204,9282	1.434.497,40	0,74
iShs VI-iShs Div.Com.SW.UC.ETF Registered Shares o.N.	IE00BDFL4P12	ANT	200.000,00 EUR	4,4400	888.000,00	0,46
LUMYNA-Y.ASIAN EV.-DRIV.UCITS Reg. Shares B Acc.EUR o.N.	LU0532510137	ANT	12.000,00 EUR	176,7700	2.121.240,00	1,09
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	LU1535992389	ANT	10.300,00 EUR	129,3000	1.331.790,00	0,69
M.U.L.-Lyxor MSCI Russi.UC.ETF Namens-Anteile Acc.EUR o.N	LU1923627092	ANT	35.000,00 EUR	42,1720	1.476.020,00	0,76
Man Fds VI-Man GLG Hig.Yi.Opp. Registered Acc.Shs I EUR o.N.	IE00BDTYYL24	ANT	28.900,00 EUR	131,2900	3.794.281,00	1,96
Man Funds-M.GLG Jap.CoreAL Eq. Regist.Shares I H EUR o.N.	IE00B578XK25	ANT	17.000,00 EUR	189,7500	3.225.750,00	1,66
Mandarine Valeur Actions au Porteur G o.N.	FR0010806778	ANT	80,00 EUR	8.635,9800	690.878,40	0,36
MUL-LYXOR S&P 500 UCITS ETF Inhaber-Anteile Dist EUR o.N.	LU0496786574	ANT	44.000,00 EUR	34,7500	1.529.000,00	0,79
Neub.Berm.Inv.-N.B.Co.Hy.Bd Fd Reg. Shares I Acc. EUR o.N.	IE00BZ090894	ANT	111.000,00 EUR	12,8500	1.426.350,00	0,74
Pacif.Cap.-Pac.G10 Macro Rates Reg. Shs Z Hgd EUR Acc. oN	IE00BG5J0X60	ANT	315.000,00 EUR	10,5470	3.322.305,00	1,71
Pareto-Par.Nordic Corporate Bd Namens-Anteile H Acc.EUR o.N.	LU1311575093	ANT	116.700,00 EUR	113,3309	13.225.716,03	6,82
Pictet TR - Agora Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1071462532	ANT	34.515,00 EUR	139,6400	4.819.674,60	2,49
PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Acc.Shs Inst.EUR Hed.o.N.	IE00B80G9288	ANT	13.000,00 EUR	14,8000	192.400,00	0,10
PIMCO GIS-Mortgage Opportun.Fd Reg.Shares Inst.EUR(H)Acc.o.N.	IE00BYZNBH50	ANT	20.000,00 EUR	10,5400	210.800,00	0,11
Twelve Cat Bond Fund Reg. Shs SI1 EUR Acc. oN	IE00BKF1PS04	ANT	30.000,00 EUR	107,1400	3.214.200,00	1,66
Vontobel Fd-TwentyF.M.E.A.B.S. Actions Nom. I Cap.EUR o.N.	LU1602255561	ANT	84.700,00 EUR	103,4500	8.762.215,00	4,52
WMF(I)-W.Em.Loc.Debt Adv.Beta Reg.Shs EUR SC Accumulating oN	IE00BYXWSZ19	ANT	200.000,00 EUR	11,7305	2.346.100,00	1,21
WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity Fd Reg.Shares N Acc. Unh.EUR o.N.	IE00B9DPD161	ANT	294.000,00 EUR	20,4219	6.004.038,60	3,10
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0274211217	ANT	112.700,00 EUR	41,4550	4.671.978,50	2,41
Xtrackers S&P 500 Swap Inhaber-Anteile 1C USD o.N.	LU0490618542	ANT	285.600,00 EUR	64,0700	18.298.392,00	9,44
AB FCP I-Mortgage Income Ptf. Actions Nom. S1 USD o.N.	LU1021293185	ANT	129.000,00 USD	17,4100	1.910.907,85	0,99
B & I Asian Real Est.Sec.Fund Inhaber-Anteile A o.N.	LI0115321320	ANT	400,00 USD	258,7200	88.052,41	0,05
Eat.Van.Int.IE-Em.Mk.Debt Opps Reg. Shs S USD Acc. oN	IE00BJ9ML175	ANT	246.000,00 USD	11,1600	2.335.880,20	1,21
MSIF-USD Short Dur.H.Yld Bd Fd Actions Nom. Z Cap. USD o.N.	LU1134226700	ANT	140.000,00 USD	36,1200	4.302.561,05	2,22
Summe Wertpapiervermögen			EUR		143.493.188,00	74,04

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Kurs zum 31.03.2021	Kurswert in EUR	In % des Nettoteil- fonds- vermögens
Derivate						
Aktienindex-Terminkontrakte						
Dow Jones Ind Mini Future 18.06.21		STK	38,00 USD	32.898,0000	12.932,87	0,01
FTSE 100 Future 18.06.21		STK	18,00 GBP	6.679,5000	-11.727,42	-0,01
MSCI Emerging Markets Mini Index Future 18.06.21		STK	29,00 USD	1.322,5000	-6.168,63	0,00
Nikkei 225 Stock Av. Index Future USD CME 10.06.21		STK	15,00 USD	29.370,0000	25.525,40	0,01
OMX 30 Index Future 16.04.21		STK	176,00 SEK	2.187,2500	53.895,11	0,03
OMX 30 Index Future 18.06.21		STK	22,00 SEK	2.173,5400	4.196,30	0,00
S&P 500 E-Mini Index Future 18.06.21		STK	22,00 USD	3.967,4000	28.428,91	0,01
STXE 600 Future 18.06.21		STK	40,00 EUR	425,3000	8.600,00	0,00
Zinsterminkontrakte						
Rentenindex-Terminkontrakte						
10 Y Euro-BTP Italian Gov. Bond Future 08.06.21		STK	24,00 EUR	149,3100	-23.760,00	-0,01
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.21		STK	20,00 USD	143,6875	-64.345,28	-0,03
Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)						
Devisenterminkontrakte						
EUR/GBP Future 14.06.21		GBP	25,00 EUR	0,8521	-19.002,76	-0,01
EUR/USD Future 14.06.21		USD	378,00 EUR	1,1742	-794.158,94	-0,41
Summe Derivate			EUR		-785.584,44	-0,41
Bankguthaben						
Bankkonten						
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		CHF	287.202,06 EUR		259.641,15	0,13
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		EUR	19.457.300,73 EUR		19.457.300,73	10,04
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		GBP	177.826,94 EUR		208.753,82	0,11
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		HKD	290.894,72 EUR		31.835,96	0,02
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		JPY	6.030.042,00 EUR		46.431,14	0,02
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		SEK	7.429.365,54 EUR		725.222,98	0,37
Bankkonto Commerzbank AG (Frankfurt)		USD	726.019,18 EUR		617.730,95	0,32
Bankkonto European Depositary Bank SA		CHF	350,50 EUR		316,86	0,00
Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	13.091.286,32 EUR		13.091.286,32	6,76
Bankkonto European Depositary Bank SA		GBP	87.332,69 EUR		102.521,21	0,05
Bankkonto European Depositary Bank SA		SEK	139.313,25 EUR		13.599,17	0,01
Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	8.598.532,60 EUR		7.316.032,16	3,78
Forderungen aus Variation Margin		EUR	23.760,00 EUR		23.760,00	0,01
Forderungen aus Variation Margin		GBP	26.177,50 EUR		30.730,18	0,02
Forderungen aus Variation Margin		USD	1.016.250,00 EUR		864.672,85	0,45
Callgeld(er)						
Callgeld Bayerische Landesbank (München)		EUR	9.500.000,00 EUR		9.500.000,00	4,90
Summe Bankguthaben			EUR		52.289.835,48	26,98

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Kurs zum 31.03.2021	Kurswert in EUR	In % des Nettoteil- fonds- vermögens
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Kurs zum 31.03.2021	Kurswert in EUR	In % des Nettoteil- fonds- vermögens
Sonstige Vermögensgegenstände						
Gründungskosten		EUR	0,01	EUR	0,01	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände			EUR		0,01	0,00
Bankverbindlichkeiten						
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-8.600,00	EUR	-8.600,00	0,00
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		SEK	-595.103,00	EUR	-58.091,42	-0,03
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-78.612,50	EUR	-66.887,18	-0,03
Summe Bankverbindlichkeiten			EUR		-133.578,60	-0,07
Zinsverbindlichkeiten						
Zinsverbindlichkeit(en) Callgeld(er)		EUR	-1.971,93	EUR	-1.971,93	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		CHF	-0,93	EUR	-0,84	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	-32.372,33	EUR	-32.372,33	-0,02
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		GBP	-26,94	EUR	-31,62	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		SEK	-152,89	EUR	-14,92	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	-93,23	EUR	-79,32	0,00
Zinsverbindlichkeit(en) Callgeld(er)		EUR	-163,61	EUR	-163,61	0,00
Summe Zinsverbindlichkeiten			EUR		-34.634,57	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾			EUR		-1.048.853,32	-0,53
Nettoteilfondsvermögen			EUR		193.780.372,56	100,00*

*) Durch Rundungen bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

1) In den "Sonstigen Verbindlichkeiten" sind fremde Depotgebühren, performance-abhängige Anlageberatervergütung, Prüfungskosten, Risiko-Management-Gebühr, Register- und Zahlstellengebühr, sonstige Spesen, Taxe d'abonnement, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsvergütung enthalten.

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	EUR	1.155,18
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2 EUR	EUR	59,88
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	EUR	57,49
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	STK	113.153,73
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2 EUR	STK	745.577,77
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	STK	320.470,11
Bestand der Wertpapiere am Nettoteilfondsvermögen	%	74,04
Bestand der Derivate am Nettoteilfondsvermögen	%	-0,41

Verpflichtungen aus Derivaten

Futures Kauf	Währung	Kontrakte	Kontraktgröße	Kurs	Dev.Kurs	Verpflichtungen aus Derivaten in EUR
Nikkei 225 Stock Av. Index Future USD CME 10.06.21	USD	15,00	5,00	29.370,0000	0,850847	1.874.202,33
OMX 30 Index Future 18.06.21	SEK	22,00	100,00	2.173,5400	0,097616	466.777,75
EUR/GBP Future 14.06.21	GBP	25,00	125.000,00	0,8521	1,173916	3.125.733,70
10 Y Euro-BTP Italian Gov. Bond Future 08.06.21	EUR	24,00	1.000,00	149,3100	1,000000	3.583.440,00
FTSE 100 Future 18.06.21	GBP	18,00	10,00	6.679,5000	1,173916	1.411.410,46
MSCI Emerging Markets Mini Index Future 18.06.21	USD	29,00	50,00	1.322,5000	0,850847	1.631.604,70
STXE 600 Future 18.06.21	EUR	40,00	50,00	425,3000	1,000000	850.600,00
Ultra 10 Year T-Note Future 21.06.21	USD	20,00	1.000,00	143,6875	0,850847	2.445.120,39
S&P 500 E-Mini Index Future 18.06.21	USD	22,00	50,00	3.967,4000	0,850847	3.713.213,65
OMX 30 Index Future 16.04.21	SEK	176,00	100,00	2.187,2500	0,097616	3.757.776,31
Dow Jones Ind Mini Future 18.06.21	USD	38,00	5,00	32.898,0000	0,850847	5.318.318,73
EUR/USD Future 14.06.21	USD	378,00	125.000,00	1,1742	0,850847	47.205.777,25
Summe Futures Kauf						75.383.975,27

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	31.03.2021
Schweizer Franken	(CHF)	1,106150	= 1	EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,851850	= 1	EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	9,137300	= 1	EUR
Japanischer Yen	(JPY)	129,870650	= 1	EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	10,244250	= 1	EUR
US-Dollar	(USD)	1,175300	= 1	EUR

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative im Zeitraum vom 01.10.2020 bis 31.03.2021

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	16.432,96
Erträge aus Bestandsprovisionen	11.219,81
Sonstige Erträge	162,50
Ordentlicher Ertragsausgleich	5.901,73
Erträge insgesamt	33.717,00
Aufwendungen	
Performance-abhängige Anlageberatervergütung	-856.538,81
Verwaltungsvergütung	-586.405,30
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-32.381,13
Verwahrstellenvergütung	-52.468,29
Prüfungskosten	-9.212,69
Taxe d'abonnement	-11.463,85
Veröffentlichungskosten	-2.321,29
Register- und Transferstellenvergütung	-2.489,72
Gründungskosten	-232,53
Zinsaufwendungen	-54.600,83
Sonstige Aufwendungen	-69.064,63
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-390.211,70
Aufwendungen insgesamt	-2.067.390,77
Ordentlicher Nettoertrag	-2.033.673,77
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	9.403.881,19
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	1.652.945,02
Realisierte Verluste	-2.923.812,55
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-462.212,39
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	7.670.801,27
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	5.637.127,50
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	6.015.345,99
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-1.210.521,53
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	4.804.824,46
Ergebnis des Berichtszeitraumes	10.441.951,96

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Vermögensentwicklung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

	EUR
Nettoteilfondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	138.261.326,35
Ausschüttungen	-612.512,56
Mittelzuflüsse*)	49.755.311,32
Mittelabflüsse	-3.259.281,85
Mittelzufluss/-abfluss netto	46.496.029,47
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-806.422,66
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	10.441.951,96
Nettoteilfondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	193.780.372,56

Entwicklung im Jahresvergleich

Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2021	113.153,725	EUR	130.713.244,25	1.155,18
30.09.2020	111.092,678	EUR	120.572.285,94	1.085,33
30.09.2019	29.543,982	EUR	29.698.532,80	1.005,23

Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2 EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2021	745.577,773	EUR	44.642.198,10	59,88
30.09.2020	193.300,516	EUR	11.158.343,91	57,73
30.09.2019	39.424,432	EUR	2.072.409,76	52,57

Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2021	320.470,106	EUR	18.424.930,21	57,49
30.09.2020	118.148,787	EUR	6.530.696,50	55,28
30.09.2019	67.903,000	EUR	3.479.323,44	51,24

Da der Fonds Assenagon I zum 31. März 2021 aus nur einem Teilfonds, dem Assenagon I – Multi Asset Conservative besteht, entsprechen die Zusammensetzung des Nettofondsvermögens, die Vermögensaufstellung, die Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie die Vermögensentwicklung des Teilfonds gleichzeitig den zusammengefassten Aufstellungen des Fonds Assenagon I.

Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht

Allgemein

Der Assenagon I (der "Fonds") ist am 16. November 2015 als ein "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" gemäß Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 gegründet worden und erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

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

Gegenwärtig ist nur der Teilfonds Assenagon I Multi Asset Conservative aufgelegt.

Anteile der Anteilklassen I und P2 des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative werden seit dem 16. November 2015 zum Kauf angeboten, die Anteilsklasse R seit dem 13. Dezember 2017.

Der Fonds und sein Teilfonds bilanzieren in Euro. Der Halbjahresbericht wurde auf der Basis der letzten Nettoinventarwertberechnung zum 31. März 2021 aufgestellt.

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften unter der Annahme der Unternehmensfortführung erstellt.

Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze

Die Erstellung des Jahresabschlusses erfolgt in Übereinstimmung mit den luxemburgischen Vorschriften in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

1. Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird nachfolgenden Grundsätzen berechnet:
 - a) Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
 - b) Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.
 - c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfbar bewerteten Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Wirtschaftsprüfer nachvollziehbaren, Weise.
 - d) Falls die unter Buchstaben 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 Wirtschaftsprüfern 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 des Verwaltungsrates 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 Teilfonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein 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 Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich errechenbaren Verkehrswertes 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 Verkehrswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.
2. Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Teilfonds für angebracht hält.
 3. 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.
 4. Das jeweilige Nettoteilfondsvermögen wird gegebenenfalls um Ausschüttungen reduziert, die an die Anleger des Teilfonds gezahlt werden.
 5. Für die jeweiligen Anteilsklassen erfolgt die daraus resultierende Anteilswertberechnung nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilsklasse getrennt. Die Zusammenstellung und Zuordnung der Aktiva erfolgt jedoch immer für den gesamten Teilfonds.
 6. Auf die ordentlichen und außerordentlichen Erträge kann ein Ertragsausgleich gerechnet werden.

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.

Kosten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Für die Anteilsklasse I

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,7 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse P2

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,1 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse R

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,7 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Verwahrstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,04 % p. a., mindestens jedoch EUR 10.000 p. a. zu erhalten. Zusätzliche fixe und transaktionsabhängige Gebühren werden von der Verwahrstelle ent-

sprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet. Die Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Ende des Kalenderquartals auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zusätzlich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Zentralverwaltung ist berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,04 % p. a., mindestens jedoch EUR 20.000 p. a. zu erhalten. Die weiteren Gebühren bestimmen sich nach dem gesonderten Leistungsverzeichnis der Zentralverwaltung. Die Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Ende des Kalenderquartals auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zusätzlich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

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

Zudem können dem Teilfonds sonstige Kosten gemäß Art. 13 des Verwaltungsreglements belastet werden.

Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Der Teilfonds hat im Berichtszeitraum Geschäfte über Derivate mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

- European Depository Bank S.A.

Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei der Zahl- und Informationsstelle eine kostenfreie Aufstellung mit detaillierten Angaben über sämtliche während des Berichtszeitraums getätigten Käufe und Verkäufe erhältlich.

Ertragsverwendung

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Die ordentlichen Nettoerträge der Anteilsklasse I des Teilfonds wurden thesauriert. Die ordentlichen Nettoerträge der Anteilsklasse P2 und R werden ausgeschüttet. Im Berichtszeitraum fanden folgende Ausschüttungen statt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Ex-Tag	Ausschüttung je Anteil	
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P2 EUR	19.11.2020	EUR	1,35
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	19.11.2020	EUR	1,28

Besteuerung (Taxe d'abonnement)

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Der Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) in Höhe von 0,01 % p. a. für die Anteilsklasse I und 0,05 % p. a. für die Anteilsklasse P2 und R, welche vierteljährlich auf der Grundlage des Gesamtnettovermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird.

Die Einkünfte des Fonds werden im Großherzogtum Luxemburg nicht mit Einkommen- oder Körperschaftsteuern belastet. Sie können jedoch etwaigen Quellensteuern oder anderen Steuern in Ländern unterliegen, in denen das Fondsvermögen investiert ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch die Verwahrstelle werden Bescheinigungen über solche Steuern für einzelne oder alle Anteilsinhaber einholen.

Anleger können hinsichtlich der Zins- und Kapitalerträge einer individuellen Besteuerung unterliegen. Interessenten sollten sich über Gesetze und Verordnungen, die auf den Kauf, den Besitz und die Rücknahme von Anteilen Anwendung finden, informieren und sich gegebenenfalls beraten lassen.

Detaillierte Informationen bezüglich der Besteuerung von Fondsvermögen in Luxemburg können dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds

Auf Anfrage ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft eine kostenfreie Aufstellung über die Verwaltungsgebühren der im Berichtszeitraum im Bestand gehaltenen Zielfonds, welche nicht von der KAG verwaltet wurden, erhältlich.

Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraumes

Die Ausbreitung des Coronavirus im ersten Quartal 2020 hat die Welt grundlegend verändert. Zahlreiche Staaten reagierten mit restriktiven Maßnahmen wie Kontaktsperren und Unternehmungsschließungen, um die Pandemie einzudämmen. Weite Teile der Wirtschaft sind von den Einschränkungen betroffen und müssen mit deutlichen Umsatzeinbußen und beeinträchtigten Wertschöpfungsketten zurechtkommen. Insbesondere Sektoren wie Tourismus, Transport und Gastgewerbe leiden unter den Restriktionen. Der Rückgang der Produktion führt zu Entlassungen und Kurzarbeit, verbunden mit Einkommensausfällen, die sich wiederum negativ auf die Nachfrage auswirken werden.

An den Finanzmärkten kam es Ende Februar zu einer deutlichen Verschärfung der Finanzierungsbedingungen. Aktienmärkte verzeichneten dramatische Verluste, Spreads liefen auseinander und Renditen von Staatsanleihen stiegen vor allem bei langen Laufzeiten spürbar an. Um die Auswirkungen des Shutdowns abzufedern, die Refinanzierungsbedingungen zu verbessern und ein Übergreifen der Krise auf den Finanzsektor zu verhindern, wurden zahlreiche fiskal- und geldpolitische Maßnahmen ergriffen, die in ihrem Umfang deutlich über dem Niveau der Finanzkrise von 2008 liegen. In Folge kam es zu starken Preissteigerungen über alle Asset-Klassen hinweg. Auch bei einer schnellen Lockerung der Corona-Beschränkungen werden die negativen Folgen für die Weltwirtschaft massiv ausfallen und bis in das Jahr 2021 spürbar sein. Die Unsicherheit bei Haushalten und Firmen wird weiterhin hoch bleiben und Konsum und Investitionen hemmen. Das entschlossene Handeln der Zentralbanken und Staaten und die Bereitschaft zu weiteren Maßnahmen geben aber Anlass zur Hoffnung, dass die wirtschaftlichen Auswirkungen der Pandemie zumindest begrenzt werden können und eine rasche Erholung der Konjunktur in der zweiten Jahreshälfte möglich ist. Ob es dazu kommt, ist aber in erster Linie von der Entwicklung der Neuansteckungen bei Lockerung der Restriktionen abhängig, die zum gegenwärtigen Zeitpunkt nicht abschätzbar ist.

Mit Wirkung zum 1. Dezember 2020 fand der Funktionsübertrag der Zentralverwaltungsstellenfunktion von der LRI Invest S.A. zur Apex Fund Services S.A. statt.

Zum 1. Februar 2021 wurde Dr. Immo Querner in den Verwaltungsrat der Assenagon Asset Management S.A. berufen. Am 17. März 2021 ist Michael Hünseler als Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft zurückgetreten.

Wichtige Ereignisse nach dem Berichtszeitraumes

Unbeeindruckt von den Auswirkungen der 3. COVID-Welle stiegen die Aktienkurse auf neue Höchststände. Wirksame Impfstoffe, die fortschreitende Impfung der Bevölkerung und allmählich sinkende Infektionszahlen seit Ende April verbreiten allmählichen Optimismus auf ein Erstarren der Wirtschaft.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und deren Weiterverwendung

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 Reporting-Verpflichtungen (die aber für WFG grundsätzlich nicht anwendbar sind) zusätzliche Meldepflichten begründet.

Der Assenagon I – Multi Asset Conservative unterhielt keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte oder Gesamttrendite-Swaps im abgelaufenen Berichtszeitraum. Die zusätzlichen Meldepflichten aus oben genannter Regulierung finden daher keine Anwendung.

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Allgemein

Assenagon I 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
CH-1204 Genf

Zahlstelle in der Schweiz ist:
Banque Cantonale de Genève
17, Quai de l'Île
CH-1204 Genf

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 Vertretern bezogen werden. Die Veröffentlichungen der Anteilspreise 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. Die zusammengesetzte (synthetische) TER wird ausgewiesen, sofern der Gesamtanteil der Zielfonds größer gleich 10 % des Nettofondsvermögens ist und entspricht der Summe der TER des Dachfonds, abzüglich der in der Berichtsperiode vereinnahmten Rückvergütungen von Zielfonds, der anteilmäßigen TER der einzelnen Zielfonds, gewichtet nach deren Anteil am Nettovermögen des Dachfonds per Stichtag, sowie der effektiv bezahlten Ausgabe- und Rücknahmekommissionen der Zielfonds.

Assenagon I	Anteils- klasse	Total Expense Ratio*)	Synthetische Total Expense Ratio
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	0,86 %	1,37 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P2 EUR	1,35 %	1,86 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	0,94 %	1,45 %

*) Die Total Expense Ratio wird im Jahresbericht inklusive der erfolgsabhängigen Kommission für das abgelaufene Geschäftsjahr ausgewiesen.

Die Total Expense Ratio im Halbjahresbericht setzt sich aus den Daten des Berichtshalbjahres und dem 2. Halbjahr des vorangegangenen Geschäftsjahres zusammen. (ohne Berücksichtigung von erfolgsabhängigen Kommissionen).

Die Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio entspricht der SFAMA-Richtlinie vom 16. Mai 2008 (Stand: 20. April 2015).

assenagon

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

Telefon +352 27049-100
Telefax +352 27049-111

www.assenagon.com
© 2021