

Jahres-  
bericht

## Assenagon Alpha

### Jahresbericht, inklusive geprüftem Jahresabschluss, zum 31. Dezember 2022

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



## Inhalt

### **Verwaltung und Administration**

#### **Bericht der Verwaltungsgesellschaft**

#### **Bericht des *Réviseur d'entreprises agréé***

#### **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 Jahresabschluss**

#### **Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)**

#### **Risikomanagementverfahren (ungeprüft)**

#### **Angaben zur Mitarbeitervergütung (ungeprüft)**

#### **Sonstige Angaben (ungeprüft)**

## Wichtige Hinweise

Auf der alleinigen Grundlage dieses Jahresberichts 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](http://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](http://www.fundinfo.com) abgerufen werden.

## Verwaltung und Administration

### **Verwaltungsgesellschaft**

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

### **Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft**

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

### **Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft**

Holger Herber (bis 30. April 2022)  
Dr. Stephan Höcht (seit 18. Februar 2022)  
Matthias Kunze  
Jens Meiser (seit 20. Dezember 2022)  
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

## Bericht der Verwaltungsgesellschaft

### Kapitalmarktumfeld

Die globale Konjunktur hat in der Beobachtungszeitraum von Ende Dezember 2021 bis Ende Dezember 2022 an Dynamik verloren. Nachdem sich die Weltwirtschaft mit einem Zuwachs von 6,2 % im Jahr 2021 von der Corona-Pandemie kräftig erholen konnte, rechnet der Internationale Währungsfonds (IWF) für das Jahr 2022 mit einem Rückgang der Wachstumsrate auf 3,4 %. Für diese Verringerung gibt es vielschichtige Faktoren. Der Angriffskrieg Russlands auf die Ukraine, der im ersten Quartal des Jahres begann und noch immer anhält, sorgte für gravierende Übertragungseffekte, besonders in Europa. Gegenseitig verhängte Zölle trieben Rohstoffpreise und somit die Produktions- und Lebenshaltungskosten vieler Unternehmen und Privatpersonen in die Höhe. Hinzu kamen zunehmend restriktive geldpolitische Maßnahmen infolge weltweit gestiegener Inflationszahlen sowie die Null-Covid-Strategie Chinas im Zuge der Corona-Pandemie, die erst im Dezember vergangenen Jahres gelockert wurde und globale Lieferkettenstörungen nach sich zog.

Der Konjunkturabschwung war für einzelne Länder unterschiedlich stark ausgeprägt. Das Wirtschaftswachstum der USA dürfte sich von 5,9 % im Jahr 2021 auf 2 % im Jahr 2022 reduzieren. Ursächlich dafür sind der unerwartet hohe Rückgang des realen Bruttoinlandsprodukts im zweiten Quartal, der Rückgang der Reallöhne mit einhergehender geringerer Konsumentennachfrage und gestiegene Zinsen, die die Refinanzierung der Unternehmen verteuerten. Für die Eurozone erwartet der IWF einen Rückgang des Wirtschaftswachstums von 5,3 % im Jahr 2021 auf 3,5 %, wobei die Entwicklungen in den einzelnen Mitgliedsstaaten stark variieren dürften. Während in Italien und Spanien aufgrund der Erholung des Tourismus und der industriellen Produktion die Schätzungen für 2022 bei vergleichsweise hohen 3,9 % und 5,2 % liegen, wird für Deutschland mit einem Wirtschaftswachstum von nur 1,9 % gerechnet. Dies war in erster Linie auf die hohe Abhängigkeit von russischem Gas einhergehend mit steigenden Energiekosten zurückzuführen. In Großbritannien, China und anderen Schwellenländern dürfte der Konjunkturerinbruch ähnlich signifikant wie in den USA und der Eurozone ausfallen, während sich das Wachstum in Japan nur leicht unter dem Niveau des Jahres 2021 einpendeln dürfte.

Im Zuge der Konjunkturerholung im vergangenen Jahr kehrten im letzten Quartal 2021 hohe Inflationsraten zurück. Bereits im Dezember 2021 lagen die Inflationsraten in den USA bei 7 % und in Europa bei 5 %. Zunächst wurde von den Zentralbanken, mit Verweis auf Basiseffekte und Normalisierung der Lieferketten, angenommen, dass die Inflation nur vorübergehend sei. Allerdings stiegen die Preise im Laufe des Jahres weiter an. In Deutschland lagen die Inflationsraten seit Februar 2022 stets über 5 %. Die Inflation erreichte Ende des dritten Quartales 2022 sogar die 10 % - Marke. Ähnlich hohe Zahlen galten für die gesamte Eurozone, Großbritannien sowie die Mehrheit der Schwellenländer. Faktoren für den globalen Anstieg der Inflationsraten waren die gestiegenen Preise fossiler Energie und von Lebensmitteln infolge des Russland-Ukraine-Krieges. Zudem hatte die Null-Covid-Politik Chinas wochenlange Schließungen chinesischer Häfen zur Folge, wodurch sich die Transportkosten vieler Unternehmen erhöhten. Weitere preistreibende Faktoren waren im Jahr 2022 auch der Wandel zur klimaneutralen Wirtschaft sowie die Knappheit bestimmter Produktionsinputs wie z.B. Computerchips oder seltener Erden. Gegen Ende des Jahres ließ der Inflationsdruck in den meisten Ländern aufgrund geringerer Rohstoffpreise infolge schwächerer Nachfrage nach. Zudem zeigte die geldpolitische Straffung zahlreicher Zentralbanken erste Erfolge.

Auf Grund der hohen Inflationsraten gingen die Zentralbanken der USA und der Eurozone dazu über, eine geldpolitische Wende durch Bilanzverkürzungen und Zinserhöhungen einzuleiten. Die Federal Reserve erhöhte im März 2022 erstmals ihren Leitzins seit 2018. Nach mehreren Zinserhöhungen lag der Leitzins in den USA im Dezember 2022 im Intervall von 4,25 % bis 4,5 %. Die EZB handelte weniger entschlossen, folgte jedoch - nach immer höheren Inflationszahlen - mit vier Zinsschritten. Ende Dezember 2022 lag der Hauptrefinanzierungssatz der EZB bei 2,5 %. Die Zentralbanken der Schwellenländer schlossen sich größtenteils dem geldpolitischen Handeln der USA an oder nahmen Zinserhöhungen sogar vorweg, um einer Währungsabwertung gegenüber dem US-Dollar zuvorzukommen. Als große Ausnahme zeigte sich die Bank of Japan, die den Leitzins unverändert niedrig an der Nullzinsgrenze beließ. Die entschlossenen Leitzinserhöhungen der FED hatten eine starke Aufwertung des US-Dollars zur Folge. Der Euro verlor im Beobachtungszeitraum in Spitze mehr als 15 % gegenüber dem US-Dollar und fiel erstmals seit 2002 wieder unter Parität zum US-Dollar. Im vierten Quartal konnte sich der Euro aufgrund sinkender Zinserwartungen in den USA wieder etwas erholen und schloss das Jahr mit einem Minus von 6 % ab. Der japanische Yen und das britische Pfund sowie die Währungen vieler Schwellenländer wiesen ähnliche Entwicklungen auf.

An den Aktienmärkten sorgten die restriktiven Maßnahmen der Zentralbanken und geopolitische Spannungen global für Verunsicherungen und Kapitalflucht der Investoren. Die Volatilität war dementsprechend hoch. Im Beobachtungszeitraum verloren der MSCI All Country World Index 14,5 %, der MSCI Europe Index 11,9 % und der MSCI USA Index 15,6 % an Wert. Die Kapitalmärkte der Schwellenländer traf es besonders hart. Der MSCI Emerging Markets Index büßte 17,3 % an

Marktkapitalisierung ein. Grund hierfür waren insbesondere die Schwäche in China im Zuge der harten Corona-Maßnahmen, sowie der schwelende Konflikt zwischen China und Taiwan. An den Kreditmärkten stiegen die Zinsen auf 10-jährige Staatsanleihen in Industrie- und Schwellenländern infolge der globalen Zinserhöhungen sprunghaft an. In Deutschland lag die Rendite einer 10-jährigen Bundesanleihe erstmals seit 2016 wieder im positiven Bereich. Im Betrachtungszeitraum stiegen die Renditen amerikanische Staatsanleihen um rund 237 Basispunkte und in Deutschland um 276 Basispunkte an. Auch die Risikoaufschläge peripherer europäischer Staaten stiegen deutlich an. Die Spreads auf Unternehmensanleihen im Investment-Grade und High-Yield Bereich weiteten sich ebenfalls in den ersten drei Quartalen des Jahres kräftig aus, um sich im vierten Quartal wieder etwas einzuengen.

## Ausblick

Die Aussichten für das Jahr 2023 bieten nicht viel Platz für Optimismus. Die Volkswirtschaften und Kapitalmärkte stehen vor Herausforderungen, die noch lange nicht gelöst zu sein scheinen. Viele Länder stehen am Rande einer Rezession, geprägt durch hartnäckig-hohe Inflation, sinkendes Wachstum sowie weitere Straffung der Geldpolitik. Das Wirtschaftswachstum in der Eurozone wird vom IWF für das Jahr 2023 nur noch auf 0,7 % geschätzt, für die USA auf 1,4 % und für die Schwellenländer, die für gewöhnlich hohes Wachstumspotential aufweisen, nur noch auf 4 %. Die steigenden Schuldenkosten gefährden die Solvenz hochverschuldeter Staaten. Zugleich wächst auf diese der Druck, ihre Schulden weiter abzubauen. Hinzu kommen geopolitische Spannungen wie der Russland-Ukraine-Krieg oder der China-Taiwan-Konflikt, bei denen sich bislang keine Lösung abzeichnet. Die Lockerung der Null-Covid-Strategie in China gibt immerhin Anlass zur Hoffnung auf eine schneller als erwartete Erholung der globalen Konjunktur.

## Teilfondsentwicklung Alpha Volatility

Der Teilfonds Assenagon Alpha Volatility wurde am 25. Januar 2011 aufgelegt und umfasst derzeit die Anteilklassen (I), (I2 SPEZ), (I2 CHF) und (I GBP) für institutionelle Anleger und (P) und (R) für private Investoren. Der folgende Bericht bezieht sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022.

Zur Erreichung des Anlageziels setzte der Teilfonds auf das Handeln von Volatilitätspaaren. Im Speziellen verfolgt der Assenagon Alpha Volatility das Ziel im Rahmen eines selektiven Dispersionsansatzes günstige Volatilitäten auf Einzelaktien sowie (Branchen-)Indizes zu kaufen und ausgewählte Indexvolatilitäten zu verkaufen.

Infolge der praktischen Umsetzung der Volatilitätsstrategien kamen folgende Marktinstrumente zum Einsatz:

- Optionen auf Einzelaktien, Branchen- und Aktienindizes (börsennotiert sowie OTC)
- Optionen auf Volatilitätsindizes (börsennotiert)
- Futures auf Aktienindizes (börsennotiert)
- Volatility-Swaps auf Einzelaktien und Aktienindizes (OTC)
- Equity-Swaps auf Einzelaktien (OTC)

Der Teilfonds hat im Geschäftsjahr einen Ertrag in der I-Klasse von 5,94 %, in der I2 SPEZ-Klasse von 6,79 %, in der I CHF-Klasse von 4,82 %, in der I GBP-Klasse von 7,79 %, in der P-Klasse von 5,13 % und in der R-Klasse von 5,92 % erzielt (berechnet nach BVI-Methode).

Die Schwankungsbreite der I-Klasse lag bei 10,83 % p.a., der I2 SPEZ Klasse bei 11,12 % p.a., der I2 CHF Klasse bei 10,15 % p.a., der I GBP Klasse bei 10,56 % p.a., der P Klasse bei 10,98 % p.a. und der R Klasse bei 11,11 % p.a.

## Ausblick

Der Assenagon Alpha Volatility wird für das kommende Geschäftsjahr seine Anlagestrategie beibehalten. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt. Die in diesem Bericht enthaltenen Angaben und Zahlen sind vergangenheitsbezogen und geben keinen Hinweis auf die zukünftige Entwicklung.

## Teilfondsentwicklung Alpha Premium

Der Teilfonds Assenagon Alpha Premium wurde am 10. Dezember 2019 aufgelegt und umfasst derzeit die Anteilklassen (I), (IS) und (I2R) für institutionelle Anleger und (P), (R) und (RS) für private Investoren. Der folgende Bericht bezieht sich auf den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022.

Zur Erreichung des Anlageziels nutzt der Teilfonds Volatilität als Renditequelle. Das Portfolio Management nutzt hierfür vorwiegend relative Preisdifferenzen zwischen Aktienindexvolatilitäten und der Volatilitäten der einzelnen Aktien im Index.

Im Speziellen verfolgt der Assenagon Alpha Premium das Ziel im Rahmen eines Dispersionsansatzes günstige Volatilitäten auf Einzelaktien sowie (Branchen-)Indizes zu kaufen und gleichzeitig Indexvolatilitäten zu verkaufen.

Der Teilfonds hat im Geschäftsjahr einen Ertrag in der I-Klasse von 3,93 %, der IS-Klasse von 4,09 %, der I2R-Klasse von 4,06 %, der P-Klasse von 3,31 %, der R-Klasse von 3,88 % und der RS-Klasse von 4,07 % (berechnet nach BVI-Methode).

Die Schwankungsbreite der I-Klasse lag bei 7,64 % p.a., der IS-Klasse von 7,67 % p.a., der I2R-Klasse von 7,9 % p.a., der P-Klasse von 7,75 % p.a., der R-Klasse von 7,65 % p.a. und der RS-Klasse von 7,62 % p.a.

## **Ausblick**

Der Assenagon Alpha Premium wird für das kommende Geschäftsjahr seine Anlagestrategie beibehalten. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt. Die in diesem Bericht enthaltenen Angaben und Zahlen sind vergangenheitsbezogen und geben keinen Hinweis auf die zukünftige Entwicklung.

Angaben zur Fondspersormance sind vergangenheitsbezogen und geben keinen Aufschluss über die zukünftige Wertentwicklung.



An die Anteilhaber des  
Assenagon Alpha  
1B, Heienhaff  
L-1736 Senningerberg  
Luxemburg

Tel: +352 451 451  
www.deloitte.lu

## BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresabschluss des Assenagon Alpha (der "Fonds") und eines jeden seiner Teilfonds – bestehend aus der Zusammensetzung des Nettofondsvermögens und des Wertpapierbestands und sonstige Vermögensgegenstände zum 31. Dezember 2022, der Aufwands- und Ertragsrechnung sowie Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie den Erläuterungen zum Jahresabschluss, mit einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden - geprüft.

Nach unserer Beurteilung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Assenagon Alpha und eines jeden seiner Teilfonds zum 31. Dezember 2022 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir führten unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und nach den für Luxemburg von der „*Commission de Surveillance du Secteur Financier*“ (CSSF) angenommenen internationalen Prüfungsstandards (ISA) durch. Unsere Verantwortung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den ISA-Standards, wie sie in Luxemburg von der CSSF angenommen wurden, wird im Abschnitt „Verantwortung des *“réviseur d’entreprises agréé”* für die Jahresabschlussprüfung“ weitergehend beschrieben. Wir sind unabhängig von dem Fonds in Übereinstimmung mit dem „*International Code of Ethics for Professional Accountants, including International Independence Standards*“, herausgegeben vom „*International Ethics Standards Board for Accountants*“ (IESBA Code) und für Luxemburg von der CSSF angenommen, zusammen mit den beruflichen Verhaltensanforderungen, welche wir im Rahmen der Jahresabschlussprüfung einzuhalten haben und haben alle sonstigen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Verhaltensanforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

### Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen beinhalten die Informationen, welche im Jahresbericht enthalten sind, jedoch beinhalten sie nicht den Jahresabschluss oder unseren Bericht des „*réviseur d’entreprises agréé*“ zu diesem Jahresabschluss.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben keinerlei Sicherheit jedweder Art auf diese Informationen.

Im Zusammenhang mit der Prüfung des Jahresabschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen diesen und dem Jahresabschluss oder mit den bei der Abschlussprüfung gewonnen Erkenntnissen besteht oder auch ansonsten die sonstigen Informationen wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Sollten wir auf Basis der von uns durchgeführten Arbeiten schlussfolgern, dass sonstige Informationen wesentliche falsche Darstellungen enthalten, sind wir verpflichtet, diesen Sachverhalt zu berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

## **Verantwortung des Verwaltungsrates der Verwaltungsgesellschaft des Fonds für den Jahresabschluss**

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung und Darstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist.

Bei der Aufstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit und - sofern einschlägig - Angaben zu Sachverhalten zu machen, die im Zusammenhang mit der Fortführung der Unternehmenstätigkeit stehen, und die Annahme der Unternehmensfortführung als Rechnungslegungsgrundsatz zu nutzen, sofern nicht der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, die Geschäftstätigkeit einzustellen oder keine andere realistische Alternative mehr hat, als so zu handeln.

## **Verantwortung des *“réviseur d’entreprises agréé”* für die Jahresabschlussprüfung**

Die Zielsetzung unserer Prüfung ist es, eine hinreichende Sicherheit zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen - beabsichtigten oder unbeabsichtigten - falschen Darstellungen ist und darüber einen Bericht des *“réviseur d’entreprises agréé”*, welcher unser Prüfungsurteil enthält, zu erteilen. Hinreichende Sicherheit entspricht einem hohen Grad an Sicherheit, ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs stets eine wesentlich falsche Darstellung, falls vorhanden, aufdeckt. Falsche Darstellungen können entweder aus Unrichtigkeiten oder aus Verstößen resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise davon ausgegangen werden kann, dass diese individuell oder insgesamt, die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und nach den für Luxemburg von der CSSF angenommenen ISAs üben wir unser pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus:

- Identifizieren und beurteilen wir das Risiko von wesentlichen falschen Darstellungen im Jahresabschluss aus Unrichtigkeiten oder Verstößen, planen und führen Prüfungshandlungen durch als Antwort auf diese Risiken und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und angemessen sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist bei Verstößen höher als bei Unrichtigkeiten, da Verstöße betrügerisches Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Angaben bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der von dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds angewandten Bilanzierungsmethoden, der rechnungslegungsrelevanten Schätzungen und der entsprechenden Erläuterungen.
- Schlussfolgern wir über die Angemessenheit der Anwendung des Rechnungslegungsgrundsatzes der Fortführung der Unternehmenstätigkeit durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft des Fonds sowie auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen könnten. Sollten wir schlussfolgern, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „*réviseur d'entreprises agréé*“ auf die dazugehörigen Erläuterungen zum Jahresabschluss hinzuweisen oder, falls die Angaben unangemessen sind, das Prüfungsurteil zu modifizieren. Diese Schlussfolgerungen basieren auf der Grundlage der bis zum Datum des Berichts des „*réviseur d'entreprises agréé*“ erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass der Fonds seine Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Beurteilen wir die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Jahresabschlusses einschließlich der Erläuterungen, und beurteilen, ob dieser die zugrundeliegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse sachgerecht darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem den geplanten Prüfungsumfang und Zeitraum sowie wesentliche Prüfungsfeststellungen einschließlich wesentlicher Schwächen im internen Kontrollsystem, welche wir im Rahmen der Prüfung identifizieren.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Jan van Delden, *Réviseur d'entreprises agréé*

Partner

Luxemburg, den 25. April 2023

## Finanzaufstellung

### ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

#### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
<b>Deutschland</b>					
DE0001141794	Bundesschatzanweisungen 0 %, 05.04.2024	37.000.000	EUR	35.890.925,00	3,40
DE0001141802	Bundesschatzanweisungen 0 %, 18.10.2024	27.000.000	EUR	25.806.465,00	2,44
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	42.000.000	EUR	40.999.518,00	3,88
DE0001102333	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 15.02.2024	40.000.000	EUR	39.686.808,00	3,75
DE0001104834	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.03.2023	40.000.000	EUR	39.901.360,00	3,77
DE0001104859	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.09.2023	40.000.000	EUR	39.402.920,00	3,73
DE0001104867	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.12.2023	42.000.000	EUR	41.108.928,00	3,89
DE0001104842	Bundesschatzanweisungen 0 %, 16.06.2023	30.000.000	EUR	29.757.120,00	2,82
DE0001104883	Bundesschatzanweisungen 0,2 %, 14.06.2024	35.000.000	EUR	33.834.115,00	3,20
DE0001104909	Bundesschatzanweisungen 2,2 %, 12.12.2024	30.000.000	EUR	29.730.063,90	2,81
				<b>356.118.222,90</b>	<b>33,69</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>					
US91282CEX56	U.S. Treasury Note 3 %, 30.06.2024	20.000.000	USD	18.300.172,78	1,73
				<b>18.300.172,78</b>	<b>1,73</b>
<b>Summe Festverzinsliche Wertpapiere</b>				<b>374.418.395,68</b>	<b>35,42</b>

**Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind. 374.418.395,68 35,42**

#### Tagesgelder

Kontrahent	Zinssatz	Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
<b>Deutschland</b>				
	Bayerische Landesbank 1,40 %, Tagesgeld	EUR	30.000.000,00	2,84
	DekaBank 1,82 %, Tagesgeld	EUR	100.000.000,00	9,46
	DZ Bank AG 1,85 %, Tagesgeld	EUR	90.000.000,00	8,51
	Landesbank Baden Württemberg 1,70 %, Tagesgeld	EUR	120.000.000,00	11,35
<b>Summe Tagesgelder</b>			<b>340.000.000,00</b>	<b>32,16</b>

#### Optionen

##### Indexoptionen

Underlying	Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Mar 2023 (call, strike 14.072,00)	EUR	195.754,36	0,02
DAX Index	Mar 2023 (put, strike 14.072,00)	EUR	-238.515,60	-0,02
DAX Index	Mar 2023 (call, strike 14.513,00)	EUR	92.692,09	0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Mar 2023 (put, strike 14.513,00)	-377	EUR	-295.281,38	-0,03
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 12.500,00)	1.600	EUR	500.795,81	0,05
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.600	EUR	-500.795,81	-0,05
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 13.000,00)	2.000	EUR	828.958,44	0,08
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 13.000,00)	1.400	EUR	580.270,91	0,05
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 13.000,00)	1.200	EUR	497.375,07	0,05
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 13.000,00)	-2.000	EUR	-828.958,44	-0,08
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 13.000,00)	-2.600	EUR	-1.077.645,98	-0,10
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 14.000,00)	1.200	EUR	857.911,19	0,08
DAX Index	Jun 2023 (put, strike 14.000,00)	-1.200	EUR	-857.911,19	-0,08
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.500,00)	-1.100	EUR	-416.399,32	-0,04
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.500,00)	-1.600	EUR	-605.671,73	-0,06
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 11.800,00)	-800	EUR	-2.330.792,50	-0,22
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 11.800,00)	-800	EUR	-342.563,25	-0,03
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.000,00)	2.500	EUR	1.160.701,18	0,11
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.000,00)	-2.500	EUR	-1.160.701,18	-0,11
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.100,00)	-3.300	EUR	-1.595.088,25	-0,15
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.300,00)	-2.900	EUR	-1.518.129,94	-0,14
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.400,00)	-700	EUR	-1.713.443,10	-0,16
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.400,00)	-700	EUR	-381.210,56	-0,04
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-750	EUR	-1.779.423,98	-0,17
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-850	EUR	-2.016.680,52	-0,19
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 12.500,00)	-1.700	EUR	-4.033.361,03	-0,38
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	1.400	EUR	792.949,03	0,07
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	1.200	EUR	679.670,60	0,06
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	700	EUR	396.474,51	0,04
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-750	EUR	-424.794,12	-0,04
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-850	EUR	-481.433,34	-0,05
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.400	EUR	-792.949,03	-0,08
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.700	EUR	-962.866,68	-0,09
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.800	EUR	-1.019.505,90	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.800	EUR	-1.019.505,90	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.900	EUR	-1.076.145,11	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 12.500,00)	-1.900	EUR	-1.076.145,11	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	2.500	EUR	1.717.694,65	0,16
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	1.600	EUR	1.099.324,58	0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-1.600	EUR	-1.099.324,58	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-2.500	EUR	-1.717.694,65	-0,16
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.000,00)	-3.000	EUR	-2.061.233,58	-0,20
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	700	EUR	1.166.194,42	0,11
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	690	EUR	1.149.534,50	0,11
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	-690	EUR	-1.149.534,50	-0,11
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.500,00)	-700	EUR	-1.166.194,42	-0,11
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	1.100	EUR	912.978,99	0,09
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	700	EUR	580.986,63	0,05
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	690	EUR	572.686,82	0,05
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-690	EUR	-572.686,82	-0,05
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-700	EUR	-580.986,63	-0,05
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-1.300	EUR	-1.078.975,17	-0,10
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-1.600	EUR	-1.327.969,44	-0,13
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.500,00)	-2.200	EUR	-1.825.957,98	-0,17
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 13.800,00)	-1.700	EUR	-2.504.492,82	-0,24
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 13.800,00)	-1.700	EUR	-1.578.056,52	-0,15
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-600	EUR	-810.307,58	-0,08
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-650	EUR	-877.833,21	-0,08
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.000,00)	-1.300	EUR	-1.755.666,41	-0,17

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	1.500	EUR	1.499.373,75	0,14
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-600	EUR	-599.749,50	-0,06
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-650	EUR	-649.728,62	-0,06
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-1.300	EUR	-1.299.457,25	-0,12
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.000,00)	-1.500	EUR	-1.499.373,75	-0,14
DAX Index	Dez 2023 (call, strike 14.200,00)	-1.100	EUR	-1.355.891,20	-0,13
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.200,00)	-1.100	EUR	-1.183.303,70	-0,11
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	-1.000	EUR	-1.199.555,52	-0,11
DAX Index	Dez 2023 (put, strike 14.500,00)	-1.800	EUR	-2.159.199,93	-0,20
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 11.000,00)	-1.900	EUR	-875.492,99	-0,08
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 11.700,00)	-1.200	EUR	-701.741,18	-0,07
DAX Index	Jun 2024 (put, strike 12.000,00)	-1.200	EUR	-774.407,67	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (call, strike 3.801,00)	430	EUR	57.747,94	0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (put, strike 3.801,00)	-430	EUR	-59.718,14	-0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (call, strike 3.823,00)	670	EUR	81.899,69	0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (put, strike 3.823,00)	-670	EUR	-99.645,05	-0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (call, strike 3.935,00)	418	EUR	29.419,89	0,00
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (put, strike 3.935,00)	-418	EUR	-87.102,02	-0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (call, strike 3.946,00)	-2.100	EUR	-139.043,35	-0,01
Euro Stoxx 50® Index	Mar 2023 (put, strike 3.946,00)	2.100	EUR	451.832,92	0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.100,00)	7.000	EUR	354.421,35	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.100,00)	-7.000	EUR	-354.421,35	-0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (call, strike 3.200,00)	3.000	EUR	1.785.545,20	0,17
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (call, strike 3.200,00)	-3.000	EUR	-1.785.545,20	-0,17
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.200,00)	8.500	EUR	538.233,72	0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.200,00)	3.000	EUR	189.964,84	0,02
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.200,00)	-3.000	EUR	-189.964,84	-0,02
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.200,00)	-8.500	EUR	-538.233,72	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.300,00)	9.000	EUR	711.396,80	0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.300,00)	-9.000	EUR	-711.396,80	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.400,00)	11.000	EUR	1.086.229,11	0,10
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.400,00)	9.500	EUR	938.106,96	0,09
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.400,00)	-4.500	EUR	-444.366,45	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.400,00)	-6.500	EUR	-641.862,66	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.400,00)	-9.500	EUR	-938.106,96	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (call, strike 3.500,00)	-25.000	EUR	-8.957.337,68	-0,85
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	25.000	EUR	3.071.865,38	0,29
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	5.700	EUR	700.385,31	0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	-5.700	EUR	-700.385,31	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.600,00)	4.500	EUR	685.590,22	0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.500	EUR	-685.590,22	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	4.400	EUR	826.752,95	0,08
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	2.900	EUR	544.905,35	0,05
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	1.500	EUR	281.847,60	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	-8.800	EUR	-1.653.505,90	-0,16
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	5.500	EUR	1.267.970,23	0,12
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.500	EUR	-1.267.970,23	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 75,00)	12.500	EUR	2.282.871,88	0,22
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 80,00)	6.000	EUR	1.438.002,00	0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 85,00)	6.000	EUR	1.879.036,50	0,18
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 90,00)	6.000	EUR	2.427.695,10	0,23
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	5.200	EUR	486.362,44	0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	-5.200	EUR	-486.362,44	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.000,00)	-14.000	EUR	-1.309.437,33	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-3.000	EUR	-328.664,44	-0,03
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-6.000	EUR	-657.328,88	-0,06

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.100,00)	-12.000	EUR	-1.314.657,76	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	2.600	EUR	1.793.558,61	0,17
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-1.379.660,47	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	-2.600	EUR	-1.793.558,61	-0,17
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.200,00)	-5.000	EUR	-3.449.151,18	-0,33
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	15.000	EUR	1.918.955,40	0,18
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	2.600	EUR	332.618,94	0,03
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	1.500	EUR	191.895,54	0,02
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-2.000	EUR	-255.860,72	-0,02
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-2.600	EUR	-332.618,94	-0,03
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-5.000	EUR	-639.651,80	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-6.500	EUR	-831.547,34	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-6.500	EUR	-831.547,34	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.200,00)	-10.000	EUR	-1.279.303,60	-0,12
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.300,00)	3.000	EUR	1.841.345,61	0,17
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-1.841.345,61	-0,17
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	4.500	EUR	670.041,89	0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	4.500	EUR	670.041,89	0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	3.000	EUR	446.694,59	0,04
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-3.000	EUR	-446.694,59	-0,04
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-5.000	EUR	-744.490,99	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-9.000	EUR	-1.340.083,77	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.300,00)	-9.000	EUR	-1.340.083,77	-0,13
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.400,00)	-2.900	EUR	-1.568.217,26	-0,15
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	5.700	EUR	985.513,47	0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	-2.900	EUR	-501.401,59	-0,05
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	-5.700	EUR	-985.513,47	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.000	EUR	-200.162,03	-0,02
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-4.300	EUR	-860.696,71	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-6.000	EUR	-1.200.972,16	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	4.800	EUR	1.109.717,18	0,10
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.800	EUR	-1.109.717,18	-0,10
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-2.500	EUR	-857.693,85	-0,08
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.500	EUR	-1.200.771,39	-0,11
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	5.700	EUR	1.517.674,44	0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-2.500	EUR	-665.646,68	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.500	EUR	-931.905,36	-0,09
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.700	EUR	-1.517.674,44	-0,14
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.000	EUR	-1.597.552,04	-0,15
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.800	EUR	-1.810.558,98	-0,17
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-14.000	EUR	-3.727.621,42	-0,35
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.200	EUR	-629.170,96	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.300	EUR	-657.769,64	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.200	EUR	-673.605,09	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.300	EUR	-704.223,51	-0,07
Euro Stoxx 50® Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.200	EUR	-1.592.157,49	-0,15
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2024 (put, strike 70,00)	6.000	EUR	1.336.668,30	0,13
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2024 (put, strike 3.000,00)	-4.500	EUR	-638.529,75	-0,06
Euro Stoxx 50® Index	Jun 2024 (put, strike 3.600,00)	-8.000	EUR	-2.381.175,70	-0,23
Euro Stoxx Banks Index EUR	Mar 2023 (call, strike 95,40)	-31.500	EUR	-152.606,70	-0,01
Euro Stoxx Banks Index EUR	Mar 2023 (put, strike 95,40)	31.500	EUR	126.261,01	0,01
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 80,00)	120.000	EUR	2.175.528,96	0,21
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 80,00)	120.000	EUR	575.200,80	0,05
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (call, strike 90,00)	150.000	EUR	1.759.014,75	0,17
Euro Stoxx Banks Index EUR	Dez 2023 (put, strike 90,00)	150.000	EUR	1.213.847,55	0,11
FTSE 100 Index	Jun 2023 (put, strike 6.200,00)	2.800	GBP	184.721,73	0,02

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
FTSE 100 Index	Jun 2023 (put, strike 6.200,00)	-2.800	GBP	-184.721,73	-0,02
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.824,00)	464	USD	76.205,04	0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.824,00)	-464	USD	-59.621,93	-0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.838,00)	-1.855	USD	-290.397,86	-0,03
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.838,00)	1.855	USD	248.328,81	0,02
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.851,00)	-2.117	USD	-316.629,29	-0,03
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.851,00)	2.117	USD	294.293,00	0,03
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.852,00)	-1.925	USD	-286.884,24	-0,03
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.852,00)	1.925	USD	268.369,57	0,03
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.859,00)	775	USD	112.620,43	0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.859,00)	-775	USD	-110.227,50	-0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.861,00)	600	USD	86.558,37	0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.861,00)	-600	USD	-85.825,27	-0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (call, strike 3.959,00)	552	USD	53.817,86	0,01
S&P 500 Index	Mar 2023 (put, strike 3.959,00)	-552	USD	-103.610,05	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	9.400	USD	928.889,58	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	5.000	USD	494.090,20	0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-494.090,20	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.500,00)	-9.400	USD	-928.889,58	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.600,00)	8.000	USD	981.702,03	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.600,00)	-8.000	USD	-981.702,03	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.700,00)	3.000	USD	986.072,68	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.700,00)	2.700	USD	887.465,42	0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.700,00)	-2.700	USD	-887.465,42	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-986.072,68	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	5.700	USD	859.235,25	0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	3.000	USD	452.229,07	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	2.700	USD	407.006,17	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	-2.700	USD	-407.006,17	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.000	USD	-452.229,07	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.700	USD	-859.235,25	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.800,00)	3.500	USD	943.028,31	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-943.028,31	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	8.620	USD	1.578.637,25	0,15
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	5.900	USD	1.080.505,78	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	5.000	USD	915.682,86	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	3.500	USD	640.978,00	0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-640.978,00	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-915.682,86	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.900	USD	-1.080.505,78	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.800,00)	-8.620	USD	-1.578.637,25	-0,15
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.900,00)	4.000	USD	860.149,87	0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.000	USD	-860.149,87	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	9.000	USD	1.983.466,49	0,19
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	8.500	USD	1.873.273,91	0,18
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	4.000	USD	881.540,66	0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.000	USD	-881.540,66	-0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	-8.500	USD	-1.873.273,91	-0,18
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 3.900,00)	-9.000	USD	-1.983.466,49	-0,19
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	6.300	USD	1.046.081,25	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	3.500	USD	581.156,24	0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	2.700	USD	448.320,53	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	2.500	USD	415.111,60	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-300	USD	-49.813,39	0,00
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-700	USD	-116.231,25	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-1.600	USD	-265.671,43	-0,03

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.  
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfonds- vermogen (%)
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-2.200	USD	-365.298,22	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-415.111,60	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-597.760,71	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.000,00)	-4.100	USD	-680.783,03	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	9.300	USD	2.446.273,15	0,23
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	6.300	USD	1.657.152,78	0,16
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	4.200	USD	1.104.768,52	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	3.500	USD	920.640,43	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	2.700	USD	710.208,33	0,07
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	2.500	USD	657.600,31	0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-300	USD	-78.912,04	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-500	USD	-131.520,07	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-700	USD	-184.128,09	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-1.600	USD	-420.864,20	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-2.200	USD	-578.688,27	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-657.600,31	-0,06
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-946.944,45	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-4.100	USD	-1.078.464,51	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.000,00)	-13.000	USD	-3.419.521,61	-0,32
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.100,00)	3.500	USD	431.405,25	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.100,00)	1.800	USD	221.865,55	0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.100,00)	-1.800	USD	-221.865,55	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.100,00)	-3.500	USD	-431.405,25	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	5.500	USD	1.715.460,49	0,16
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	5.000	USD	1.559.509,53	0,15
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	3.500	USD	1.091.656,68	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	3.500	USD	1.091.656,68	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	3.500	USD	1.091.656,68	0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	1.800	USD	561.423,43	0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	-1.500	USD	-467.852,86	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	-1.800	USD	-561.423,43	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	-3.500	USD	-1.091.656,68	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	-5.000	USD	-1.559.509,53	-0,15
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.100,00)	-11.000	USD	-3.430.920,97	-0,32
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	4.800	USD	420.015,54	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	4.800	USD	420.015,54	0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	3.300	USD	288.760,69	0,03
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	2.000	USD	175.006,47	0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	-1.400	USD	-122.504,53	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-350.012,96	-0,03
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	-4.700	USD	-411.265,22	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.200,00)	-4.800	USD	-420.015,54	-0,04
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	5.700	USD	2.096.427,44	0,20
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	5.000	USD	1.838.971,44	0,17
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	4.800	USD	1.765.412,58	0,17
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	4.800	USD	1.765.412,58	0,17
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	3.300	USD	1.213.721,15	0,11
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	2.000	USD	735.588,58	0,07
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-1.400	USD	-514.912,01	-0,05
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-4.000	USD	-1.471.177,16	-0,14
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-4.700	USD	-1.728.633,15	-0,16
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-4.800	USD	-1.765.412,58	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-5.000	USD	-1.838.971,44	-0,17
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.200,00)	-5.700	USD	-2.096.427,44	-0,20
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.300,00)	2.800	USD	167.074,12	0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.300,00)	-400	USD	-23.867,73	0,00

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.  
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.300,00)	-2.400	USD	-143.206,39	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.300,00)	2.800	USD	1.208.502,85	0,11
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.300,00)	-400	USD	-172.643,26	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.300,00)	-2.400	USD	-1.035.859,58	-0,10
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.400,00)	6.500	USD	251.012,44	0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.400,00)	1.900	USD	73.372,86	0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.400,00)	-1.900	USD	-73.372,86	-0,01
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.400,00)	-6.500	USD	-251.012,44	-0,02
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.400,00)	6.500	USD	3.264.325,45	0,31
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.400,00)	1.900	USD	954.187,44	0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.400,00)	-1.900	USD	-954.187,44	-0,09
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.400,00)	-6.500	USD	-3.264.325,45	-0,31
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.500,00)	1.500	USD	36.613,16	0,00
S&P 500 Index	Jun 2023 (call, strike 4.500,00)	-1.500	USD	-36.613,16	0,00
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.500,00)	1.500	USD	869.464,76	0,08
S&P 500 Index	Jun 2023 (put, strike 4.500,00)	-1.500	USD	-869.464,76	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.400,00)	-5.500	USD	-3.562.972,16	-0,34
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.400,00)	-5.500	USD	-809.118,47	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-1.000	USD	-581.940,16	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-2.500	USD	-1.454.850,40	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-3.500	USD	-2.036.790,56	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-2.909.700,80	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-1.000	USD	-170.586,47	-0,02
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-2.500	USD	-426.466,17	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-3.500	USD	-597.052,64	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-5.000	USD	-852.932,35	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-5.500	USD	-938.225,58	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-6.000	USD	-1.023.518,81	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-6.500	USD	-1.108.812,05	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-7.000	USD	-1.194.105,28	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-8.000	USD	-1.364.691,75	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-8.600	USD	-1.467.043,64	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-9.000	USD	-1.535.278,22	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-9.400	USD	-1.603.512,80	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.500,00)	-12.900	USD	-2.200.565,45	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-2.300	USD	-1.193.291,91	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-3.200	USD	-1.660.232,21	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-3.400	USD	-1.763.996,73	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.600,00)	-6.300	USD	-3.268.582,18	-0,31
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-2.300	USD	-452.676,47	-0,04
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-3.200	USD	-629.810,74	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-3.400	USD	-669.173,91	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.500	USD	-885.671,35	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-4.500	USD	-885.671,35	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-6.300	USD	-1.239.939,89	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-6.500	USD	-1.279.303,07	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-11.600	USD	-2.283.063,94	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-11.600	USD	-2.283.063,94	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-14.000	USD	-2.755.421,99	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.600,00)	-14.000	USD	-2.755.421,99	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-2.500	USD	-1.146.262,59	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-2.900	USD	-1.329.664,61	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.200	USD	-1.467.216,12	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.500	USD	-1.604.767,63	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-3.800	USD	-1.742.319,14	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-4.000	USD	-1.834.020,15	-0,17

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-4.800	USD	-2.200.824,17	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.700,00)	-6.500	USD	-2.980.282,73	-0,28
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-2.500	USD	-564.613,27	-0,05
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-2.900	USD	-654.951,39	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.200	USD	-722.704,98	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.500	USD	-790.458,57	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-3.800	USD	-858.212,16	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-4.000	USD	-903.381,22	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-4.700	USD	-1.061.472,94	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-4.800	USD	-1.084.057,47	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.300	USD	-1.196.980,13	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.500	USD	-1.242.149,19	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.500	USD	-1.242.149,19	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.800	USD	-1.309.902,78	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.900	USD	-1.332.487,31	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-5.900	USD	-1.332.487,31	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.300	USD	-1.422.825,43	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.500	USD	-1.467.994,49	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-6.500	USD	-1.467.994,49	-0,14
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-10.000	USD	-2.258.453,06	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.700,00)	-12.000	USD	-2.710.143,68	-0,26
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.750,00)	-2.500	USD	-1.073.605,17	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.750,00)	-2.500	USD	-603.639,58	-0,06
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-1.163.216,10	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-1.203.327,00	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-1.403.881,50	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-1.403.881,50	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-1.403.881,50	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.800,00)	-4.800	USD	-1.925.323,20	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	6.500	USD	1.675.675,62	0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-2.900	USD	-747.609,13	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.000	USD	-773.388,75	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-902.286,87	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-902.286,87	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-3.500	USD	-902.286,87	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-4.800	USD	-1.237.422,00	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-1.288.981,25	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-1.288.981,25	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-5.000	USD	-1.288.981,25	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-6.500	USD	-1.675.675,62	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.800,00)	-6.900	USD	-1.778.794,12	-0,17
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.850,00)	-3.500	USD	-1.307.410,00	-0,12
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.850,00)	-6.000	USD	-2.241.274,28	-0,21
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.850,00)	-3.500	USD	-962.172,59	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.850,00)	-6.000	USD	-1.649.438,73	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	3.100	USD	1.074.796,81	0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-832.100,75	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-866.771,63	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-866.771,63	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-970.784,22	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-970.784,22	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-1.074.796,81	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.600	USD	-1.594.859,79	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-1.664.201,52	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-1.664.201,52	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-5.600	USD	-1.941.568,43	-0,18

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Indexoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 3.900,00)	-8.100	USD	-2.808.340,06	-0,27
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	3.100	USD	907.502,93	0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.400	USD	-702.582,91	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-731.857,20	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.500	USD	-731.857,20	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-819.680,07	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-2.800	USD	-819.680,07	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-3.100	USD	-907.502,93	-0,09
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.600	USD	-1.346.617,25	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-1.405.165,83	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-4.800	USD	-1.405.165,83	-0,13
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-5.600	USD	-1.639.360,13	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 3.900,00)	-8.100	USD	-2.371.217,33	-0,22
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	3.600	USD	1.063.599,72	0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-738.610,92	-0,07
S&P 500 Index	Dez 2023 (call, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-1.063.599,72	-0,10
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	6.000	USD	1.984.953,46	0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	3.600	USD	1.190.972,08	0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-2.500	USD	-827.063,94	-0,08
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-3.600	USD	-1.190.972,08	-0,11
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-5.000	USD	-1.654.127,89	-0,16
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-5.700	USD	-1.885.705,79	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-5.800	USD	-1.918.788,34	-0,18
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.000,00)	-6.000	USD	-1.984.953,46	-0,19
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.100,00)	-4.200	USD	-1.564.661,83	-0,15
S&P 500 Index	Dez 2023 (put, strike 4.100,00)	-4.800	USD	-1.788.184,95	-0,17
Swiss Market Index	Mar 2023 (call, strike 10.974,00)	121	CHF	15.316,77	0,00
Swiss Market Index	Mar 2023 (put, strike 10.974,00)	-121	CHF	-55.279,48	-0,01
Swiss Market Index	Jun 2023 (put, strike 10.500,00)	3.850	CHF	1.602.117,81	0,15
Swiss Market Index	Jun 2023 (put, strike 10.500,00)	-1.850	CHF	-769.848,83	-0,07
Swiss Market Index	Jun 2023 (put, strike 10.500,00)	-2.000	CHF	-832.269,00	-0,08
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.000,00)	-3.800	CHF	-1.662.079,68	-0,16
Swiss Market Index	Dez 2023 (call, strike 10.800,00)	-1.050	CHF	-573.996,55	-0,05
Swiss Market Index	Dez 2023 (put, strike 10.800,00)	-1.050	CHF	-782.690,52	-0,07
				<b>-225.834.108,55</b>	<b>-21,36</b>
<b>Summe Indexoptionen</b>				<b>-225.834.108,55</b>	<b>-21,36</b>
Aktienoptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Allianz SE	Dez 2023 (put, strike 160,00)	9.700	EUR	6.450.893,82	0,61
Allianz SE	Dez 2023 (put, strike 180,00)	6.400	EUR	7.229.165,44	0,68
Allianz SE	Dez 2023 (call, strike 190,00)	1.750	EUR	3.822.985,25	0,36
Allianz SE	Dez 2023 (put, strike 190,00)	2.950	EUR	4.339.393,07	0,41
Allianz SE	Dez 2023 (call, strike 220,00)	2.000	EUR	1.516.313,60	0,14
Allianz SE	Dez 2023 (put, strike 220,00)	-2.000	EUR	-5.869.444,40	-0,56
Allianz SE	Jun 2024 (put, strike 140,00)	1.300	EUR	864.813,17	0,08
Allianz SE	Jun 2024 (put, strike 180,00)	1.700	EUR	2.819.841,85	0,27
American International Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 57,50)	350.000	USD	1.562.856,17	0,15
American International Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 60,00)	150.000	USD	1.461.587,91	0,14
American International Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 60,00)	150.000	USD	807.633,17	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 110,00)	80.000	USD	29.387,23	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 110,00)	80.000	USD	29.387,23	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 110,00)	-160.000	USD	-58.774,46	-0,01
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	230.000	USD	984.094,84	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	200.000	USD	855.734,65	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	-430.000	USD	-1.839.829,49	-0,17
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	80.000	USD	11.652,83	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	70.000	USD	10.196,22	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	70.000	USD	10.196,22	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	60.000	USD	8.739,62	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	-130.000	USD	-18.935,84	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 150,00)	-150.000	USD	-21.849,05	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 160,00)	70.000	USD	2.060,68	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2023 (call, strike 160,00)	-70.000	USD	-2.060,68	0,00
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2023 (call, strike 160,00)	100.000	USD	289.046,80	0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2023 (call, strike 160,00)	-100.000	USD	-289.046,80	-0,03
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2023 (put, strike 160,00)	100.000	USD	2.969.430,31	0,28
Apollo Global Capital, Inc.	Jun 2023 (put, strike 160,00)	-100.000	USD	-2.969.430,31	-0,28
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	180.000	USD	2.728.843,85	0,26
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	-180.000	USD	-2.728.843,85	-0,26
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 135,00)	105.000	USD	1.825.704,39	0,17
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 140,00)	80.000	USD	1.181.596,44	0,11
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 140,00)	-80.000	USD	-1.181.596,44	-0,11
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	190.000	USD	3.767.910,16	0,36
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	170.000	USD	3.371.288,04	0,32
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	80.000	USD	1.586.488,49	0,15
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	-80.000	USD	-1.586.488,49	-0,15
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	-190.000	USD	-3.767.910,16	-0,36
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 145,00)	65.000	USD	836.100,07	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 145,00)	65.000	USD	1.467.659,08	0,14
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	90.000	USD	994.600,82	0,09
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	80.000	USD	884.089,61	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	80.000	USD	884.089,61	0,08
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	90.000	USD	2.292.431,93	0,22
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	80.000	USD	2.037.717,27	0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	80.000	USD	2.037.717,27	0,19
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 160,00)	150.000	USD	4.827.263,11	0,46
Apollo Global Capital, Inc.	Jan 2024 (put, strike 160,00)	-150.000	USD	-4.827.263,11	-0,46
AXA S.A.	Dez 2023 (put, strike 21,00)	30.000	EUR	3.462.459,00	0,33
AXA S.A.	Dez 2023 (put, strike 22,00)	41.800	EUR	5.855.519,56	0,55
AXA S.A.	Dez 2023 (put, strike 24,00)	40.000	EUR	8.057.976,00	0,76
AXA S.A.	Dez 2023 (put, strike 25,00)	46.000	EUR	11.060.736,80	1,05
AXA S.A.	Dez 2023 (call, strike 26,00)	36.500	EUR	7.519.638,75	0,71
AXA S.A.	Dez 2023 (put, strike 26,00)	-36.500	EUR	-10.001.740,95	-0,95
AXA S.A.	Jun 2024 (put, strike 20,00)	14.000	EUR	2.039.002,00	0,19
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 34,00)	850.000	USD	1.196.685,31	0,11
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 34,00)	-850.000	USD	-1.196.685,31	-0,11
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 35,00)	400.000	USD	120.567,44	0,01
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 35,00)	-400.000	USD	-120.567,44	-0,01
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 35,00)	400.000	USD	821.663,90	0,08
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 35,00)	-400.000	USD	-821.663,90	-0,08
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 36,00)	400.000	USD	1.132.811,99	0,11
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 36,00)	-400.000	USD	-1.132.811,99	-0,11
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 37,00)	400.000	USD	26.879,93	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 37,00)	-400.000	USD	-26.879,93	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	600.000	USD	2.219.213,49	0,21

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.  
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	500.000	USD	1.849.344,58	0,18
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	500.000	USD	1.849.344,58	0,18
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	400.000	USD	1.479.475,66	0,14
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	-400.000	USD	-1.479.475,66	-0,14
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	-600.000	USD	-2.219.213,49	-0,21
Bank of America Corp.	Jan 2023 (put, strike 37,00)	-1.000.000	USD	-3.698.689,15	-0,35
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 40,00)	970.000	USD	12.491,62	0,00
Bank of America Corp.	Jan 2023 (call, strike 40,00)	-970.000	USD	-12.491,62	0,00
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 32,00)	700.000	USD	1.422.703,68	0,13
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 32,00)	-700.000	USD	-1.422.703,68	-0,13
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 34,00)	1.000.000	USD	2.281.675,33	0,22
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 34,00)	-400.000	USD	-912.670,13	-0,09
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 34,00)	-600.000	USD	-1.369.005,20	-0,13
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 34,00)	1.000.000	USD	2.866.303,12	0,27
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 34,00)	-400.000	USD	-1.146.521,25	-0,11
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 34,00)	-600.000	USD	-1.719.781,87	-0,16
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 40,00)	500.000	USD	264.321,39	0,03
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 40,00)	350.000	USD	185.024,97	0,02
Bank of America Corp.	Jun 2023 (call, strike 40,00)	-850.000	USD	-449.346,36	-0,04
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 40,00)	500.000	USD	3.416.452,57	0,32
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 40,00)	350.000	USD	2.391.516,80	0,23
Bank of America Corp.	Jun 2023 (put, strike 40,00)	-850.000	USD	-5.807.969,36	-0,55
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 28,00)	650.000	USD	4.641.659,59	0,44
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 28,00)	650.000	USD	1.216.923,03	0,12
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 30,00)	400.000	USD	2.363.990,44	0,22
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	800.000	USD	1.956.202,95	0,19
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	750.000	USD	1.833.940,27	0,17
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	700.000	USD	1.711.677,58	0,16
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 30,00)	400.000	USD	978.101,48	0,09
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 31,00)	600.000	USD	3.205.404,92	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 31,00)	600.000	USD	1.669.093,46	0,16
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	600.000	USD	2.883.539,56	0,27
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	400.000	USD	1.922.359,71	0,18
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 32,00)	320.000	USD	1.537.887,77	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	1.000.000	USD	3.151.253,22	0,30
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	700.000	USD	2.205.877,25	0,21
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	600.000	USD	1.890.751,93	0,18
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	500.000	USD	1.575.626,61	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	400.000	USD	1.260.501,29	0,12
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 32,00)	320.000	USD	1.008.401,03	0,09
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 33,00)	750.000	USD	2.662.976,81	0,25
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 33,00)	450.000	USD	1.597.786,09	0,15
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 34,00)	700.000	USD	2.788.329,07	0,26
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 34,00)	-700.000	USD	-2.788.329,07	-0,26
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 36,00)	1.100.000	USD	5.505.923,35	0,52
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 36,00)	-1.100.000	USD	-5.505.923,35	-0,52
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 37,00)	250.000	USD	663.237,06	0,06
Bank of America Corp.	Jan 2024 (call, strike 37,00)	-250.000	USD	-663.237,06	-0,06
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 37,00)	250.000	USD	1.394.608,57	0,13
Bank of America Corp.	Jan 2024 (put, strike 37,00)	-250.000	USD	-1.394.608,57	-0,13
Bayerische Motoren Werke AG	Dez 2023 (put, strike 76,00)	3.300	EUR	2.364.655,26	0,22
BNP Paribas S.A.	Dez 2023 (put, strike 45,00)	5.000	EUR	1.690.053,50	0,16
BNP Paribas S.A.	Dez 2023 (put, strike 48,00)	4.000	EUR	1.762.050,40	0,17
BNP Paribas S.A.	Dez 2023 (call, strike 50,00)	6.600	EUR	4.526.427,18	0,43

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.  
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Uderlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
BNP Paribas S.A.	Dez 2023 (put, strike 50,00)	6.600	EUR	3.450.706,38	0,33
Broadcom, Inc.	Jan 2024 (put, strike 520,00)	40.000	USD	1.950.908,41	0,18
Broadcom, Inc.	Jan 2024 (call, strike 530,00)	20.000	USD	1.750.643,07	0,17
Broadcom, Inc.	Jan 2024 (put, strike 530,00)	20.000	USD	1.059.502,10	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 55,00)	170.000	USD	2.482,66	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 55,00)	150.000	USD	2.190,58	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 55,00)	-320.000	USD	-4.673,24	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 60,00)	200.000	USD	556,76	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 60,00)	180.000	USD	501,08	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 60,00)	-380.000	USD	-1.057,84	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 62,50)	190.000	USD	296,24	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 62,50)	185.000	USD	288,44	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 62,50)	180.000	USD	280,65	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 62,50)	-180.000	USD	-280,65	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 62,50)	-375.000	USD	-584,68	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 65,00)	180.000	USD	122,11	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 65,00)	150.000	USD	101,76	0,00
Citigroup, Inc.	Jan 2023 (call, strike 65,00)	-330.000	USD	-223,87	0,00
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 50,00)	150.000	USD	275.601,41	0,03
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 50,00)	-150.000	USD	-275.601,41	-0,03
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 50,00)	150.000	USD	945.707,10	0,09
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 50,00)	-150.000	USD	-945.707,10	-0,09
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 52,50)	245.000	USD	301.377,44	0,03
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 52,50)	200.000	USD	246.022,39	0,02
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 52,50)	-65.000	USD	-79.957,28	-0,01
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (call, strike 52,50)	-380.000	USD	-467.442,55	-0,04
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 52,50)	245.000	USD	1.972.832,05	0,19
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 52,50)	200.000	USD	1.610.475,15	0,15
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 52,50)	-65.000	USD	-523.404,42	-0,05
Citigroup, Inc.	Jun 2023 (put, strike 52,50)	-380.000	USD	-3.059.902,78	-0,29
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 45,00)	300.000	USD	1.732.330,29	0,16
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	700.000	USD	3.638.736,10	0,34
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	450.000	USD	2.339.187,49	0,22
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 45,00)	300.000	USD	1.559.458,33	0,15
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	280.000	USD	1.306.258,96	0,12
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (call, strike 47,50)	220.000	USD	1.026.346,33	0,10
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	280.000	USD	1.781.115,61	0,17
Citigroup, Inc.	Jan 2024 (put, strike 47,50)	220.000	USD	1.399.447,98	0,13
Credit Agricole S.A.	Dez 2023 (call, strike 8,80)	10.000	EUR	1.494.701,00	0,14
Credit Agricole S.A.	Dez 2023 (put, strike 8,80)	10.000	EUR	761.140,00	0,07
Credit Agricole S.A.	Dez 2023 (call, strike 9,00)	33.500	EUR	4.531.916,85	0,43
Credit Agricole S.A.	Dez 2023 (put, strike 9,00)	33.500	EUR	2.783.796,40	0,26
CVS Health Corp.	Jan 2024 (put, strike 92,50)	200.000	USD	1.667.721,53	0,16
CVS Health Corp.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	90.000	USD	670.730,85	0,06
CVS Health Corp.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	90.000	USD	1.073.975,63	0,10
General Electric Co.	Jan 2024 (put, strike 84,00)	300.000	USD	2.905.362,19	0,27
General Electric Co.	Jan 2024 (call, strike 85,00)	120.000	USD	1.438.131,27	0,14
General Electric Co.	Jan 2024 (put, strike 85,00)	120.000	USD	1.216.238,26	0,12
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 320,00)	70.000	USD	184.089,93	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 320,00)	70.000	USD	184.089,93	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2023 (put, strike 320,00)	-140.000	USD	-368.179,86	-0,03
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (call, strike 290,00)	40.000	USD	2.437.571,07	0,23
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (call, strike 290,00)	-40.000	USD	-2.437.571,07	-0,23
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 290,00)	40.000	USD	366.877,30	0,03

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 290,00)	-40.000	USD	-366.877,30	-0,03
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 300,00)	50.000	USD	562.597,52	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 300,00)	-50.000	USD	-562.597,52	-0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (call, strike 310,00)	35.000	USD	1.642.229,88	0,16
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (call, strike 310,00)	-35.000	USD	-1.642.229,88	-0,16
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 310,00)	35.000	USD	479.210,30	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jun 2023 (put, strike 310,00)	-35.000	USD	-479.210,30	-0,05
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 300,00)	80.000	USD	1.699.442,87	0,16
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 310,00)	60.000	USD	1.457.738,47	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	55.000	USD	2.995.831,12	0,28
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 320,00)	35.000	USD	1.906.437,99	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	70.000	USD	1.928.753,99	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	55.000	USD	1.515.449,57	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 320,00)	35.000	USD	964.377,00	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 330,00)	60.000	USD	1.876.991,60	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 350,00)	57.000	USD	2.268.283,82	0,21
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (call, strike 370,00)	25.000	USD	779.789,96	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 370,00)	60.000	USD	2.985.000,59	0,28
Goldman Sachs Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 370,00)	25.000	USD	1.243.750,25	0,12
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	95.000	USD	77.447,64	0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	80.000	USD	65.219,06	0,01
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	60.000	USD	48.914,29	0,00
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	35.000	USD	28.533,34	0,00
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (put, strike 280,00)	-270.000	USD	-220.114,32	-0,02
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (call, strike 390,00)	30.000	USD	117,16	0,00
Home Depot, Inc./The	Jan 2023 (call, strike 390,00)	-30.000	USD	-117,16	0,00
ING Groep NV	Dez 2023 (put, strike 10,50)	21.000	EUR	2.175.127,50	0,21
ING Groep NV	Dez 2023 (call, strike 11,00)	18.000	EUR	2.634.868,80	0,25
ING Groep NV	Dez 2023 (put, strike 11,00)	18.000	EUR	2.256.787,80	0,21
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 130,00)	175.000	USD	932.413,77	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 130,00)	-87.500	USD	-466.206,89	-0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 130,00)	-87.500	USD	-466.206,89	-0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	175.000	USD	396.124,74	0,04
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	-87.500	USD	-198.062,37	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 130,00)	-87.500	USD	-198.062,37	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 140,00)	100.000	USD	103.204,68	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 140,00)	75.000	USD	77.403,51	0,01
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 140,00)	45.000	USD	46.442,11	0,00
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (call, strike 140,00)	-220.000	USD	-227.050,31	-0,02
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	180.000	USD	1.340.319,38	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	160.000	USD	1.191.395,01	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	100.000	USD	744.621,88	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	75.000	USD	558.466,41	0,05
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	45.000	USD	335.079,85	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	-220.000	USD	-1.638.168,13	-0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2023 (put, strike 140,00)	-340.000	USD	-2.531.714,39	-0,24
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	120.000	USD	4.363.021,78	0,41
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	90.000	USD	3.272.266,34	0,31
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 100,00)	-90.000	USD	-3.272.266,34	-0,31
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	300.000	USD	1.187.726,77	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	260.000	USD	1.029.363,20	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	200.000	USD	791.817,85	0,08

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



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktioptionen					
Underlying		Kontrakte	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	120.000	USD	475.090,71	0,05
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	90.000	USD	356.318,03	0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 100,00)	-90.000	USD	-356.318,03	-0,03
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 105,00)	135.000	USD	4.418.462,53	0,42
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 105,00)	250.000	USD	1.204.145,23	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 105,00)	135.000	USD	650.238,43	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 110,00)	100.000	USD	2.926.094,92	0,28
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	200.000	USD	1.167.521,95	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	160.000	USD	934.017,56	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	130.000	USD	758.889,27	0,07
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 110,00)	100.000	USD	583.760,97	0,06
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 115,00)	150.000	USD	1.055.687,42	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 115,00)	-150.000	USD	-1.055.687,42	-0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	170.000	USD	1.433.782,63	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	160.000	USD	1.349.442,47	0,13
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 125,00)	90.000	USD	1.800.117,30	0,17
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 125,00)	80.000	USD	1.600.104,27	0,15
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	350.000	USD	3.536.260,95	0,33
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	90.000	USD	909.324,24	0,09
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 125,00)	80.000	USD	808.288,22	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	85.000	USD	1.474.002,43	0,14
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	70.000	USD	1.213.884,35	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (call, strike 130,00)	70.000	USD	1.213.884,35	0,11
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	150.000	USD	1.796.390,86	0,17
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	85.000	USD	1.017.954,83	0,10
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	70.000	USD	838.315,74	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	70.000	USD	838.315,74	0,08
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	110.000	USD	2.408.520,52	0,23
JPMorgan Chase & Co.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	-110.000	USD	-2.408.520,52	-0,23
MetLife, Inc.	Jun 2023 (call, strike 60,00)	140.000	USD	1.877.419,48	0,18
MetLife, Inc.	Jun 2023 (call, strike 60,00)	120.000	USD	1.609.216,70	0,15
MetLife, Inc.	Jun 2023 (call, strike 60,00)	-120.000	USD	-1.609.216,70	-0,15
MetLife, Inc.	Jun 2023 (call, strike 60,00)	-140.000	USD	-1.877.419,48	-0,18
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	350.000	USD	466.408,25	0,04
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	140.000	USD	186.563,30	0,02
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	120.000	USD	159.911,40	0,02
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	-120.000	USD	-159.911,40	-0,01
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	-140.000	USD	-186.563,30	-0,02
MetLife, Inc.	Jun 2023 (put, strike 60,00)	-350.000	USD	-466.408,25	-0,04
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 57,50)	400.000	USD	1.048.110,56	0,10
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 60,00)	140.000	USD	2.159.953,45	0,20
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 60,00)	140.000	USD	440.606,14	0,04
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 62,50)	200.000	USD	2.757.802,95	0,26
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 62,50)	230.000	USD	866.832,02	0,08
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 62,50)	200.000	USD	753.766,97	0,07
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 65,00)	250.000	USD	1.120.658,70	0,11
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 67,50)	300.000	USD	1.589.574,14	0,15
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 67,50)	300.000	USD	1.589.574,14	0,15
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	130.000	USD	1.227.040,55	0,12
MetLife, Inc.	Jan 2024 (call, strike 70,00)	130.000	USD	1.227.040,55	0,12
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 70,00)	130.000	USD	807.184,59	0,08
MetLife, Inc.	Jan 2024 (put, strike 70,00)	130.000	USD	807.184,59	0,08
Roche Holding AG	Dez 2023 (put, strike 280,00)	700	CHF	1.218.748,17	0,11
Roche Holding AG	Dez 2023 (call, strike 300,00)	400	CHF	541.094,56	0,05

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Optionen					
Aktienoptionen					
Underlying		Kontrakte	Wahrung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
Roche Holding AG	Dez 2023 (put, strike 300,00)	400	CHF	1.121.568,03	0,11
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 100,00)	100.000	USD	226.279,69	0,02
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 100,00)	-100.000	USD	-226.279,69	-0,02
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	180.000	USD	526.064,99	0,05
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	180.000	USD	526.064,99	0,05
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	100.000	USD	292.258,33	0,03
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	-100.000	USD	-292.258,33	-0,03
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 100,00)	-360.000	USD	-1.052.129,98	-0,10
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 105,00)	120.000	USD	79.045,06	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 105,00)	100.000	USD	65.870,88	0,01
Starbucks Corp.	Jan 2023 (call, strike 105,00)	-220.000	USD	-144.915,94	-0,01
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 105,00)	120.000	USD	722.402,25	0,07
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 105,00)	100.000	USD	602.001,87	0,06
Starbucks Corp.	Jan 2023 (put, strike 105,00)	-220.000	USD	-1.324.404,12	-0,13
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 120,00)	200.000	USD	1.265.053,17	0,12
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	200.000	USD	1.836.575,87	0,17
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	155.000	USD	1.423.346,30	0,13
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	150.000	USD	1.377.431,90	0,13
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 130,00)	110.000	USD	1.010.116,73	0,10
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (call, strike 140,00)	65.000	USD	1.174.274,81	0,11
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 140,00)	65.000	USD	839.962,01	0,08
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (call, strike 150,00)	62.000	USD	826.883,30	0,08
T-Mobile US, Inc.	Jan 2024 (put, strike 150,00)	62.000	USD	1.085.828,64	0,10
U.S. Bancorp	Jan 2024 (put, strike 40,00)	500.000	USD	1.496.016,87	0,14
UBS Group AG	Dez 2023 (put, strike 15,00)	15.000	CHF	1.742.986,74	0,16
UBS Group AG	Dez 2023 (call, strike 16,00)	13.000	CHF	3.291.148,74	0,31
UBS Group AG	Dez 2023 (put, strike 16,00)	26.000	CHF	3.936.680,50	0,37
UBS Group AG	Dez 2023 (call, strike 17,00)	6.000	CHF	1.181.491,48	0,11
UBS Group AG	Dez 2023 (put, strike 17,00)	6.000	CHF	1.177.051,42	0,11
UnitedHealth Group, Inc.	Jan 2024 (put, strike 500,00)	45.000	USD	1.584.284,24	0,15
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (call, strike 350,00)	1.500	CHF	1.352.184,27	0,13
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 350,00)	-1.500	CHF	-171.452,73	-0,02
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 370,00)	5.000	CHF	763.197,83	0,07
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 380,00)	7.000	CHF	1.225.736,97	0,12
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 400,00)	3.500	CHF	807.206,66	0,08
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 410,00)	4.700	CHF	1.240.667,02	0,12
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (call, strike 420,00)	2.200	CHF	880.030,50	0,08
Zurich Insurance Group AG	Dez 2023 (put, strike 420,00)	2.200	CHF	664.741,11	0,06
				<b>283.083.560,02</b>	<b>26,78</b>
<b>Summe Aktienoptionen</b>				<b>283.083.560,02</b>	<b>26,78</b>
<b>Summe Optionen</b>				<b>57.249.451,47</b>	<b>5,42</b>
Volatility Swaps	Falligkeit	Nennbetrag	Wahrung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermogen (%)
3M Co. 26,24 %	20.01.2023	1.500.000	USD	3.106,62	0,00
3M Co. 26,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	82.784,51	0,01
3M Co. 27,21 %	20.01.2023	2.000.000	USD	13.547,42	0,00
ABB Ltd. 30,01 %	16.06.2023	2.038.900	CHF	-64.513,86	-0,01
AbbVie, Inc. 33,13 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-59.851,25	-0,01
AbbVie, Inc. 30,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-81.739,53	-0,01
AbbVie, Inc. 27,05 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-71.086,28	-0,01

Die Erlauerungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.  
Die ISIN ist nicht zwingend ein Indikator fur die Provenienz der Investments.

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
AbbVie, Inc. 32,37 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-53.760,03	-0,01
AbbVie, Inc. 28,00 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-170.349,90	-0,02
AbbVie, Inc. 30,09 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-65.251,96	-0,01
AbbVie, Inc. 31,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-203.091,84	-0,02
AbbVie, Inc. 32,55 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-66.072,54	-0,01
AbbVie, Inc. 30,78 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-149.283,92	-0,01
AbbVie, Inc. 29,74 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-161.482,19	-0,02
AbbVie, Inc. 29,99 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-117.700,35	-0,01
AbbVie, Inc. 31,21 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-149.727,57	-0,01
AbbVie, Inc. 31,40 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-154.080,02	-0,01
AbbVie, Inc. 30,24 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-138.225,55	-0,01
AbbVie, Inc. 31,53 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-87.365,56	-0,01
AbbVie, Inc. 30,85 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-51.091,22	0,00
AbbVie, Inc. 30,87 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-125.101,01	-0,01
AbbVie, Inc. 29,30 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-134.324,90	-0,01
AbbVie, Inc. 30,45 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-71.552,83	-0,01
AbbVie, Inc. 28,69 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-154.561,88	-0,01
AbbVie, Inc. 30,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-79.021,73	-0,01
AbbVie, Inc. 30,30 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-164.212,95	-0,02
Accenture PLC 29,30 %	20.01.2023	1.200.000	USD	16.523,95	0,00
Accenture PLC 26,98 %	20.01.2023	1.500.000	USD	44.135,96	0,00
Admiral Group PLC 35,59 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-53.828,41	-0,01
Adobe, Inc. 33,65 %	20.01.2023	2.500.000	USD	212.152,45	0,02
Adobe, Inc. 34,40 %	20.01.2023	1.500.000	USD	118.212,28	0,01
Adobe, Inc. 31,34 %	20.01.2023	1.500.000	USD	152.669,11	0,01
Adobe, Inc. 31,36 %	20.01.2023	1.500.000	USD	158.585,51	0,01
Adobe, Inc. 32,64 %	20.01.2023	1.700.000	USD	146.100,16	0,01
Adobe, Inc. 32,86 %	20.01.2023	2.500.000	USD	196.019,91	0,02
Adobe, Inc. 32,55 %	20.01.2023	2.500.000	USD	203.262,20	0,02
Adobe, Inc. 33,19 %	20.01.2023	1.500.000	USD	177.198,84	0,02
Advanced Micro Devices, Inc. 54,03 %	19.01.2024	2.500.000	USD	39.349,92	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 52,12 %	20.01.2023	1.100.000	USD	82.073,94	0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 41,76 %	20.01.2023	2.500.000	USD	340.355,95	0,03
Advanced Micro Devices, Inc. 54,82 %	19.01.2024	2.000.000	USD	16.559,72	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 40,15 %	20.01.2023	2.500.000	USD	377.969,16	0,04
Aflac, Inc. 32,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-76.399,79	-0,01
Aflac, Inc. 27,34 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-74.567,74	-0,01
Aflac, Inc. 30,91 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-71.180,20	-0,01
Aflac, Inc. 32,20 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-54.152,72	-0,01
Aflac, Inc. 29,28 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-37.022,38	0,00
Aflac, Inc. 31,80 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-56.487,21	-0,01
Aflac, Inc. 32,09 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-60.089,83	-0,01
Aflac, Inc. 28,79 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-50.298,63	0,00
Aflac, Inc. 30,41 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-42.639,95	0,00
Aflac, Inc. 28,21 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-61.827,65	-0,01
Aflac, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-37.327,66	0,00
Aflac, Inc. 31,99 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-96.539,67	-0,01
Aflac, Inc. 31,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-60.371,76	-0,01
Aflac, Inc. 32,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-73.551,04	-0,01
Aflac, Inc. 30,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-35.133,92	0,00
Aflac, Inc. 32,53 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-107.491,57	-0,01
Aflac, Inc. 27,78 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-15.089,34	0,00
Aflac, Inc. 32,84 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-54.941,05	-0,01
Aflac, Inc. 29,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-91.097,83	-0,01
Aflac, Inc. 28,55 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-29.578,08	0,00
Aflac, Inc. 30,10 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-67.301,18	-0,01
Aflac, Inc. 32,45 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-137.152,02	-0,01
Air Liquide S.A. 24,12 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-3.214,23	0,00
Air Liquide S.A. 24,39 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-6.322,66	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Air Liquide S.A. 24,59 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-12.388,88	0,00
Air Products and Chemicals, Inc. 30,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-8.635,37	0,00
Air Products and Chemicals, Inc. 26,95 %	20.01.2023	2.000.000	USD	30.849,89	0,00
Air Products and Chemicals, Inc. 32,67 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-43.381,66	0,00
Alaska Air Group, Inc. 43,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-46.989,19	0,00
Alaska Air Group, Inc. 47,04 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-80.461,11	-0,01
Allianz SE 30,85 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	93.944,04	0,01
Allianz SE 28,85 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-149.062,15	-0,01
Allianz SE 28,04 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-35.727,20	0,00
Allianz SE 29,02 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-41.466,35	0,00
Allianz SE 28,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-53.424,91	-0,01
Allianz SE 29,61 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-54.702,16	-0,01
Allianz SE 28,51 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-53.385,64	-0,01
Allianz SE 28,35 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-97.543,49	-0,01
Allianz SE 28,63 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-84.870,86	-0,01
Allianz SE 27,36 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-31.866,61	0,00
Allianz SE 26,15 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-14.577,55	0,00
Allianz SE 28,18 %	15.12.2023	1.900.000	EUR	-70.362,78	-0,01
Allianz SE 27,12 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-72.461,96	-0,01
Allianz SE 28,01 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-88.748,22	-0,01
Allianz SE 26,27 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-20.274,17	0,00
Allianz SE 27,98 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-49.819,30	0,00
Allianz SE 28,84 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-79.760,58	-0,01
Allianz SE 28,92 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-86.246,96	-0,01
Allianz SE 29,40 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-114.890,94	-0,01
Allianz SE 27,46 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-54.479,52	-0,01
Allianz SE 25,49 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-8.632,77	0,00
Allianz SE 27,87 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-43.695,66	0,00
Allstate Corp./The 31,52 %	19.01.2024	1.200.000	USD	2.879,80	0,00
Allstate Corp./The 31,85 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-10.732,47	0,00
Allstate Corp./The 30,21 %	16.06.2023	1.300.000	USD	19.786,40	0,00
Allstate Corp./The 31,86 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-274,17	0,00
Allstate Corp./The 29,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	24.178,30	0,00
Allstate Corp./The 30,29 %	19.01.2024	1.500.000	USD	18.936,47	0,00
Allstate Corp./The 30,65 %	19.01.2024	1.300.000	USD	12.715,20	0,00
Allstate Corp./The 30,68 %	16.06.2023	1.500.000	USD	10.600,21	0,00
Allstate Corp./The 31,61 %	16.06.2023	1.300.000	USD	1.111,27	0,00
Allstate Corp./The 30,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	8.948,94	0,00
Allstate Corp./The 32,18 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-8.229,07	0,00
Alphabet, Inc. 31,62 %	20.01.2023	2.500.000	USD	173.651,24	0,02
Alphabet, Inc. 31,70 %	20.01.2023	2.000.000	USD	137.497,55	0,01
Alphabet, Inc. 35,54 %	19.01.2024	1.500.000	USD	35.814,87	0,00
Alphabet, Inc. 30,57 %	20.01.2023	2.000.000	USD	136.921,00	0,01
Alphabet, Inc. 31,25 %	20.01.2023	2.000.000	USD	141.291,26	0,01
Amazon.com, Inc. 31,53 %	20.01.2023	1.300.000	USD	166.322,31	0,02
Amazon.com, Inc. 31,37 %	20.01.2023	2.500.000	USD	295.381,38	0,03
Amazon.com, Inc. 30,00 %	20.01.2023	1.500.000	USD	198.004,20	0,02
Amazon.com, Inc. 34,84 %	20.01.2023	1.200.000	USD	168.162,13	0,02
Amazon.com, Inc. 33,21 %	20.01.2023	2.500.000	USD	407.858,19	0,04
Amazon.com, Inc. 33,20 %	20.01.2023	2.500.000	USD	370.342,41	0,03
Amazon.com, Inc. 32,79 %	20.01.2023	2.000.000	USD	275.905,51	0,03
Amazon.com, Inc. 33,11 %	16.06.2023	1.200.000	USD	186.105,13	0,02
Amazon.com, Inc. 31,38 %	20.01.2023	1.500.000	USD	226.331,88	0,02
Amazon.com, Inc. 29,40 %	20.01.2023	1.200.000	USD	169.514,92	0,02
Amazon.com, Inc. 35,83 %	20.01.2023	2.000.000	USD	258.578,76	0,02
Amazon.com, Inc. 31,24 %	20.01.2023	1.500.000	USD	178.539,48	0,02
Amazon.com, Inc. 37,39 %	20.01.2023	1.800.000	USD	206.290,51	0,02
Amazon.com, Inc. 30,10 %	20.01.2023	3.000.000	USD	484.673,71	0,05
Amazon.com, Inc. 30,20 %	20.01.2023	1.111.100	USD	161.172,24	0,02

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Amazon.com, Inc. 31,71 %	20.01.2023	550.000	USD	-96.529,50	-0,01
Amazon.com, Inc. 30,86 %	20.01.2023	1.500.000	USD	183.535,18	0,02
Amazon.com, Inc. 32,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	349.153,43	0,03
Amazon.com, Inc. 31,17 %	20.01.2023	2.000.000	USD	300.687,71	0,03
Amazon.com, Inc. 41,48 %	19.01.2024	2.000.000	USD	61.192,07	0,01
Amazon.com, Inc. 32,50 %	20.01.2023	1.800.000	USD	281.888,88	0,03
American Electric Power Co., Inc. 26,39 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-10.978,99	0,00
American Electric Power Co., Inc. 22,00 %	20.01.2023	2.000.000	USD	33.739,27	0,00
American Electric Power Co., Inc. 23,28 %	20.01.2023	2.500.000	USD	11.170,56	0,00
American Electric Power Co., Inc. 23,73 %	20.01.2023	2.000.000	USD	6.316,14	0,00
American Electric Power Co., Inc. 27,73 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-68.192,49	-0,01
American Electric Power Co., Inc. 21,50 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-3.032,42	0,00
American Electric Power Co., Inc. 25,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-2.667,51	0,00
American Electric Power Co., Inc. 22,04 %	20.01.2023	1.200.000	USD	24.025,60	0,00
American Express Co. 32,49 %	20.01.2023	2.500.000	USD	32.543,76	0,00
American Express Co. 33,00 %	20.01.2023	1.200.000	USD	13.345,85	0,00
American International Group, Inc. 39,74 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-87.648,47	-0,01
American International Group, Inc. 36,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-58.698,06	-0,01
American International Group, Inc. 38,23 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-134.202,93	-0,01
Amgen, Inc. 28,93 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-47.762,42	0,00
Amgen, Inc. 29,17 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-27.483,40	0,00
Amgen, Inc. 28,84 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-115.171,17	-0,01
Amgen, Inc. 29,98 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-40.557,84	0,00
Amgen, Inc. 27,72 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-16.142,01	0,00
Amgen, Inc. 27,25 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-22.408,11	0,00
Amgen, Inc. 29,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-45.821,34	0,00
Analog Devices, Inc. 34,27 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-2.133,24	0,00
Analog Devices, Inc. 35,00 %	19.01.2024	1.500.000	USD	2.120,27	0,00
Analog Devices, Inc. 36,27 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-13.467,53	0,00
Analog Devices, Inc. 34,94 %	19.01.2024	1.000.000	USD	1.993,01	0,00
Analog Devices, Inc. 35,70 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-1.131,50	0,00
Analog Devices, Inc. 35,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-2.505,95	0,00
Analog Devices, Inc. 30,88 %	20.01.2023	1.500.000	USD	31.484,99	0,00
Analog Devices, Inc. 37,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-38.788,91	0,00
Aon Corp. 31,62 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-39.912,98	0,00
Aon Corp. 30,50 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-47.724,19	0,00
Aon Corp. 29,45 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-29.192,92	0,00
Aon Corp. 29,76 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-41.944,47	0,00
Aon Corp. 28,47 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-29.677,92	0,00
Aon Corp. 29,90 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-15.399,73	0,00
Aon Corp. 30,52 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-32.166,08	0,00
Aon Corp. 32,45 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-67.422,76	-0,01
Aon Corp. 31,27 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-29.196,98	0,00
Aon Corp. 28,74 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-17.663,64	0,00
Aon Corp. 31,88 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-66.803,59	-0,01
Aon Corp. 30,01 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-38.049,77	0,00
Aon Corp. 31,84 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-44.948,15	0,00
Aon Corp. 30,37 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-24.853,62	0,00
Aon Corp. 33,74 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-44.971,54	0,00
Aon Corp. 28,68 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-3.982,50	0,00
Aon Corp. 33,17 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-55.306,65	-0,01
Aon Corp. 31,28 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-45.368,81	0,00
Aon Corp. 27,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	5.412,58	0,00
Aon Corp. 30,18 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-24.221,80	0,00
Aon Corp. 31,73 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-32.951,27	0,00
Aon Corp. 29,33 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-47.553,71	0,00
Aon Corp. 30,89 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-41.848,66	0,00
Aon Corp. 33,75 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-111.661,45	-0,01
Aon Corp. 29,80 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-61.274,63	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Aon Corp. 33,55 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-45.579,76	0,00
Aon Corp. 28,53 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-35.128,36	0,00
Apple, Inc. 33,66 %	20.01.2023	2.000.000	USD	26.291,65	0,00
Apple, Inc. 35,68 %	19.01.2024	1.000.000	USD	11.829,67	0,00
Apple, Inc. 34,39 %	19.01.2024	1.500.000	USD	36.142,11	0,00
Apple, Inc. 35,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	22.583,53	0,00
Apple, Inc. 34,13 %	19.01.2024	2.500.000	USD	63.123,24	0,01
Apple, Inc. 33,04 %	20.01.2023	2.500.000	USD	74.885,02	0,01
Apple, Inc. 32,95 %	20.01.2023	2.000.000	USD	58.227,39	0,01
Apple, Inc. 31,46 %	20.01.2023	1.500.000	USD	49.749,77	0,00
Apple, Inc. 34,59 %	20.01.2023	2.000.000	USD	28.703,57	0,00
Apple, Inc. 33,06 %	20.01.2023	1.600.000	USD	64.834,50	0,01
Apple, Inc. 35,83 %	16.06.2023	1.900.000	USD	29.277,52	0,00
Apple, Inc. 35,34 %	19.01.2024	2.000.000	USD	37.841,89	0,00
Apple, Inc. 31,89 %	19.01.2024	2.000.000	USD	94.186,20	0,01
Apple, Inc. 36,47 %	16.06.2023	1.800.000	USD	27.548,18	0,00
Apple, Inc. 31,00 %	20.01.2023	3.000.000	USD	109.295,94	0,01
Apple, Inc. 33,52 %	20.01.2023	1.300.000	USD	44.571,67	0,00
Apple, Inc. 35,94 %	19.01.2024	2.500.000	USD	23.789,72	0,00
Apple, Inc. 32,92 %	20.01.2023	2.000.000	USD	62.341,61	0,01
Apple, Inc. 34,57 %	20.01.2023	2.000.000	USD	37.190,61	0,00
Apple, Inc. 34,20 %	20.01.2023	2.000.000	USD	52.080,82	0,00
Apple, Inc. 33,00 %	19.01.2024	2.500.000	USD	93.207,36	0,01
Apple, Inc. 33,68 %	16.06.2023	2.500.000	USD	113.795,74	0,01
Apple, Inc. 32,10 %	20.01.2023	1.800.000	USD	75.047,12	0,01
Apple, Inc. 31,26 %	20.01.2023	2.500.000	USD	17.715,30	0,00
Apple, Inc. 36,30 %	19.01.2024	1.300.000	USD	5.080,38	0,00
Apple, Inc. 33,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	58.862,18	0,01
Apple, Inc. 35,72 %	19.01.2024	1.000.000	USD	8.682,51	0,00
Apple, Inc. 32,07 %	20.01.2023	1.300.000	USD	64.307,60	0,01
Apple, Inc. 37,00 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-24,91	0,00
Apple, Inc. 37,53 %	19.01.2024	1.200.000	USD	1.190,18	0,00
Apple, Inc. 36,24 %	19.01.2024	2.000.000	USD	13.491,89	0,00
Apple, Inc. 33,88 %	20.01.2023	2.500.000	USD	60.403,59	0,01
Apple, Inc. 32,03 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-273,62	0,00
Apple, Inc. 33,10 %	20.01.2023	3.000.000	USD	99.242,39	0,01
Apple, Inc. 32,20 %	16.06.2023	2.000.000	USD	120.761,70	0,01
Apple, Inc. 37,44 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-6.587,09	0,00
Apple, Inc. 34,38 %	20.01.2023	2.000.000	USD	34.452,08	0,00
Apple, Inc. 33,54 %	20.01.2023	1.100.000	USD	32.664,11	0,00
Apple, Inc. 35,59 %	19.01.2024	1.500.000	USD	12.638,28	0,00
Apple, Inc. 32,41 %	20.01.2023	1.500.000	USD	506,67	0,00
Apple, Inc. 35,71 %	16.06.2023	1.500.000	USD	24.690,40	0,00
Apple, Inc. 36,18 %	19.01.2024	2.000.000	USD	11.417,83	0,00
Apple, Inc. 36,21 %	19.01.2024	1.300.000	USD	4.781,49	0,00
Apple, Inc. 32,93 %	20.01.2023	1.700.000	USD	69.055,19	0,01
Apple, Inc. 35,27 %	19.01.2024	1.500.000	USD	23.557,75	0,00
Apple, Inc. 34,25 %	16.06.2023	1.500.000	USD	46.220,73	0,00
Apple, Inc. 34,26 %	16.06.2023	1.200.000	USD	43.240,60	0,00
Apple, Inc. 35,98 %	16.06.2023	1.500.000	USD	22.442,56	0,00
Apple, Inc. 34,98 %	20.01.2023	1.400.000	USD	27.259,14	0,00
Apple, Inc. 34,02 %	19.01.2024	2.000.000	USD	58.191,33	0,01
Apple, Inc. 33,47 %	19.01.2024	1.200.000	USD	34.158,45	0,00
Apple, Inc. 36,78 %	16.06.2023	1.700.000	USD	7.000,10	0,00
Applied Materials, Inc. 46,20 %	20.01.2023	1.100.000	USD	34.742,24	0,00
Arrow Electronics, Inc. 30,53 %	19.01.2024	1.000.000	USD	80.061,86	0,01
Assicurazioni Generali SpA 26,62 %	15.12.2023	1.900.000	EUR	-42.353,26	0,00
Assicurazioni Generali SpA 25,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-18.469,03	0,00
Assicurazioni Generali SpA 27,01 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-57.804,80	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Assicurazioni Generali SpA 24,11 %	15.12.2023	2.001.000	EUR	3.533,27	0,00
Assicurazioni Generali SpA 26,55 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-38.073,48	0,00
Assicurazioni Generali SpA 26,72 %	15.06.2023	2.000.000	EUR	-47.232,88	0,00
Assicurazioni Generali SpA 25,92 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-40.179,41	0,00
Assicurazioni Generali SpA 27,07 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	-30.554,51	0,00
AT&T, Inc. 25,41 %	20.01.2023	2.500.000	USD	21.419,16	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 28,44 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-247,68	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 28,70 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-20.532,02	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-31.549,26	0,00
AXA S.A. 31,57 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-46.222,58	0,00
AXA S.A. 28,78 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-14.673,46	0,00
AXA S.A. 31,10 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-77.768,18	-0,01
AXA S.A. 28,37 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-15.613,03	0,00
AXA S.A. 29,74 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-70.998,48	-0,01
AXA S.A. 28,97 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-55.998,46	-0,01
AXA S.A. 28,76 %	15.12.2023	2.001.000	EUR	-33.970,22	0,00
AXA S.A. 31,36 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-101.699,20	-0,01
AXA S.A. 29,78 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-39.252,93	0,00
AXA S.A. 32,94 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	119.355,72	0,01
AXA S.A. 27,23 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	18.469,65	0,00
AXA S.A. 28,95 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-18.895,90	0,00
AXA S.A. 31,02 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-60.434,13	-0,01
AXA S.A. 32,80 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-67.341,06	-0,01
AXA S.A. 30,44 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-96.977,55	-0,01
AXA S.A. 29,75 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-57.333,80	-0,01
AXA S.A. 31,16 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-72.597,04	-0,01
AXA S.A. 30,24 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-44.142,39	0,00
AXA S.A. 31,08 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-60.454,14	-0,01
AXA S.A. 29,58 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-38.612,82	0,00
AXA S.A. 30,47 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-39.735,20	0,00
AXA S.A. 31,75 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-94.583,92	-0,01
AXA S.A. 32,65 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	77.239,79	0,01
AXA S.A. 28,35 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-45.546,36	0,00
AXA S.A. 30,90 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	-63.538,58	-0,01
AXA S.A. 31,34 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-82.972,78	-0,01
Ball Corp. 32,22 %	16.06.2023	2.000.000	USD	233.238,60	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 39,43 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-118.923,81	-0,01
Banco Santander S.A. 36,19 %	15.12.2023	1.900.000	EUR	-37.954,32	0,00
Bank of America Corp. 30,81 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-7.326,19	0,00
Bank of America Corp. 31,56 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-20.487,80	0,00
Bank of America Corp. 36,33 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-76.675,71	-0,01
Bank of America Corp. 32,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	2.240,29	0,00
Bank of America Corp. 32,50 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-21.647,77	0,00
Bank of America Corp. 35,42 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-61.205,03	-0,01
Bank of America Corp. 33,47 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-11.707,63	0,00
Bank of America Corp. 31,40 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-20.333,55	0,00
Bank of America Corp. 32,30 %	20.01.2023	1.800.000	USD	11.476,13	0,00
Bank of America Corp. 35,08 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-28.868,15	0,00
Bank of America Corp. 31,40 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-14.899,74	0,00
Bank of America Corp. 32,09 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-41.581,89	0,00
Bank of America Corp. 33,86 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-21.231,78	0,00
Bank of America Corp. 38,32 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-63.846,74	-0,01
Bank of America Corp. 33,98 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-25.534,03	0,00
Bank of America Corp. 35,42 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-44.327,16	0,00
Bank of America Corp. 33,44 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-23.905,21	0,00
Bank of America Corp. 36,61 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-68.320,62	-0,01
Bank of America Corp. 37,94 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-52.147,34	-0,01
Bank of America Corp. 34,19 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-12.220,60	0,00
Bank of America Corp. 36,55 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-71.167,17	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Bank of America Corp. 34,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-14.155,40	0,00
Bank of America Corp. 36,86 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-67.946,37	-0,01
Bank of America Corp. 32,99 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-25.196,10	0,00
Bank of America Corp. 33,80 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-46.599,20	0,00
Bank of America Corp. 39,91 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-91.319,01	-0,01
Bank of America Corp. 38,76 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-75.933,30	-0,01
Bank of America Corp. 32,25 %	20.01.2023	2.000.000	USD	10.117,61	0,00
Bank of America Corp. 32,25 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-48.813,84	0,00
Bank of America Corp. 37,87 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-99.222,58	-0,01
Bank of America Corp. 32,51 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-13.642,13	0,00
Bank of America Corp. 31,58 %	20.01.2023	2.000.000	USD	6.180,28	0,00
Bank of America Corp. 32,77 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-13.894,35	0,00
Bank of America Corp. 33,21 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-12.818,80	0,00
Bank of America Corp. 40,56 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-104.103,89	-0,01
Bank of America Corp. 37,09 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-68.003,43	-0,01
Bank of America Corp. 35,15 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-41.050,72	0,00
Bank of America Corp. 36,02 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-50.850,81	0,00
Bank of America Corp. 36,16 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-52.775,05	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 28,64 %	20.01.2023	1.500.000	USD	9.801,32	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 31,98 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-23.979,65	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 36,07 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-96.926,38	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 36,10 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-81.968,94	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 33,84 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-40.542,47	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 29,70 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-2.975,42	0,00
Bank of New York Mellon Corp./The 36,06 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-74.437,14	-0,01
Bank of New York Mellon Corp./The 34,46 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-34.469,54	0,00
Barclays PLC 40,89 %	16.06.2023	1.657.400	GBP	-148.069,14	-0,01
Barclays PLC 36,12 %	16.06.2023	1.185.000	GBP	-59.665,79	-0,01
Barclays PLC 36,11 %	15.12.2023	1.269.000	GBP	-51.040,25	0,00
Bayer AG 31,75 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	3.095,24	0,00
Bayer AG 35,98 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-43.919,76	0,00
Bayer AG 36,34 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-41.932,24	0,00
Bayer AG 32,35 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-5.174,94	0,00
Bayerische Motoren Werke AG 36,45 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-80.555,51	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG 33,44 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-42.910,89	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 23,75 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-88.675,63	-0,01
Best Buy Co., Inc. 36,72 %	20.01.2023	1.500.000	USD	77.257,57	0,01
Best Buy Co., Inc. 37,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	101.866,01	0,01
Best Buy Co., Inc. 36,10 %	20.01.2023	2.500.000	USD	135.836,69	0,01
Best Buy Co., Inc. 37,73 %	20.01.2023	1.500.000	USD	102.133,63	0,01
Best Buy Co., Inc. 35,85 %	20.01.2023	2.500.000	USD	133.821,60	0,01
BlackRock, Inc. 28,40 %	20.01.2023	1.200.000	USD	53.599,66	0,00
BlackRock, Inc. 26,64 %	20.01.2023	1.500.000	USD	82.441,63	0,01
BlackRock, Inc. 27,84 %	20.01.2023	1.500.000	USD	64.829,37	0,01
BlackRock, Inc. 29,30 %	20.01.2023	2.500.000	USD	83.004,03	0,01
BlackRock, Inc. 26,74 %	20.01.2023	1.500.000	USD	80.654,32	0,01
BlackRock, Inc. 31,39 %	20.01.2023	2.000.000	USD	68.652,50	0,01
BlackRock, Inc. 25,81 %	20.01.2023	2.500.000	USD	155.777,98	0,01
BNP Paribas S.A. 36,10 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	-89.722,86	-0,01
BNP Paribas S.A. 37,20 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-77.529,10	-0,01
BNP Paribas S.A. 35,80 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-60.114,77	-0,01
BNP Paribas S.A. 37,49 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-69.772,54	-0,01
BNP Paribas S.A. 36,70 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-90.883,65	-0,01
BNP Paribas S.A. 36,60 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-92.076,91	-0,01
BNP Paribas S.A. 34,66 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-37.553,42	0,00
BNP Paribas S.A. 36,41 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-86.882,14	-0,01
Booking Holdings, Inc. 32,46 %	20.01.2023	2.500.000	USD	161.652,43	0,02
Booking Holdings, Inc. 33,38 %	20.01.2023	2.500.000	USD	140.159,15	0,01
Boston Scientific Corp. 33,19 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-73.293,66	-0,01

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



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
BP PLC 34,03 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-16.621,06	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 26,21 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-63.178,07	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 27,38 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-111.728,92	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 23,74 %	19.01.2024	1.000.000	USD	6.611,25	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 27,69 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-81.905,62	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 28,83 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-50.566,99	0,00
British American Tobacco PLC 31,18 %	15.12.2023	1.031.600	GBP	-98.340,20	-0,01
British American Tobacco PLC 25,26 %	15.12.2023	1.302.000	GBP	-42.058,64	0,00
British American Tobacco PLC 26,38 %	15.12.2023	1.033.008	GBP	-52.934,38	-0,01
Broadcom, Inc. 38,24 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-32.439,90	0,00
Broadcom, Inc. 33,76 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-1.168,56	0,00
Broadcom, Inc. 30,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	127.634,31	0,01
Broadcom, Inc. 33,60 %	20.01.2023	1.500.000	USD	730,59	0,00
Broadcom, Inc. 38,39 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-26.598,40	0,00
Broadcom, Inc. 33,39 %	20.01.2023	2.500.000	USD	88.883,86	0,01
Broadcom, Inc. 35,91 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-465,93	0,00
Broadcom, Inc. 37,65 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-38.349,55	0,00
Broadcom, Inc. 33,56 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-15.418,19	0,00
Broadcom, Inc. 36,95 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-27.701,71	0,00
Broadcom, Inc. 37,23 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-4.683,25	0,00
Broadcom, Inc. 35,30 %	20.01.2023	1.300.000	USD	12.155,35	0,00
Broadcom, Inc. 37,39 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-14.996,52	0,00
Broadcom, Inc. 35,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-5.785,07	0,00
Broadcom, Inc. 33,32 %	20.01.2023	1.700.000	USD	2.175,80	0,00
Broadcom, Inc. 32,19 %	20.01.2023	1.500.000	USD	16.678,00	0,00
Broadcom, Inc. 33,32 %	20.01.2023	1.500.000	USD	9.769,08	0,00
Broadcom, Inc. 41,56 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-88.088,01	-0,01
Broadcom, Inc. 37,74 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-33.749,86	0,00
Broadcom, Inc. 34,45 %	20.01.2023	1.300.000	USD	5.886,39	0,00
Broadcom, Inc. 38,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-30.082,05	0,00
Broadcom, Inc. 36,02 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-2.666,35	0,00
Broadcom, Inc. 34,21 %	20.01.2023	2.000.000	USD	39.616,45	0,00
Broadcom, Inc. 33,60 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-8.755,30	0,00
Broadcom, Inc. 33,62 %	20.01.2023	2.000.000	USD	55.565,61	0,01
Broadcom, Inc. 34,03 %	20.01.2023	2.500.000	USD	776,91	0,00
Broadcom, Inc. 41,00 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-50.731,23	0,00
Broadcom, Inc. 36,73 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-18.582,75	0,00
Broadcom, Inc. 38,46 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-27.314,33	0,00
Broadcom, Inc. 36,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-12.862,00	0,00
Carrefour S.A. 31,30 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-65.858,46	-0,01
Carrefour S.A. 31,52 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-42.583,92	0,00
Carrefour S.A. 30,60 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-39.314,53	0,00
Carrefour S.A. 33,99 %	15.12.2023	1.900.000	EUR	-117.103,21	-0,01
Caterpillar, Inc. 34,65 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-20.231,48	0,00
Caterpillar, Inc. 35,40 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-19.284,38	0,00
Caterpillar, Inc. 36,39 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-26.615,62	0,00
Caterpillar, Inc. 35,85 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-10.217,07	0,00
Caterpillar, Inc. 32,24 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-13.696,68	0,00
Caterpillar, Inc. 32,92 %	20.01.2023	2.000.000	USD	9.149,22	0,00
Caterpillar, Inc. 31,90 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-9.927,51	0,00
Caterpillar, Inc. 33,42 %	20.01.2023	1.300.000	USD	5.987,34	0,00
Caterpillar, Inc. 33,86 %	20.01.2023	1.700.000	USD	2.070,08	0,00
Caterpillar, Inc. 34,88 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-9.902,45	0,00
Caterpillar, Inc. 36,61 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-16.816,00	0,00
Caterpillar, Inc. 32,59 %	20.01.2023	1.600.000	USD	23.262,94	0,00
Caterpillar, Inc. 36,50 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-89.600,28	-0,01
Caterpillar, Inc. 32,64 %	16.06.2023	1.200.000	USD	27.371,93	0,00
Charles Schwab Corp./The 35,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-33.927,40	0,00
Charles Schwab Corp./The 35,13 %	20.01.2023	2.000.000	USD	19.865,54	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Chevron Corp. 28,74 %	20.01.2023	1.500.000	USD	14.826,35	0,00
Chevron Corp. 30,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	28.978,95	0,00
Chevron Corp. 28,79 %	20.01.2023	2.000.000	USD	56.730,25	0,01
Chevron Corp. 29,42 %	20.01.2023	1.700.000	USD	6.532,43	0,00
Chevron Corp. 31,88 %	20.01.2023	2.000.000	USD	21.737,89	0,00
Chevron Corp. 29,40 %	20.01.2023	2.000.000	USD	73.004,94	0,01
Chevron Corp. 35,52 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-48.345,94	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 32,66 %	20.01.2023	1.500.000	USD	40.722,77	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 32,63 %	20.01.2023	1.500.000	USD	53.155,61	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 34,20 %	20.01.2023	1.200.000	USD	24.152,85	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 41,34 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-33.761,68	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 35,01 %	20.01.2023	1.300.000	USD	23.874,48	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 39,71 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-28.988,00	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 36,61 %	20.01.2023	1.100.000	USD	27.736,25	0,00
Chipotle Mexican Grill, Inc. 39,24 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-29.751,12	0,00
Chubb Ltd. 26,53 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-11.885,47	0,00
Cie de Saint-Gobain 34,61 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	9.572,09	0,00
Cigna Corp. 33,95 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-48.453,34	0,00
Cigna Corp. 36,06 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-95.434,96	-0,01
Cigna Corp. 33,20 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-104.390,69	-0,01
Cigna Corp. 34,96 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-49.751,01	0,00
Cigna Corp. 37,17 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-137.284,23	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,73 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-40.638,09	0,00
Cisco Systems, Inc. 30,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-21.624,58	0,00
Cisco Systems, Inc. 28,87 %	20.01.2023	1.300.000	USD	21.042,74	0,00
Cisco Systems, Inc. 33,16 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-86.452,35	-0,01
Cisco Systems, Inc. 29,48 %	20.01.2023	1.300.000	USD	15.240,66	0,00
Cisco Systems, Inc. 31,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-28.178,29	0,00
Cisco Systems, Inc. 32,41 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-41.863,62	0,00
Cisco Systems, Inc. 30,15 %	20.01.2023	1.800.000	USD	749,18	0,00
Cisco Systems, Inc. 32,33 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-75.549,35	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,67 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-60.606,65	-0,01
Cisco Systems, Inc. 32,08 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-27.998,78	0,00
Cisco Systems, Inc. 26,64 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-7.383,60	0,00
Cisco Systems, Inc. 30,47 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-25.939,10	0,00
Cisco Systems, Inc. 29,35 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-5.171,25	0,00
Cisco Systems, Inc. 30,34 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-26.422,60	0,00
Cisco Systems, Inc. 30,09 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-30.836,54	0,00
Cisco Systems, Inc. 29,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-8.495,64	0,00
Citigroup, Inc. 33,61 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-879,15	0,00
Citigroup, Inc. 34,33 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-11.868,45	0,00
Citigroup, Inc. 32,45 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-46.244,85	0,00
Citigroup, Inc. 32,42 %	20.01.2023	3.000.000	USD	42.163,12	0,00
Citigroup, Inc. 33,64 %	20.01.2023	1.100.000	USD	6.373,17	0,00
Citigroup, Inc. 33,20 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-42.437,30	0,00
Citigroup, Inc. 33,50 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-14.665,89	0,00
Citigroup, Inc. 34,29 %	20.01.2023	1.300.000	USD	2.726,14	0,00
Citigroup, Inc. 33,40 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-30.576,65	0,00
Citigroup, Inc. 31,16 %	20.01.2023	2.000.000	USD	20.432,91	0,00
Citigroup, Inc. 33,01 %	20.01.2023	1.700.000	USD	25.139,38	0,00
Citigroup, Inc. 33,64 %	20.01.2023	1.300.000	USD	12.141,61	0,00
Citigroup, Inc. 31,76 %	20.01.2023	1.500.000	USD	2.707,60	0,00
Citigroup, Inc. 30,90 %	20.01.2023	3.000.000	USD	28.249,06	0,00
Citigroup, Inc. 33,80 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-12.096,21	0,00
Citigroup, Inc. 35,72 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-4.994,57	0,00
Citigroup, Inc. 34,92 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-6.574,65	0,00
Citigroup, Inc. 33,13 %	20.01.2023	2.000.000	USD	3.991,40	0,00
Citigroup, Inc. 32,98 %	20.01.2023	2.000.000	USD	14.591,82	0,00
Citigroup, Inc. 34,10 %	20.01.2023	2.000.000	USD	1.309,53	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Citigroup, Inc. 32,02 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-2.362,82	0,00
Citigroup, Inc. 32,94 %	20.01.2023	2.500.000	USD	8.815,09	0,00
Citigroup, Inc. 32,28 %	20.01.2023	2.000.000	USD	8.478,09	0,00
Citigroup, Inc. 28,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-12.000,63	0,00
Citigroup, Inc. 32,62 %	20.01.2023	3.000.000	USD	47.284,70	0,00
Citigroup, Inc. 32,70 %	20.01.2023	1.800.000	USD	25.787,14	0,00
Citigroup, Inc. 33,42 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-18.079,61	0,00
Citigroup, Inc. 32,42 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-35.112,33	0,00
Citigroup, Inc. 32,72 %	20.01.2023	2.500.000	USD	30.973,11	0,00
Citigroup, Inc. 33,09 %	16.06.2023	1.200.000	USD	22.422,06	0,00
Citigroup, Inc. 37,70 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-46.369,94	0,00
CME Group, Inc. 33,54 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-76.794,56	-0,01
CME Group, Inc. 33,76 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-112.610,60	-0,01
CME Group, Inc. 33,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-63.957,18	-0,01
CME Group, Inc. 31,51 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-56.551,12	-0,01
CME Group, Inc. 30,53 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-33.768,63	0,00
CME Group, Inc. 29,29 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-70.183,13	-0,01
CME Group, Inc. 34,08 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-109.701,85	-0,01
CME Group, Inc. 31,55 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-68.148,63	-0,01
CME Group, Inc. 32,63 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-128.269,41	-0,01
CME Group, Inc. 35,45 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-148.909,44	-0,01
CME Group, Inc. 32,36 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.375,27	-0,01
CME Group, Inc. 33,24 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-67.527,80	-0,01
CME Group, Inc. 32,80 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-50.501,51	0,00
CME Group, Inc. 32,02 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-89.208,72	-0,01
CME Group, Inc. 32,23 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-63.997,39	-0,01
CME Group, Inc. 32,08 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-65.739,13	-0,01
Cognizant Technology Solutions Corp. 33,00 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-26.695,72	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 31,16 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-1.443,24	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 33,20 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-21.259,59	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 30,91 %	20.01.2023	1.500.000	USD	3.518,25	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 33,53 %	19.01.2024	1.500.000	USD	25.956,48	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 31,02 %	20.01.2023	2.000.000	USD	40.477,86	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 34,79 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-24.521,84	0,00
Cognizant Technology Solutions Corp. 31,48 %	20.01.2023	2.500.000	USD	87.505,44	0,01
Comcast Corp. 32,20 %	20.01.2023	1.300.000	USD	3.844,02	0,00
Comcast Corp. 28,90 %	16.06.2023	1.200.000	USD	59.007,27	0,01
Comcast Corp. 27,08 %	20.01.2023	550.000	USD	-28.732,66	0,00
Comcast Corp. 32,66 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-37.520,77	0,00
Comcast Corp. 27,82 %	20.01.2023	1.300.000	USD	55.414,61	0,01
Comcast Corp. 32,29 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-6.710,87	0,00
Comcast Corp. 28,40 %	20.01.2023	1.111.100	USD	13.127,81	0,00
Comcast Corp. 35,92 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-30.277,39	0,00
Constellation Brands, Inc. 30,03 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-23.708,68	0,00
Constellation Brands, Inc. 29,34 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-23.075,99	0,00
Constellation Brands, Inc. 31,44 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-80.698,58	-0,01
Constellation Brands, Inc. 27,50 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-24.183,98	0,00
Constellation Brands, Inc. 24,19 %	19.01.2024	1.200.000	USD	26.908,27	0,00
Constellation Brands, Inc. 30,26 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-53.645,91	-0,01
Constellation Brands, Inc. 30,84 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-38.147,12	0,00
Constellation Brands, Inc. 32,51 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-69.855,04	-0,01
Corning, Inc. 36,90 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-106.700,30	-0,01
Corning, Inc. 31,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	21.850,74	0,00
Corning, Inc. 32,77 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-50.698,56	0,00
Corning, Inc. 32,46 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-46.088,02	0,00
Corning, Inc. 32,42 %	19.01.2024	1.000.000	USD	2.619,78	0,00
Credit Agricole S.A. 33,40 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-133.071,03	-0,01
Credit Agricole S.A. 34,60 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-81.747,06	-0,01
Credit Agricole S.A. 40,16 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	219.968,00	0,02

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Credit Agricole S.A. 33,40 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-54.808,53	-0,01
Credit Agricole S.A. 32,13 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	8.769,90	0,00
Credit Agricole S.A. 33,75 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-46.609,73	0,00
Credit Agricole S.A. 40,70 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	165.863,95	0,02
Credit Agricole S.A. 39,61 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-227.970,52	-0,02
Credit Agricole S.A. 37,30 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-119.722,39	-0,01
CSX Corp. 32,02 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-23.825,36	0,00
CSX Corp. 33,94 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-59.245,41	-0,01
CSX Corp. 30,39 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-31.860,13	0,00
CSX Corp. 32,43 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-49.414,51	0,00
CSX Corp. 33,68 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-130.765,56	-0,01
CSX Corp. 34,76 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-72.613,15	-0,01
CSX Corp. 31,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-20.501,21	0,00
CSX Corp. 31,63 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-21.505,65	0,00
CSX Corp. 31,94 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-131.997,98	-0,01
Cummins, Inc. 36,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-112.082,09	-0,01
Cummins, Inc. 33,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-36.847,97	0,00
Cummins, Inc. 30,29 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-32.803,40	0,00
Cummins, Inc. 32,04 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-31.557,54	0,00
Cummins, Inc. 33,75 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-112.807,35	-0,01
Cummins, Inc. 34,13 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-85.777,50	-0,01
Cummins, Inc. 32,60 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-44.661,80	0,00
Cummins, Inc. 33,65 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-58.579,71	-0,01
Cummins, Inc. 32,11 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-25.491,64	0,00
Cummins, Inc. 34,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-44.709,29	0,00
Cummins, Inc. 30,92 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-51.856,72	0,00
Cummins, Inc. 37,18 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-56.378,02	-0,01
Cummins, Inc. 29,25 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-41.948,39	0,00
Cummins, Inc. 33,38 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-50.303,79	0,00
Cummins, Inc. 32,73 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-28.340,50	0,00
Cummins, Inc. 29,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	9.963,86	0,00
Cummins, Inc. 33,16 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-40.620,36	0,00
Cummins, Inc. 33,57 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-57.994,07	-0,01
Cummins, Inc. 35,83 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-155.131,08	-0,01
Cummins, Inc. 31,34 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-40.324,85	0,00
Cummins, Inc. 29,29 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-24.324,25	0,00
Cummins, Inc. 33,20 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-101.172,36	-0,01
Cummins, Inc. 34,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-41.556,50	0,00
Cummins, Inc. 33,70 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-116.192,87	-0,01
Cummins, Inc. 36,45 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-88.958,29	-0,01
Cummins, Inc. 37,62 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-140.329,50	-0,01
Cummins, Inc. 31,76 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-77.063,35	-0,01
Cummins, Inc. 34,40 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-75.074,35	-0,01
Cummins, Inc. 30,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-6.746,88	0,00
Cummins, Inc. 34,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-51.903,88	-0,01
Cummins, Inc. 32,74 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-46.225,48	0,00
Cummins, Inc. 34,43 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-42.563,10	0,00
Cummins, Inc. 31,99 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-73.774,46	-0,01
Cummins, Inc. 33,81 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-40.780,72	0,00
Cummins, Inc. 32,60 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-27.880,10	0,00
Cummins, Inc. 36,14 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-162.232,44	-0,02
Cummins, Inc. 31,60 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-80.068,08	-0,01
Cummins, Inc. 33,82 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-89.336,70	-0,01
Cummins, Inc. 33,69 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-117.238,82	-0,01
Cummins, Inc. 29,97 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-27.526,71	0,00
Cummins, Inc. 37,21 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-108.905,25	-0,01
Cummins, Inc. 33,34 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-85.759,07	-0,01
Cummins, Inc. 28,23 %	20.01.2023	550.000	USD	2.766,09	0,00
Cummins, Inc. 30,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-10.622,12	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Cummins, Inc. 29,97 %	19.01.2024	2.000.000	USD	7.739,01	0,00
Cummins, Inc. 31,69 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-33.886,28	0,00
Cummins, Inc. 31,43 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-122.824,61	-0,01
Cummins, Inc. 28,80 %	16.06.2023	1.200.000	USD	4.824,27	0,00
Cummins, Inc. 36,37 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-70.288,08	-0,01
Cummins, Inc. 35,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-38.683,44	0,00
Cummins, Inc. 33,10 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-106.929,72	-0,01
Cummins, Inc. 35,01 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-42.785,39	0,00
Cummins, Inc. 31,29 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-123.417,30	-0,01
Cummins, Inc. 32,16 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-60.502,38	-0,01
Cummins, Inc. 32,46 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-81.905,64	-0,01
Cummins, Inc. 32,01 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-78.437,75	-0,01
CVS Health Corp. 29,08 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-20.183,88	0,00
CVS Health Corp. 29,45 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-6.484,82	0,00
CVS Health Corp. 32,17 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-44.446,98	0,00
CVS Health Corp. 28,20 %	19.01.2024	1.500.000	USD	12.848,82	0,00
CVS Health Corp. 29,15 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-2.849,25	0,00
CVS Health Corp. 30,04 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-10.353,96	0,00
CVS Health Corp. 28,07 %	19.01.2024	1.500.000	USD	6.529,71	0,00
CVS Health Corp. 29,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-11.453,08	0,00
CVS Health Corp. 28,73 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-8.208,78	0,00
CVS Health Corp. 32,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-44.257,99	0,00
CVS Health Corp. 32,01 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-79.359,71	-0,01
CVS Health Corp. 32,41 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-56.329,77	-0,01
CVS Health Corp. 30,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-26.160,29	0,00
CVS Health Corp. 28,68 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-21.016,99	0,00
CVS Health Corp. 31,15 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-37.211,23	0,00
CVS Health Corp. 31,17 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-18.251,69	0,00
CVS Health Corp. 29,97 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-54.487,62	-0,01
CVS Health Corp. 30,81 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-23.158,04	0,00
CVS Health Corp. 29,30 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-56.099,01	-0,01
CVS Health Corp. 28,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	4.528,37	0,00
CVS Health Corp. 28,21 %	19.01.2024	1.500.000	USD	10.865,68	0,00
CVS Health Corp. 30,80 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-41.278,03	0,00
CVS Health Corp. 31,89 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-48.480,95	0,00
CVS Health Corp. 31,80 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-60.985,98	-0,01
DAX Index 26,42 %	16.06.2023	8.000.000	EUR	394.392,16	0,04
DAX Index 25,60 %	16.06.2023	18.000.000	EUR	752.904,54	0,07
DAX Index 23,71 %	15.12.2023	19.200.000	EUR	263.794,56	0,02
DAX Index 25,20 %	15.12.2023	14.000.000	EUR	392.844,20	0,04
DAX Index 25,09 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	208.432,88	0,02
DAX Index 27,98 %	15.12.2023	5.000.000	EUR	-290.111,30	-0,03
DAX Index 25,34 %	15.12.2023	16.000.000	EUR	504.006,88	0,05
DAX Index 25,52 %	16.06.2023	7.000.000	EUR	178.127,04	0,02
DAX Index 66,35 %	15.12.2023	14.000.000	EUR	601.225,52	0,06
DAX Index 24,88 %	16.06.2023	14.000.000	EUR	487.255,16	0,05
DAX Index 25,06 %	16.06.2023	7.700.000	EUR	277.080,73	0,03
DAX Index 23,70 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	86.460,00	0,01
DAX Index 25,28 %	15.12.2023	15.000.000	EUR	429.533,40	0,04
DAX Index 23,77 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	112.900,95	0,01
DAX Index 25,31 %	15.12.2023	8.550.000	EUR	254.175,17	0,02
DAX Index 25,19 %	15.12.2023	12.000.000	EUR	331.464,24	0,03
Delta Air Lines, Inc. 38,51 %	20.01.2023	1.500.000	USD	110.868,49	0,01
Delta Air Lines, Inc. 38,60 %	20.01.2023	1.111.100	USD	72.284,15	0,01
Delta Air Lines, Inc. 50,71 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-80.717,87	-0,01
Delta Air Lines, Inc. 45,77 %	20.01.2023	550.000	USD	9.663,42	0,00
Deutsche Bank AG 41,21 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	18.480,46	0,00
Deutsche Boerse AG 27,58 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-91.714,50	-0,01
Deutsche Boerse AG 28,33 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-109.398,76	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Deutsche Boerse AG 31,34 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-67.492,85	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,77 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-110.717,80	-0,01
Deutsche Boerse AG 27,05 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-64.553,64	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,80 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	72.772,15	0,01
Deutsche Boerse AG 30,22 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	88.300,56	0,01
Deutsche Boerse AG 29,12 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-41.157,05	0,00
Deutsche Boerse AG 27,33 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-37.133,76	0,00
Deutsche Boerse AG 28,74 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-59.621,13	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,30 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-37.506,67	0,00
Deutsche Boerse AG 27,59 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-56.568,40	-0,01
Deutsche Boerse AG 28,70 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-46.755,64	0,00
Deutsche Boerse AG 27,93 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-100.426,68	-0,01
Deutsche Boerse AG 29,20 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-83.710,96	-0,01
Deutsche Telekom AG 23,27 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-58.835,55	-0,01
Deutsche Telekom AG 23,83 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-38.382,60	0,00
Deutsche Telekom AG 23,12 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-8.470,81	0,00
Deutsche Telekom AG 22,80 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-32.234,30	0,00
Deutsche Telekom AG 22,38 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-1.070,07	0,00
Deutsche Telekom AG 25,05 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-54.650,94	-0,01
Deutsche Telekom AG 25,00 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-33.339,86	0,00
Deutsche Telekom AG 27,66 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-64.820,18	-0,01
Deutsche Telekom AG 26,06 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-37.466,83	0,00
Deutsche Telekom AG 25,75 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-67.348,94	-0,01
Dollar General Corp. 26,80 %	20.01.2023	1.500.000	USD	26.981,87	0,00
Dominion Energy, Inc. 25,49 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-9.197,45	0,00
Dominion Energy, Inc. 25,71 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-7.002,01	0,00
Dominion Energy, Inc. 27,08 %	16.06.2023	1.500.000	USD	7.639,76	0,00
Dominion Energy, Inc. 24,90 %	20.01.2023	2.500.000	USD	3.984,29	0,00
Dow, Inc. 33,93 %	20.01.2023	550.000	USD	15.553,51	0,00
Dow, Inc. 34,49 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-80.241,35	-0,01
Dow, Inc. 36,80 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-62.513,30	-0,01
Dow, Inc. 37,27 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-142.510,47	-0,01
Dow, Inc. 34,08 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-69.936,38	-0,01
Dow, Inc. 32,60 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-60.956,40	-0,01
Dow, Inc. 34,88 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-45.746,75	0,00
Dow, Inc. 36,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-22.745,53	0,00
Dow, Inc. 37,87 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-94.346,07	-0,01
Dow, Inc. 34,54 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-80.032,33	-0,01
Dow, Inc. 37,63 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-76.245,79	-0,01
Dow, Inc. 35,40 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-26.296,79	0,00
Dow, Inc. 36,85 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-69.380,24	-0,01
Dow, Inc. 34,30 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-140.771,41	-0,01
Dow, Inc. 37,36 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-71.525,35	-0,01
Dow, Inc. 36,77 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-99.843,77	-0,01
Dow, Inc. 36,20 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-101.521,58	-0,01
Dow, Inc. 35,21 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-133.205,59	-0,01
Dow, Inc. 36,22 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-154.560,92	-0,01
Dow, Inc. 34,69 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-97.871,65	-0,01
Dow, Inc. 35,39 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-50.590,21	0,00
Dow, Inc. 37,14 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-90.678,63	-0,01
Dow, Inc. 33,89 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-64.088,69	-0,01
Dow, Inc. 35,93 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-161.992,08	-0,02
Dow, Inc. 36,24 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-102.865,44	-0,01
Dow, Inc. 34,25 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-91.304,72	-0,01
Dow, Inc. 38,62 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-54.699,89	-0,01
Dow, Inc. 37,79 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-56.586,82	-0,01
Dow, Inc. 37,10 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-79.100,44	-0,01
Dow, Inc. 36,00 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-34.561,12	0,00
Dow, Inc. 37,95 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-92.414,41	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Dow, Inc. 35,76 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-80.462,01	-0,01
Dow, Inc. 37,53 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-98.684,49	-0,01
Dow, Inc. 34,01 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-65.636,67	-0,01
Dow, Inc. 38,28 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-70.663,92	-0,01
Dow, Inc. 34,23 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-86.079,83	-0,01
Dow, Inc. 34,71 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-96.165,40	-0,01
Dow, Inc. 37,00 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-43.932,07	0,00
Dow, Inc. 34,58 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-15.213,52	0,00
Dow, Inc. 35,43 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-90.268,99	-0,01
Dow, Inc. 35,24 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-31.475,73	0,00
Duke Energy Corp. 27,11 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-67.312,65	-0,01
Duke Energy Corp. 23,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	25.448,71	0,00
Duke Energy Corp. 25,54 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-23.649,46	0,00
Duke Energy Corp. 24,70 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-2.901,89	0,00
Duke Energy Corp. 25,79 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-17.729,57	0,00
Duke Energy Corp. 25,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-3.774,97	0,00
Duke Energy Corp. 23,09 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-21.779,26	0,00
Duke Energy Corp. 25,37 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-7.694,63	0,00
Duke Energy Corp. 24,93 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-32.724,54	0,00
Duke Energy Corp. 25,07 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-7.341,15	0,00
Duke Energy Corp. 26,10 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-22.760,81	0,00
DuPont de Nemours, Inc. 29,49 %	20.01.2023	1.500.000	USD	33.515,78	0,00
DuPont de Nemours, Inc. 29,66 %	20.01.2023	2.000.000	USD	41.651,97	0,00
Electronic Arts, Inc. 35,07 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-50.716,26	0,00
Electronic Arts, Inc. 34,82 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-44.482,74	0,00
Electronic Arts, Inc. 36,44 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-211.313,37	-0,02
Electronic Arts, Inc. 35,26 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-184.282,31	-0,02
Electronic Arts, Inc. 32,25 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-56.098,80	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,41 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-85.736,20	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,18 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-95.233,33	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,12 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-59.369,59	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,26 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-139.962,78	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-99.963,76	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,87 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-127.830,37	-0,01
Electronic Arts, Inc. 32,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-36.766,42	0,00
Electronic Arts, Inc. 35,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-65.542,60	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,66 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-87.753,98	-0,01
Electronic Arts, Inc. 36,42 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-84.278,29	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,53 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-81.079,67	-0,01
Electronic Arts, Inc. 35,58 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-57.442,40	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-55.838,89	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,67 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-73.236,17	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,72 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-52.438,94	-0,01
Electronic Arts, Inc. 33,11 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-51.378,83	0,00
Electronic Arts, Inc. 32,93 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-43.432,59	0,00
Electronic Arts, Inc. 36,28 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-134.834,20	-0,01
Electronic Arts, Inc. 34,24 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-52.267,06	-0,01
Electronic Arts, Inc. 40,36 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-153.884,48	-0,01
Elevance Health, Inc. 28,68 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-6.230,93	0,00
Emerson Electric Co. 29,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-9.905,09	0,00
Emerson Electric Co. 29,91 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-37.422,88	0,00
Emerson Electric Co. 34,34 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-86.289,38	-0,01
Emerson Electric Co. 31,38 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-42.479,22	0,00
Emerson Electric Co. 32,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-53.680,66	-0,01
Emerson Electric Co. 32,10 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-27.289,24	0,00
Emerson Electric Co. 31,50 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-35.861,23	0,00
Emerson Electric Co. 34,57 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-49.709,94	0,00
Emerson Electric Co. 30,01 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-35.896,47	0,00
Emerson Electric Co. 34,12 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-72.409,20	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Emerson Electric Co. 30,93 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-57.190,50	-0,01
Emerson Electric Co. 33,16 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-68.986,90	-0,01
Emerson Electric Co. 33,32 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-70.130,52	-0,01
Emerson Electric Co. 32,17 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-51.600,09	0,00
Emerson Electric Co. 30,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-19.538,85	0,00
Emerson Electric Co. 32,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-46.917,44	0,00
Emerson Electric Co. 34,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-53.430,67	-0,01
Emerson Electric Co. 34,70 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-128.757,22	-0,01
Emerson Electric Co. 33,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-42.845,15	0,00
Emerson Electric Co. 31,71 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-66.930,21	-0,01
Emerson Electric Co. 28,90 %	19.01.2024	1.000.000	USD	892,58	0,00
Emerson Electric Co. 35,84 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-90.001,16	-0,01
Emerson Electric Co. 33,02 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-62.957,30	-0,01
Emerson Electric Co. 33,11 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-81.923,38	-0,01
Emerson Electric Co. 32,71 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-54.109,92	-0,01
Emerson Electric Co. 28,69 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-36.558,56	0,00
Emerson Electric Co. 35,27 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-200.108,83	-0,02
Emerson Electric Co. 33,03 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-66.023,08	-0,01
Emerson Electric Co. 33,36 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-89.093,98	-0,01
Emerson Electric Co. 31,36 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-40.466,94	0,00
Enel SpA 28,60 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-13.576,12	0,00
Engie SA 26,29 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	114.535,88	0,01
Engie SA 35,10 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	120.912,44	0,01
Enterprise Products Partners LP 27,17 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-104.255,80	-0,01
Estee Lauder Companies, Inc. 29,32 %	20.01.2023	1.700.000	USD	127.196,10	0,01
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,84 %	16.06.2023	7.000.000	EUR	223.755,35	0,02
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 27,80 %	16.06.2023	5.400.000	EUR	-392.062,90	-0,04
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,46 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	336.035,92	0,03
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 26,21 %	16.06.2023	8.000.000	EUR	405.755,44	0,04
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,27 %	15.12.2023	8.550.000	EUR	303.307,74	0,03
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 23,60 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	134.944,88	0,01
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,34 %	16.06.2023	7.700.000	EUR	348.923,04	0,03
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 28,06 %	15.12.2023	5.000.000	EUR	-336.355,50	-0,03
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 22,53 %	16.06.2023	11.250.000	EUR	-68.852,59	-0,01
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,30 %	16.06.2023	15.000.000	EUR	737.810,40	0,07
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,00 %	16.06.2023	7.000.000	EUR	333.385,50	0,03
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 23,73 %	15.12.2023	7.500.000	EUR	182.013,00	0,02
Euro Stoxx 50 <sup>®</sup> Index 25,00 %	15.12.2023	8.000.000	EUR	258.280,08	0,02
EURO STOXX Banks EUR Price Index 36,29 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-98.747,80	-0,01
EURO Stoxx Insurance Index EUR 25,02 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	37.181,70	0,00
Exelon Corp. 28,48 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-9.501,08	0,00
Exelon Corp. 24,09 %	20.01.2023	1.300.000	USD	40.425,65	0,00
Exelon Corp. 28,26 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-16.679,33	0,00
Exelon Corp. 23,86 %	16.06.2023	1.200.000	USD	44.663,15	0,00
Facebook, Inc. 37,84 %	20.01.2023	550.000	USD	-132.297,45	-0,01
Facebook, Inc. 34,90 %	20.01.2023	1.500.000	USD	329.850,33	0,03
Facebook, Inc. 34,70 %	20.01.2023	1.111.100	USD	271.066,06	0,03
Fifth Third Bancorp 39,59 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-37.407,59	0,00
Fifth Third Bancorp 36,80 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-7.109,86	0,00
Fifth Third Bancorp 40,05 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-44.264,49	0,00
Fifth Third Bancorp 41,04 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-54.622,16	-0,01
FirstEnergy Corp. 24,06 %	20.01.2023	1.200.000	USD	1.372,80	0,00
FirstEnergy Corp. 24,87 %	16.06.2023	1.500.000	USD	14.744,64	0,00
FirstEnergy Corp. 25,36 %	16.06.2023	1.500.000	USD	7.728,06	0,00
FTSE 100 Index 19,45 %	16.06.2023	9.370.000	GBP	297.619,68	0,03
FTSE 100 Index 23,04 %	16.06.2023	4.685.800	GBP	-455.080,06	-0,04
Gilead Sciences, Inc. 32,12 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-145.510,23	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 28,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	7.412,55	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-15.836,55	0,00

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



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Gilead Sciences, Inc. 28,37 %	19.01.2024	1.000.000	USD	6.219,81	0,00
Gilead Sciences, Inc. 29,65 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-33.795,28	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,68 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-8.419,91	0,00
Gilead Sciences, Inc. 29,90 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-16.098,83	0,00
Gilead Sciences, Inc. 30,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-5.711,96	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,96 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-15.234,95	0,00
Gilead Sciences, Inc. 31,86 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-67.583,74	-0,01
Gilead Sciences, Inc. 30,06 %	19.01.2024	1.000.000	USD	1.978,78	0,00
Gilead Sciences, Inc. 30,21 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-29.146,64	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,48 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-3.332,05	0,00
Gilead Sciences, Inc. 30,43 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-44.802,52	0,00
Gilead Sciences, Inc. 27,82 %	16.06.2023	1.500.000	USD	2.483,19	0,00
Gilead Sciences, Inc. 31,44 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-51.264,05	0,00
Gilead Sciences, Inc. 31,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-158.867,01	-0,02
Goldman Sachs Group, Inc. 31,94 %	19.01.2024	1.500.000	USD	923,14	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,52 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-52.126,79	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,42 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-82.289,10	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,20 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-15.673,79	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,77 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-62.006,18	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-51.711,01	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,30 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-115.192,19	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-34.832,06	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 36,36 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-75.812,66	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,52 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-17.531,82	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-37.338,06	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 35,03 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-37.833,04	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 33,17 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-12.224,26	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,84 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-57.346,05	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 37,48 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-72.397,48	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,00 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-75.531,15	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 36,55 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-95.802,03	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,58 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-58.137,39	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,73 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-87.006,06	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 37,31 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-108.013,87	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,49 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-82.807,43	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,07 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-57.461,74	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 35,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-37.903,82	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 32,70 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-49.684,73	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 33,23 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-23.280,36	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 33,77 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-31.179,78	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 34,34 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-26.748,21	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 37,90 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-65.188,62	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-32.176,48	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 33,18 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-25.869,00	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 32,90 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-23.632,06	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 32,15 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-6.267,36	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 35,71 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-64.499,51	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 33,61 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-23.989,05	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 33,55 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-90.119,35	-0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 34,75 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-50.943,95	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 31,97 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-9.090,46	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 35,10 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-55.754,56	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,85 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-19.854,43	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 37,43 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-142.161,14	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,90 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-48.843,83	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 30,60 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-9.391,07	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,03 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-95.944,92	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,07 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-37.922,46	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,73 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-74.935,02	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,28 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-71.738,60	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 31,82 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-52.245,88	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,60 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-35.383,47	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,22 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-53.879,29	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,55 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-68.944,51	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-72.581,29	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,97 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-73.639,03	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,52 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-38.049,46	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,71 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-112.377,47	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,34 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-101.247,55	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,97 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-36.046,54	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,88 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-76.824,81	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,46 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-91.949,97	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 28,62 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-69.483,60	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,01 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-72.451,50	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 34,36 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-111.142,18	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 36,92 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-277.953,48	-0,03
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,34 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-65.691,37	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 32,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-46.528,60	0,00
Hartford Financial Services Group, Inc./The 35,38 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-103.282,74	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,75 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-104.642,04	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 37,35 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-60.672,20	-0,01
Hartford Financial Services Group, Inc./The 33,08 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-77.793,46	-0,01
HeidelbergCement AG 40,85 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	110.337,11	0,01
HeidelbergCement AG 30,66 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	88.436,35	0,01
HeidelbergCement AG 38,73 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-96.324,76	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 37,75 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-16.049,21	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 36,01 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-28.157,66	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 37,31 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-25.290,19	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 43,60 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-137.659,98	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 41,59 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-78.248,52	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 40,92 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-75.400,52	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 43,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-97.465,87	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 42,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-81.367,71	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 42,54 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-52.416,12	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 38,18 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-34.180,89	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 38,36 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-41.716,95	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 39,91 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-63.959,86	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 39,45 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-91.750,92	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 39,79 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-74.707,78	-0,01
Hewlett Packard Enterprise Company 40,40 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-34.243,41	0,00
Hewlett Packard Enterprise Company 35,45 %	19.01.2024	1.500.000	USD	11.591,03	0,00
Holcim Ltd. 27,61 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-15.884,62	0,00
Holcim Ltd. 28,69 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-51.371,40	0,00
Holcim Ltd. 28,86 %	15.12.2023	1.276.000	CHF	-38.110,57	0,00
Holcim Ltd. 29,18 %	16.06.2023	2.024.000	CHF	-63.150,43	-0,01
Holcim Ltd. 29,49 %	15.12.2023	1.932.000	CHF	-70.478,81	-0,01
Holcim Ltd. 33,02 %	15.12.2023	984.000	CHF	-73.279,01	-0,01
Holcim Ltd. 29,98 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-56.912,36	-0,01
Holcim Ltd. 27,54 %	15.12.2023	980.300	CHF	-18.106,31	0,00
Home Depot, Inc./The 30,05 %	19.01.2024	1.500.000	USD	28.838,55	0,00
Home Depot, Inc./The 30,12 %	20.01.2023	2.000.000	USD	8.438,96	0,00
Home Depot, Inc./The 28,07 %	20.01.2023	550.000	USD	-14.102,79	0,00
Home Depot, Inc./The 29,40 %	20.01.2023	1.111.100	USD	1.163,69	0,00
Home Depot, Inc./The 27,19 %	20.01.2023	2.500.000	USD	14.633,59	0,00
Honeywell International, Inc. 31,55 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-89.787,07	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,54 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-69.415,35	-0,01
Honeywell International, Inc. 30,35 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-96.355,42	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,61 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-47.313,49	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Honeywell International, Inc. 30,93 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-70.526,75	-0,01
Honeywell International, Inc. 30,76 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-84.378,28	-0,01
Honeywell International, Inc. 31,65 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-71.338,90	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,77 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-55.540,97	-0,01
Honeywell International, Inc. 31,44 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-78.366,17	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,64 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-43.270,77	0,00
Honeywell International, Inc. 29,83 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-60.741,45	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,13 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-23.730,10	0,00
Honeywell International, Inc. 29,73 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-54.033,21	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,10 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-12.309,65	0,00
Honeywell International, Inc. 27,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-1.736,64	0,00
Honeywell International, Inc. 27,30 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-42.052,94	0,00
Honeywell International, Inc. 30,93 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-67.442,37	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,71 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-64.605,24	-0,01
Honeywell International, Inc. 31,25 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-66.481,18	-0,01
Honeywell International, Inc. 32,27 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-54.610,30	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,40 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-84.629,70	-0,01
Honeywell International, Inc. 31,47 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-70.089,11	-0,01
Honeywell International, Inc. 26,90 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-34.303,79	0,00
Honeywell International, Inc. 28,90 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-140.850,60	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,21 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-56.667,79	-0,01
Honeywell International, Inc. 26,54 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-35.815,70	0,00
Honeywell International, Inc. 30,82 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-87.904,85	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,13 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-38.380,02	0,00
Honeywell International, Inc. 28,20 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-21.692,12	0,00
Honeywell International, Inc. 31,50 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-98.248,41	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-13.052,93	0,00
Honeywell International, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-22.516,87	0,00
Honeywell International, Inc. 30,04 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-51.675,22	0,00
Honeywell International, Inc. 30,40 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-109.116,48	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-139.079,24	-0,01
Honeywell International, Inc. 32,51 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-47.450,61	0,00
Honeywell International, Inc. 28,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-62.601,58	-0,01
Honeywell International, Inc. 26,69 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-40.613,26	0,00
Honeywell International, Inc. 28,74 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-23.689,71	0,00
Honeywell International, Inc. 32,07 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-52.801,08	-0,01
Honeywell International, Inc. 29,29 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-99.035,38	-0,01
Honeywell International, Inc. 27,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-963,99	0,00
Honeywell International, Inc. 28,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-25.949,22	0,00
Honeywell International, Inc. 33,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-54.794,99	-0,01
Honeywell International, Inc. 28,18 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-13.773,62	0,00
Honeywell International, Inc. 27,79 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-48.922,50	0,00
Honeywell International, Inc. 30,45 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-110.261,86	-0,01
HSBC Holdings PLC 34,87 %	15.12.2023	1.031.600	GBP	-114.632,42	-0,01
HSBC Holdings PLC 31,08 %	15.12.2023	1.033.008	GBP	-73.010,00	-0,01
Humana, Inc. 32,89 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-63.759,41	-0,01
Humana, Inc. 33,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-52.423,29	-0,01
Humana, Inc. 29,45 %	20.01.2023	2.500.000	USD	20.142,50	0,00
Humana, Inc. 32,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-53.893,44	-0,01
Humana, Inc. 28,57 %	20.01.2023	1.500.000	USD	23.080,14	0,00
Humana, Inc. 34,11 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-54.505,96	-0,01
Humana, Inc. 30,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-13.616,28	0,00
Humana, Inc. 33,40 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-98.630,96	-0,01
ING Groep NV 38,67 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-79.469,67	-0,01
ING Groep NV 39,50 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-60.883,08	-0,01
ING Groep NV 39,44 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-88.034,89	-0,01
ING Groep NV 39,55 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-111.864,24	-0,01
Intel Corp. 39,01 %	16.06.2023	1.800.000	USD	31.015,89	0,00
Intel Corp. 37,29 %	16.06.2023	1.500.000	USD	53.758,08	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Intel Corp. 38,66 %	16.06.2023	1.500.000	USD	34.927,95	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 28,09 %	20.01.2023	1.800.000	USD	22.018,80	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 26,18 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-13.131,14	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 29,17 %	16.06.2023	2.000.000	USD	15.339,95	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 25,96 %	20.01.2023	2.000.000	USD	48.086,22	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 26,85 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-23.868,67	0,00
Intercontinental Exchange, Inc. 27,35 %	16.06.2023	2.500.000	USD	62.444,26	0,01
International Business Machines Corp. 30,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-42.426,36	0,00
International Business Machines Corp. 25,74 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-39.729,40	0,00
International Business Machines Corp. 29,24 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-56.409,76	-0,01
International Paper 33,26 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-23.625,53	0,00
International Paper 32,91 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-17.629,66	0,00
International Paper 36,39 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-51.656,18	0,00
International Paper 34,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-40.881,11	0,00
International Paper 33,12 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-12.611,61	0,00
International Paper 34,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-16.073,45	0,00
International Paper 31,91 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-22.021,88	0,00
International Paper 34,40 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-26.236,70	0,00
International Paper 34,27 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-28.411,48	0,00
International Paper 30,23 %	16.06.2023	1.500.000	USD	29.181,14	0,00
International Paper 32,15 %	16.06.2023	1.500.000	USD	1.175,03	0,00
International Paper 31,27 %	19.01.2024	1.200.000	USD	413,49	0,00
International Paper 30,43 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-40.421,99	0,00
Johnson & Johnson 24,54 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-54.270,56	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,12 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-25.151,81	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,49 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-37.732,62	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,56 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-47.352,32	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,86 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-66.593,38	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,19 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-38.078,91	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,72 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-33.620,07	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,00 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-2.579,25	0,00
JPMorgan Chase & Co. 36,34 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-83.216,51	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,86 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-46.711,99	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,09 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-56.398,58	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 30,10 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-19.990,41	0,00
JPMorgan Chase & Co. 35,07 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-49.480,96	0,00
JPMorgan Chase & Co. 32,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-65.413,58	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,45 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-85.891,24	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 35,12 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-60.391,33	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,42 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-37.202,68	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,10 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-23.172,73	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,05 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-75.943,09	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 29,37 %	20.01.2023	550.000	USD	1.686,04	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,48 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-17.930,51	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,19 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-33.187,67	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,65 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-84.438,67	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,51 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-59.279,85	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,89 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-76.727,31	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,60 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-43.878,41	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,44 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-37.690,06	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,64 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-43.401,62	0,00
JPMorgan Chase & Co. 36,38 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-119.278,94	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 29,60 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-29.703,48	0,00
JPMorgan Chase & Co. 29,31 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-29.037,43	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-23.714,13	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,19 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-29.487,92	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,74 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-65.548,82	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,10 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-48.259,11	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,37 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-67.411,92	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
JPMorgan Chase & Co. 35,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-60.214,77	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 29,34 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-32.372,42	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,99 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-85.004,64	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 32,60 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-27.960,69	0,00
JPMorgan Chase & Co. 35,26 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-73.340,16	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,73 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-23.804,15	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-18.801,56	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,91 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-59.231,56	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 34,52 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-62.531,16	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 28,39 %	20.01.2023	1.500.000	USD	5.971,46	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,78 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-9.134,89	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,52 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-69.374,88	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,15 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-18.310,82	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,88 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-33.458,53	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,69 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-29.037,40	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,61 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-15.609,52	0,00
JPMorgan Chase & Co. 31,61 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-27.786,82	0,00
JPMorgan Chase & Co. 33,39 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-80.654,06	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 33,72 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-88.213,60	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 31,70 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-41.124,29	0,00
Juniper Networks, Inc. 34,47 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-99.463,57	-0,01
Juniper Networks, Inc. 37,10 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-118.374,17	-0,01
Kellogg Co. 25,58 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-24.720,37	0,00
Kinder Morgan, Inc. 30,08 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-2.079,38	0,00
Kinder Morgan, Inc. 31,75 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-5.967,95	0,00
Kinder Morgan, Inc. 33,42 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-56.900,93	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 32,16 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-21.501,45	0,00
Kinder Morgan, Inc. 33,25 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-25.686,95	0,00
Kinder Morgan, Inc. 30,51 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-9.358,22	0,00
Kinder Morgan, Inc. 30,83 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-58.790,24	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 32,50 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-31.556,37	0,00
Kinder Morgan, Inc. 29,42 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-8.365,31	0,00
Kinder Morgan, Inc. 31,82 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-25.584,33	0,00
Kinder Morgan, Inc. 25,27 %	20.01.2023	1.800.000	USD	58.244,00	0,01
Kinder Morgan, Inc. 30,24 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-58.901,63	-0,01
Kinder Morgan, Inc. 31,80 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-85.794,43	-0,01
Kraft Heinz Co./The 28,24 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-26.852,98	0,00
Lowe's Cos., Inc. 36,90 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-29.015,52	0,00
Lowe's Cos., Inc. 36,84 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-13.883,40	0,00
Lowe's Cos., Inc. 38,76 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-25.588,51	0,00
Lowe's Cos., Inc. 35,97 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-23.681,21	0,00
Lowe's Cos., Inc. 31,67 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-10.866,10	0,00
Lowe's Cos., Inc. 33,50 %	19.01.2024	1.500.000	USD	28.617,42	0,00
Lowe's Cos., Inc. 31,87 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-28.266,66	0,00
Lowe's Cos., Inc. 32,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	27.171,85	0,00
Lowe's Cos., Inc. 33,90 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-32.081,52	0,00
Lowe's Cos., Inc. 34,08 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-13.833,42	0,00
Marathon Petroleum Corp. 40,84 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-65.117,73	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 37,69 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-16.233,45	0,00
Marathon Petroleum Corp. 38,07 %	16.06.2023	2.000.000	USD	39.690,57	0,00
Marathon Petroleum Corp. 42,92 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-37.383,36	0,00
Marathon Petroleum Corp. 43,05 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-96.642,08	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 40,35 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-4.043,70	0,00
Marathon Petroleum Corp. 37,36 %	16.06.2023	2.500.000	USD	66.303,05	0,01
Marathon Petroleum Corp. 43,91 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-73.210,04	-0,01
Marathon Petroleum Corp. 41,73 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-26.931,64	0,00
McDonald's Corp. 27,54 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-81.636,07	-0,01
McDonald's Corp. 25,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-29.252,37	0,00
McDonald's Corp. 25,10 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-29.589,87	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
McDonald's Corp. 25,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-106.551,23	-0,01
McDonald's Corp. 27,21 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-46.921,53	0,00
McDonald's Corp. 25,12 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-30.061,88	0,00
McDonald's Corp. 25,16 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-95.508,12	-0,01
McDonald's Corp. 27,54 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-138.051,08	-0,01
McDonald's Corp. 27,65 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-73.726,83	-0,01
McDonald's Corp. 25,92 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-33.099,35	0,00
McDonald's Corp. 27,01 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-125.910,00	-0,01
McDonald's Corp. 25,00 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-87.506,51	-0,01
McDonald's Corp. 23,64 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-61.587,49	-0,01
McDonald's Corp. 27,58 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-101.517,96	-0,01
McDonald's Corp. 27,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-50.856,97	0,00
McDonald's Corp. 26,72 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-39.029,46	0,00
McDonald's Corp. 23,87 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-13.748,28	0,00
McDonald's Corp. 27,03 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-102.752,18	-0,01
McDonald's Corp. 23,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-7.205,88	0,00
McDonald's Corp. 25,82 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-107.851,34	-0,01
McDonald's Corp. 25,38 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-53.185,10	-0,01
McDonald's Corp. 24,78 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-128.238,53	-0,01
McDonald's Corp. 27,73 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-93.525,77	-0,01
McDonald's Corp. 23,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-15.627,31	0,00
McDonald's Corp. 26,35 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-54.882,37	-0,01
McDonald's Corp. 26,09 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-61.775,10	-0,01
McDonald's Corp. 27,63 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-61.933,26	-0,01
McDonald's Corp. 24,05 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-75.446,20	-0,01
McDonald's Corp. 27,41 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-72.152,62	-0,01
McDonald's Corp. 25,65 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-51.509,67	0,00
McDonald's Corp. 25,80 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-81.970,90	-0,01
Medtronic, Inc. 31,59 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-59.670,68	-0,01
Medtronic, Inc. 30,42 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-43.605,88	0,00
Mercedes-Benz Group AG 39,32 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-63.371,86	-0,01
MetLife, Inc. 36,39 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-126.894,90	-0,01
MetLife, Inc. 33,08 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-116.003,24	-0,01
MetLife, Inc. 34,67 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-152.800,44	-0,01
MetLife, Inc. 37,92 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-177.507,86	-0,02
MetLife, Inc. 33,74 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-186.570,90	-0,02
MetLife, Inc. 34,36 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-247.250,20	-0,02
MetLife, Inc. 32,06 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-121.113,37	-0,01
MetLife, Inc. 33,68 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-219.687,75	-0,02
MetLife, Inc. 34,55 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-163.187,07	-0,02
MetLife, Inc. 33,91 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-79.440,00	-0,01
MetLife, Inc. 35,92 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-114.301,41	-0,01
MetLife, Inc. 33,38 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-216.815,57	-0,02
MetLife, Inc. 32,70 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-116.260,92	-0,01
MetLife, Inc. 34,18 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-115.636,04	-0,01
MetLife, Inc. 36,70 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-252.566,03	-0,02
MetLife, Inc. 36,97 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-166.096,69	-0,02
MetLife, Inc. 35,08 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-65.670,22	-0,01
MetLife, Inc. 36,95 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-69.239,91	-0,01
MetLife, Inc. 36,46 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-157.298,11	-0,01
MetLife, Inc. 34,36 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-94.193,88	-0,01
MetLife, Inc. 37,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-92.750,61	-0,01
MetLife, Inc. 33,70 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-77.380,40	-0,01
MetLife, Inc. 38,14 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-153.708,34	-0,01
MetLife, Inc. 37,09 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-111.464,73	-0,01
MetLife, Inc. 30,94 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-39.046,00	0,00
MetLife, Inc. 32,11 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-130.310,84	-0,01
MetLife, Inc. 33,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-182.942,19	-0,02
MetLife, Inc. 32,59 %	20.01.2023	550.000	USD	40.876,68	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
MetLife, Inc. 37,67 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-147.565,61	-0,01
MetLife, Inc. 36,22 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-207.998,11	-0,02
MetLife, Inc. 36,45 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-95.005,35	-0,01
MetLife, Inc. 35,55 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-58.325,46	-0,01
MetLife, Inc. 37,11 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-163.399,66	-0,02
MetLife, Inc. 37,07 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-182.917,93	-0,02
MetLife, Inc. 33,70 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-88.370,46	-0,01
MetLife, Inc. 33,15 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-138.240,96	-0,01
MetLife, Inc. 36,28 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-195.429,23	-0,02
MetLife, Inc. 33,00 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-146.227,95	-0,01
MetLife, Inc. 37,84 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-134.083,79	-0,01
MetLife, Inc. 37,65 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-176.586,87	-0,02
MetLife, Inc. 36,71 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-169.704,77	-0,02
MetLife, Inc. 32,54 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-64.175,97	-0,01
MetLife, Inc. 35,46 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-70.184,53	-0,01
MetLife, Inc. 33,58 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-192.176,22	-0,02
MetLife, Inc. 35,56 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-195.332,25	-0,02
MetLife, Inc. 37,77 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-152.926,38	-0,01
MetLife, Inc. 37,22 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-233.359,00	-0,02
MetLife, Inc. 37,35 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-142.502,16	-0,01
MetLife, Inc. 35,06 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-79.936,37	-0,01
MetLife, Inc. 34,14 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-117.587,56	-0,01
MetLife, Inc. 37,61 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-126.196,50	-0,01
MetLife, Inc. 35,86 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-90.247,03	-0,01
MetLife, Inc. 35,33 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-107.810,52	-0,01
MetLife, Inc. 33,64 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-145.834,77	-0,01
MetLife, Inc. 33,76 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-137.301,04	-0,01
MetLife, Inc. 35,92 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-138.495,27	-0,01
MetLife, Inc. 39,74 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-152.188,05	-0,01
MetLife, Inc. 36,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-135.040,12	-0,01
Micron Technology, Inc. 48,33 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-6.938,60	0,00
Micron Technology, Inc. 49,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-44.955,26	0,00
Micron Technology, Inc. 48,75 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-38.930,19	0,00
Micron Technology, Inc. 39,02 %	20.01.2023	2.000.000	USD	148.079,40	0,01
Micron Technology, Inc. 48,74 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-33.413,59	0,00
Micron Technology, Inc. 40,60 %	20.01.2023	1.111.100	USD	49.751,81	0,00
Micron Technology, Inc. 43,03 %	20.01.2023	2.500.000	USD	6.125,98	0,00
Micron Technology, Inc. 48,44 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-48.000,99	0,00
Micron Technology, Inc. 40,80 %	20.01.2023	1.200.000	USD	39.340,04	0,00
Micron Technology, Inc. 42,46 %	20.01.2023	2.500.000	USD	26.291,81	0,00
Micron Technology, Inc. 41,99 %	20.01.2023	2.500.000	USD	32.505,44	0,00
Micron Technology, Inc. 47,97 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-42.615,49	0,00
Micron Technology, Inc. 45,70 %	20.01.2023	550.000	USD	6.183,27	0,00
Micron Technology, Inc. 48,23 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-31.817,12	0,00
Micron Technology, Inc. 47,74 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-20.279,24	0,00
Micron Technology, Inc. 41,30 %	20.01.2023	1.300.000	USD	44.226,62	0,00
Microsoft Corp. 28,00 %	20.01.2023	1.200.000	USD	46.722,98	0,00
Microsoft Corp. 30,13 %	20.01.2023	1.600.000	USD	85.172,84	0,01
Microsoft Corp. 30,80 %	16.06.2023	2.000.000	USD	94.686,38	0,01
Microsoft Corp. 33,97 %	19.01.2024	1.000.000	USD	664,67	0,00
Microsoft Corp. 30,99 %	20.01.2023	1.300.000	USD	57.133,82	0,01
Microsoft Corp. 36,31 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-12.735,24	0,00
Microsoft Corp. 27,74 %	20.01.2023	2.500.000	USD	74.522,09	0,01
Microsoft Corp. 34,26 %	16.06.2023	1.700.000	USD	16.337,21	0,00
Microsoft Corp. 33,53 %	19.01.2024	1.000.000	USD	5.547,34	0,00
Microsoft Corp. 32,38 %	19.01.2024	1.200.000	USD	17.437,38	0,00
Microsoft Corp. 30,64 %	20.01.2023	2.500.000	USD	96.723,26	0,01
Microsoft Corp. 31,77 %	19.01.2024	2.000.000	USD	40.592,25	0,00
Microsoft Corp. 30,81 %	20.01.2023	2.000.000	USD	59.754,83	0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Microsoft Corp. 33,73 %	16.06.2023	1.500.000	USD	26.582,50	0,00
Microsoft Corp. 32,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	20.722,21	0,00
Microsoft Corp. 33,43 %	19.01.2024	1.500.000	USD	5.237,46	0,00
Microsoft Corp. 34,90 %	16.06.2023	1.900.000	USD	3.507,95	0,00
Microsoft Corp. 31,13 %	20.01.2023	1.300.000	USD	56.460,23	0,01
Microsoft Corp. 33,71 %	16.06.2023	1.500.000	USD	26.857,40	0,00
Microsoft Corp. 34,14 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-1.945,96	0,00
Microsoft Corp. 33,17 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-16.799,75	0,00
Microsoft Corp. 32,88 %	16.06.2023	1.500.000	USD	38.359,94	0,00
Microsoft Corp. 27,68 %	20.01.2023	1.500.000	USD	54.344,37	0,01
Microsoft Corp. 31,42 %	16.06.2023	1.200.000	USD	49.696,06	0,00
Microsoft Corp. 27,58 %	20.01.2023	2.500.000	USD	78.260,04	0,01
Mondelez International, Inc. 25,82 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-26.505,93	0,00
Monster Beverage Corp. 34,73 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-67.470,47	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,18 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-90.222,39	-0,01
Monster Beverage Corp. 38,50 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-83.087,87	-0,01
Monster Beverage Corp. 35,99 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-137.233,24	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,22 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-88.685,71	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,11 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-86.088,59	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,28 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-74.208,77	-0,01
Monster Beverage Corp. 36,25 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-86.334,01	-0,01
Monster Beverage Corp. 37,11 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-130.514,28	-0,01
Monster Beverage Corp. 39,32 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-138.341,78	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,80 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-95.572,37	-0,01
Monster Beverage Corp. 32,53 %	16.06.2023	2.300.000	USD	-100.681,04	-0,01
Monster Beverage Corp. 37,41 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-101.506,43	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,70 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-85.448,58	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,14 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-58.286,60	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,72 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-59.535,28	-0,01
Monster Beverage Corp. 33,24 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-74.199,22	-0,01
Monster Beverage Corp. 37,39 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-67.049,44	-0,01
Monster Beverage Corp. 31,96 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-35.823,50	0,00
Monster Beverage Corp. 34,51 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-66.131,81	-0,01
Monster Beverage Corp. 34,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-57.902,11	-0,01
Moody's Corp. 33,88 %	16.06.2023	1.800.000	USD	44.149,00	0,00
Moody's Corp. 34,73 %	16.06.2023	2.000.000	USD	38.137,27	0,00
Morgan Stanley 37,01 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-33.667,94	0,00
Morgan Stanley 36,85 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-66.993,99	-0,01
Morgan Stanley 37,07 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-52.491,78	-0,01
Morgan Stanley 32,51 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-32.608,44	0,00
Morgan Stanley 34,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-17.203,92	0,00
Morgan Stanley 31,45 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-18.960,54	0,00
Morgan Stanley 35,78 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-38.920,73	0,00
Morgan Stanley 35,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-25.294,03	0,00
Morgan Stanley 38,23 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-75.964,85	-0,01
Morgan Stanley 38,83 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-107.033,96	-0,01
Morgan Stanley 40,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-57.856,95	-0,01
Morgan Stanley 36,85 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-80.610,04	-0,01
Morgan Stanley 38,30 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-56.381,29	-0,01
Morgan Stanley 34,98 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-17.093,98	0,00
Morgan Stanley 34,81 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-46.888,25	0,00
Morgan Stanley 34,09 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-8.542,91	0,00
Morgan Stanley 38,24 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-103.761,73	-0,01
Morgan Stanley 32,40 %	16.06.2023	2.000.000	USD	12.221,02	0,00
Morgan Stanley 38,80 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-56.546,28	-0,01
Morgan Stanley 35,78 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-35.828,19	0,00
Morgan Stanley 33,55 %	19.01.2024	2.500.000	USD	6.637,88	0,00
Morgan Stanley 37,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-42.795,79	0,00
Morgan Stanley 37,90 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-70.199,60	-0,01

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



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Morgan Stanley 34,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-14.421,90	0,00
Morgan Stanley 33,55 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-35.663,53	0,00
Morgan Stanley 36,39 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-55.989,96	-0,01
Morgan Stanley 34,55 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-22.941,41	0,00
Morgan Stanley 36,27 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-51.332,01	0,00
Morgan Stanley 38,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-66.359,83	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 31,79 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-31.804,11	0,00
Motorola Solutions, Inc. 32,07 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-30.210,45	0,00
Motorola Solutions, Inc. 37,35 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-82.416,77	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 33,61 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-56.819,29	-0,01
Motorola Solutions, Inc. 35,67 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-53.419,11	-0,01
Münchener Rückversicherungs AG 30,28 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-79.884,36	-0,01
Münchener Rückversicherungs AG 30,79 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-58.259,68	-0,01
NASDAQ 100 Index 29,93 %	16.06.2023	10.000.000	USD	-99.060,86	-0,01
NASDAQ 100 Index 31,56 %	19.01.2024	4.200.000	USD	56.842,91	0,01
NASDAQ 100 Index 30,64 %	16.06.2023	10.000.000	USD	-34.008,71	0,00
NASDAQ 100 Index 26,63 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-486.823,14	-0,05
NASDAQ 100 Index 25,55 %	20.01.2023	14.000.000	USD	-732.669,82	-0,07
NASDAQ 100 Index 28,29 %	20.01.2023	9.000.000	USD	-348.733,74	-0,03
NASDAQ 100 Index 27,81 %	20.01.2023	12.600.000	USD	-541.371,67	-0,05
NASDAQ 100 Index 25,99 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-614.954,04	-0,06
NASDAQ 100 Index 27,35 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-482.531,46	-0,05
NASDAQ 100 Index 30,44 %	20.01.2023	3.360.000	USD	-58.449,08	-0,01
NASDAQ 100 Index 26,90 %	20.01.2023	21.000.000	USD	-1.103.117,75	-0,10
NASDAQ 100 Index 27,00 %	20.01.2023	9.750.000	USD	-498.795,84	-0,05
NASDAQ 100 Index 27,46 %	20.01.2023	11.830.000	USD	-529.444,63	-0,05
NASDAQ 100 Index 27,80 %	20.01.2023	8.000.000	USD	-352.337,77	-0,03
NASDAQ 100 Index 30,03 %	19.01.2024	12.000.000	USD	-8.686,78	0,00
NASDAQ 100 Index 27,71 %	20.01.2023	8.500.000	USD	-366.754,47	-0,03
NASDAQ 100 Index 27,56 %	20.01.2023	8.450.000	USD	-379.006,71	-0,04
NASDAQ 100 Index 26,16 %	20.01.2023	10.400.000	USD	-605.128,56	-0,06
NASDAQ 100 Index 27,66 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-664.998,87	-0,06
NASDAQ 100 Index 23,30 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-857.240,01	-0,08
NASDAQ 100 Index 26,42 %	16.06.2023	10.200.000	USD	-517.926,81	-0,05
NASDAQ 100 Index 27,00 %	20.01.2023	4.500.000	USD	-202.719,46	-0,02
NASDAQ 100 Index 22,85 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-941.344,20	-0,09
NASDAQ 100 Index 26,01 %	20.01.2023	11.250.000	USD	-603.567,95	-0,06
NASDAQ 100 Index 29,80 %	16.06.2023	9.750.000	USD	-196.291,87	-0,02
NASDAQ 100 Index 27,00 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-507.913,70	-0,05
NASDAQ 100 Index 29,02 %	19.01.2024	5.280.000	USD	-46.581,65	0,00
NASDAQ 100 Index 27,24 %	20.01.2023	12.500.000	USD	-609.509,49	-0,06
NASDAQ 100 Index 29,62 %	19.01.2024	12.500.000	USD	-41.888,97	0,00
NASDAQ 100 Index 24,60 %	20.01.2023	7.140.000	USD	-304.039,03	-0,03
NASDAQ 100 Index 30,40 %	16.06.2023	11.250.000	USD	-34.632,08	0,00
NASDAQ 100 Index 23,60 %	20.01.2023	12.000.000	USD	-583.101,95	-0,06
NASDAQ 100 Index 32,69 %	16.06.2023	4.940.000	USD	113.156,66	0,01
NASDAQ 100 Index 29,89 %	16.06.2023	3.600.000	USD	-25.662,87	0,00
NASDAQ 100 Index 29,63 %	19.01.2024	4.500.000	USD	-19.471,37	0,00
NASDAQ 100 Index 30,92 %	16.06.2023	6.120.000	USD	50.676,52	0,00
NASDAQ 100 Index 30,10 %	16.06.2023	11.250.000	USD	-65.553,06	-0,01
NASDAQ 100 Index 23,82 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-657.330,99	-0,06
Nestle S.A. 18,03 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	2.291,25	0,00
NetApp, Inc. 37,73 %	19.01.2024	1.000.000	USD	3.946,53	0,00
NetApp, Inc. 39,67 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-41.152,46	0,00
Netflix, Inc. 39,08 %	20.01.2023	2.000.000	USD	592.376,13	0,06
Netflix, Inc. 42,38 %	20.01.2023	2.000.000	USD	618.827,02	0,06
Netflix, Inc. 37,67 %	20.01.2023	2.000.000	USD	629.872,66	0,06
Netflix, Inc. 34,63 %	20.01.2023	1.500.000	USD	415.389,90	0,04
Netflix, Inc. 42,12 %	20.01.2023	550.000	USD	-172.414,13	-0,02

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Netflix, Inc. 38,30 %	20.01.2023	1.111.100	USD	305.219,31	0,03
Netflix, Inc. 36,83 %	20.01.2023	1.500.000	USD	395.051,49	0,04
Netflix, Inc. 36,26 %	20.01.2023	1.500.000	USD	393.729,24	0,04
Netflix, Inc. 38,90 %	20.01.2023	1.700.000	USD	394.971,58	0,04
Netflix, Inc. 41,37 %	20.01.2023	2.000.000	USD	651.624,01	0,06
Newmont Corp. 38,37 %	16.06.2023	1.800.000	USD	27.079,86	0,00
Newmont Corp. 36,01 %	16.06.2023	1.500.000	USD	61.774,53	0,01
Newmont Corp. 33,85 %	20.01.2023	2.500.000	USD	104.660,25	0,01
Newmont Corp. 33,73 %	20.01.2023	2.000.000	USD	89.035,35	0,01
Newmont Corp. 40,02 %	16.06.2023	1.300.000	USD	4.226,60	0,00
Newmont Corp. 37,51 %	16.06.2023	1.500.000	USD	35.459,53	0,00
Newmont Corp. 33,93 %	20.01.2023	2.000.000	USD	60.428,65	0,01
Newmont Corp. 34,30 %	20.01.2023	1.500.000	USD	15.358,72	0,00
Newmont Corp. 33,80 %	20.01.2023	2.000.000	USD	89.132,37	0,01
Newmont Corp. 34,60 %	20.01.2023	2.500.000	USD	84.066,25	0,01
Novartis AG 21,74 %	15.12.2023	984.000	CHF	-18.239,46	0,00
Novartis AG 20,25 %	15.12.2023	980.300	CHF	-4.561,01	0,00
Novartis AG 20,18 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-2.433,40	0,00
Novartis AG 20,95 %	15.12.2023	1.491.000	CHF	-14.774,96	0,00
Novartis AG 19,74 %	15.12.2023	1.276.000	CHF	-2.760,33	0,00
NVIDIA Corp. 43,10 %	20.01.2023	1.200.000	USD	186.662,47	0,02
Orange S.A. 22,78 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-120.611,48	-0,01
Orange S.A. 24,57 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-129.470,46	-0,01
Orange S.A. 22,71 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-60.065,53	-0,01
Orange S.A. 28,86 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	194.453,24	0,02
Orange S.A. 24,78 %	15.12.2023	1.900.000	EUR	-129.888,81	-0,01
Orange S.A. 21,12 %	15.12.2023	3.000.000	EUR	-75.773,61	-0,01
Orange S.A. 26,39 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-193.346,58	-0,02
Orange S.A. 22,92 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-158.169,82	-0,02
Orange S.A. 22,00 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-78.282,63	-0,01
Orange S.A. 23,90 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	73.774,52	0,01
Orange S.A. 23,65 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-93.904,56	-0,01
Orange S.A. 22,64 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	-76.742,75	-0,01
Orange S.A. 22,65 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-89.492,72	-0,01
Orange S.A. 21,88 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-54.824,98	-0,01
Packaging Corp. of America 34,22 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-7.770,16	0,00
Packaging Corp. of America 30,28 %	16.06.2023	1.300.000	USD	21.532,42	0,00
PayPal Holdings, Inc. 35,62 %	20.01.2023	1.500.000	USD	255.614,13	0,02
PepsiCo, Inc. 23,73 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-142.878,99	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-5.266,01	0,00
PepsiCo, Inc. 25,94 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-59.669,22	-0,01
PepsiCo, Inc. 25,67 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-58.449,87	-0,01
PepsiCo, Inc. 26,45 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-68.003,84	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,67 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-65.410,91	-0,01
PepsiCo, Inc. 26,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-52.199,54	-0,01
PepsiCo, Inc. 22,91 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-27.685,20	0,00
Pfizer, Inc. 23,98 %	20.01.2023	1.500.000	USD	73.522,88	0,01
PNC Financial Services Group, Inc./The 35,37 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-35.719,90	0,00
PNC Financial Services Group, Inc./The 35,43 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-21.036,71	0,00
PNC Financial Services Group, Inc./The 37,37 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-74.636,25	-0,01
PPG Industries, Inc. 27,72 %	20.01.2023	1.500.000	USD	56.402,58	0,01
Prudential Financial, Inc. 39,77 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-64.442,70	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,04 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-86.663,50	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,02 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-67.845,13	-0,01
Prudential Financial, Inc. 39,38 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-203.937,60	-0,02
Prudential Financial, Inc. 38,22 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-105.324,99	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-44.829,10	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-60.464,16	-0,01
Prudential Financial, Inc. 42,04 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-312.776,85	-0,03

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Prudential Financial, Inc. 34,34 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-92.286,66	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-46.561,32	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,46 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-35.223,76	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,55 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-222.717,83	-0,02
Prudential Financial, Inc. 38,86 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-58.833,09	-0,01
Prudential Financial, Inc. 40,69 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-158.417,70	-0,02
Prudential Financial, Inc. 36,22 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-50.047,94	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,97 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-74.497,12	-0,01
Prudential Financial, Inc. 32,90 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-6.881,80	0,00
Prudential Financial, Inc. 33,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-9.995,60	0,00
Prudential Financial, Inc. 35,45 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-30.921,04	0,00
Prudential Financial, Inc. 32,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	1.545,44	0,00
Prudential Financial, Inc. 36,90 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-200.101,75	-0,02
Prudential Financial, Inc. 34,17 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-23.873,96	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,29 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-74.848,81	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,32 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-123.746,62	-0,01
Prudential Financial, Inc. 35,87 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-121.957,91	-0,01
Prudential Financial, Inc. 35,38 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-66.212,48	-0,01
Prudential Financial, Inc. 33,31 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-90.722,32	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,90 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-48.993,96	0,00
Prudential Financial, Inc. 37,65 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-57.370,06	-0,01
Prudential Financial, Inc. 34,30 %	20.01.2023	550.000	USD	28.557,72	0,00
Prudential Financial, Inc. 40,92 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-122.513,25	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,33 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-73.894,68	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,87 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-109.125,38	-0,01
Prudential Financial, Inc. 38,31 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-78.420,93	-0,01
Prudential Financial, Inc. 37,77 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-96.549,67	-0,01
Prudential Financial, Inc. 35,80 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-76.742,45	-0,01
Prudential Financial, Inc. 36,98 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-49.866,77	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,03 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-89.322,63	-0,01
Prudential Financial, Inc. 40,10 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-131.039,75	-0,01
Prudential Financial, Inc. 31,67 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-39.453,52	0,00
Prudential Financial, Inc. 34,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-31.605,57	0,00
Prudential PLC 34,98 %	15.12.2023	1.263.100	GBP	34.933,25	0,00
Prudential PLC 32,00 %	16.06.2023	1.657.400	GBP	153.836,48	0,01
Regions Financial Corp. 35,25 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-17.829,84	0,00
Roche Holding AG 23,89 %	15.12.2023	984.000	CHF	-48.372,35	0,00
Roche Holding AG 22,53 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-48.331,34	0,00
Roche Holding AG 22,35 %	15.12.2023	1.964.600	CHF	-36.290,79	0,00
RWE AG 42,55 %	16.06.2023	1.200.000	EUR	158.780,33	0,01
RWE AG 32,82 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	5.663,78	0,00
S&P 500 Index 25,07 %	19.01.2024	27.500.000	USD	470.574,27	0,04
S&P 500 Index 27,13 %	19.01.2024	21.600.000	USD	745.853,22	0,07
S&P 500 Index 25,24 %	19.01.2024	19.200.000	USD	248.449,35	0,02
S&P 500 Index 24,75 %	19.01.2024	20.000.000	USD	133.513,23	0,01
S&P 500 Index 26,62 %	19.01.2024	15.000.000	USD	379.374,71	0,04
S&P 500 Index 24,39 %	19.01.2024	22.500.000	USD	365.412,23	0,03
S&P 500 Index 25,79 %	15.12.2023	13.172.000	USD	290.715,44	0,03
S&P 500 Index 24,32 %	19.01.2024	22.500.000	USD	69.825,80	0,01
S&P 500 Index 27,40 %	15.12.2023	20.263.300	USD	732.819,09	0,07
S&P 500 Index 25,98 %	19.01.2024	16.000.000	USD	350.901,10	0,03
S&P 500 Index 24,92 %	15.12.2023	16.670.100	USD	356.556,45	0,03
S&P 500 Index 24,27 %	19.01.2024	25.000.000	USD	385.953,15	0,04
S&P 500 Index 25,90 %	19.01.2024	25.200.000	USD	614.191,24	0,06
S&P 500 Index 27,37 %	19.01.2024	21.600.000	USD	793.093,31	0,07
S&P 500 Index 24,33 %	19.01.2024	22.500.000	USD	64.372,45	0,01
S&P 500 Index 27,16 %	19.01.2024	19.500.000	USD	634.006,43	0,06
S&P 500 Index 24,98 %	15.12.2023	15.433.080	USD	249.914,82	0,02
S&P 500 Index 26,10 %	19.01.2024	24.000.000	USD	639.232,72	0,06

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index 26,70 %	19.01.2024	18.000.000	USD	451.582,35	0,04
S&P 500 Index 26,84 %	15.12.2023	14.745.000	USD	457.273,50	0,04
S&P 500 Index 25,71 %	19.01.2024	19.500.000	USD	332.631,72	0,03
S&P 500 Index 23,96 %	15.12.2023	14.748.000	USD	181.367,17	0,02
S&P 500 Index 26,06 %	19.01.2024	16.800.000	USD	372.815,49	0,04
S&P 500 Index 24,90 %	19.01.2024	21.000.000	USD	173.653,13	0,02
S&P 500 Index 25,95 %	15.12.2023	15.075.000	USD	347.748,65	0,03
S&P 500 Index 26,40 %	19.01.2024	19.000.000	USD	515.029,16	0,05
S&P 500 Index 23,31 %	19.01.2024	22.500.000	USD	212.414,97	0,02
S&P 500 Index 27,88 %	19.01.2024	16.000.000	USD	610.790,12	0,06
S&P 500 Index 23,30 %	19.01.2024	18.000.000	USD	159.068,05	0,01
S&P 500 Index 24,09 %	16.06.2023	14.400.000	USD	10.825,94	0,00
S&P 500 Index 24,50 %	20.01.2023	20.000.000	USD	168.422,95	0,02
S&P 500 Index 22,97 %	20.01.2023	5.400.000	USD	-79.466,14	-0,01
S&P 500 Index 21,54 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-353.022,26	-0,03
S&P 500 Index 23,71 %	20.01.2023	27.000.000	USD	-223.906,34	-0,02
S&P 500 Index 25,53 %	16.06.2023	24.700.000	USD	500.828,74	0,05
S&P 500 Index 21,82 %	20.01.2023	14.000.000	USD	-183.017,16	-0,02
S&P 500 Index 27,23 %	16.06.2023	21.600.000	USD	586.680,70	0,06
S&P 500 Index 25,46 %	19.01.2024	21.000.000	USD	333.863,31	0,03
S&P 500 Index 21,06 %	20.01.2023	25.500.000	USD	-505.784,29	-0,05
S&P 500 Index 25,35 %	16.06.2023	21.600.000	USD	190.282,19	0,02
S&P 500 Index 24,02 %	20.01.2023	18.700.000	USD	-99.897,86	-0,01
S&P 500 Index 25,83 %	19.01.2024	19.500.000	USD	358.168,18	0,03
S&P 500 Index 24,15 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-83.989,69	-0,01
S&P 500 Index 23,74 %	20.01.2023	16.200.000	USD	-122.416,15	-0,01
S&P 500 Index 20,70 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-337.608,99	-0,03
S&P 500 Index 21,65 %	20.01.2023	26.000.000	USD	-329.907,05	-0,03
S&P 500 Index 25,77 %	16.06.2023	18.000.000	USD	192.838,06	0,02
S&P 500 Index 21,84 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-93.076,98	-0,01
S&P 500 Index 24,32 %	19.01.2024	21.120.000	USD	108.641,60	0,01
S&P 500 Index 26,78 %	16.06.2023	19.500.000	USD	367.288,28	0,03
S&P 500 Index 24,26 %	20.01.2023	18.000.000	USD	-61.903,81	-0,01
S&P 500 Index 25,64 %	16.06.2023	9.750.000	USD	67.540,80	0,01
S&P 500 Index 22,26 %	20.01.2023	19.500.000	USD	20.336,09	0,00
S&P 500 Index 22,93 %	20.01.2023	22.750.000	USD	-296.136,68	-0,03
S&P 500 Index 24,87 %	19.01.2024	12.500.000	USD	122.112,56	0,01
S&P 500 Index 26,47 %	16.06.2023	19.500.000	USD	386.479,86	0,04
S&P 500 Index 26,03 %	19.01.2024	20.800.000	USD	407.828,70	0,04
S&P 500 Index 25,50 %	16.06.2023	7.385.000	USD	150.771,85	0,01
S&P 500 Index 24,29 %	20.01.2023	9.000.000	USD	-21.497,70	0,00
S&P 500 Index 21,75 %	20.01.2023	21.000.000	USD	-510.598,79	-0,05
S&P 500 Index 24,48 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-3.806,46	0,00
S&P 500 Index 25,87 %	16.06.2023	27.000.000	USD	440.632,16	0,04
S&P 500 Index 24,72 %	16.06.2023	20.400.000	USD	132.249,16	0,01
S&P 500 Index 24,76 %	16.06.2023	19.500.000	USD	135.752,15	0,01
S&P 500 Index 24,46 %	16.06.2023	16.100.000	USD	61.626,83	0,01
S&P 500 Index 23,04 %	20.01.2023	8.000.000	USD	-97.544,98	-0,01
S&P 500 Index 23,90 %	16.06.2023	11.250.000	USD	-19.151,09	0,00
S&P 500 Index 22,15 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-195.809,23	-0,02
S&P 500 Index 23,35 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-103.145,56	-0,01
S&P 500 Index 23,66 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-77.792,97	-0,01
S&P 500 Index 24,40 %	16.06.2023	11.250.000	USD	31.985,32	0,00
S&P 500 Index 25,82 %	16.06.2023	19.800.000	USD	324.536,71	0,03
S&P 500 Index 26,86 %	16.06.2023	19.760.000	USD	594.897,18	0,06
S&P 500 Index 22,14 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-219.203,94	-0,02
S&P 500 Index 22,76 %	20.01.2023	27.000.000	USD	-448.362,41	-0,04
S&P 500 Index 27,57 %	16.06.2023	21.000.000	USD	799.461,59	0,08
S&P 500 Index 25,97 %	16.06.2023	20.900.000	USD	381.997,37	0,04

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
S&P 500 Index 22,55 %	20.01.2023	12.500.000	USD	-230.581,98	-0,02
S&P 500 Index 22,80 %	20.01.2023	18.000.000	USD	-160.869,49	-0,02
S&P 500 Index 25,24 %	16.06.2023	10.000.000	USD	88.433,64	0,01
S&P 500 Index 22,63 %	20.01.2023	10.000.000	USD	-100.258,05	-0,01
S&P 500 Index 26,42 %	16.06.2023	14.280.000	USD	393.101,21	0,04
S&P 500 Index 25,53 %	16.06.2023	10.000.000	USD	114.909,91	0,01
S&P 500 Index 25,64 %	16.06.2023	19.500.000	USD	244.629,30	0,02
S&P 500 Index 22,42 %	20.01.2023	11.250.000	USD	-125.983,87	-0,01
S&P 500 Index 21,50 %	20.01.2023	13.260.000	USD	-34.837,06	0,00
S&P 500 Index 26,10 %	16.06.2023	20.000.000	USD	382.964,44	0,04
S&P 500 Index 24,54 %	20.01.2023	18.000.000	USD	8.052,90	0,00
S&P 500 Index 23,60 %	19.01.2024	24.000.000	USD	-65.706,82	-0,01
S&P 500 Index 25,01 %	19.01.2024	8.000.000	USD	82.825,73	0,01
S&P 500 Index 25,59 %	20.01.2023	13.440.000	USD	140.994,00	0,01
S&P 500 Index 25,17 %	19.01.2024	20.000.000	USD	247.071,44	0,02
S&P 500 Index 26,17 %	20.01.2023	15.300.000	USD	233.639,63	0,02
S&P 500 Index 27,12 %	20.01.2023	19.200.000	USD	455.778,59	0,04
S&P 500 Index 27,05 %	20.01.2023	17.500.000	USD	412.041,41	0,04
S&P 500 Index 20,15 %	20.01.2023	21.000.000	USD	-224.565,11	-0,02
S&P 500 Index 24,94 %	19.01.2024	16.500.000	USD	163.900,16	0,02
S&P 500 Index 20,20 %	20.01.2023	12.000.000	USD	-148.345,86	-0,01
S&P 500 Index 22,70 %	20.01.2023	8.450.000	USD	-160.819,91	-0,02
S&P 500 Index 25,14 %	16.06.2023	20.000.000	USD	27.619,39	0,00
S&P 500 Index 24,35 %	19.01.2024	15.000.000	USD	62.587,92	0,01
S&P 500 Index 22,71 %	20.01.2023	8.500.000	USD	-157.192,77	-0,01
S&P 500 Index 23,46 %	20.01.2023	5.070.000	USD	-55.695,18	-0,01
S&P 500 Index 20,38 %	20.01.2023	23.800.000	USD	-184.484,62	-0,02
S&P 500 Index 23,30 %	19.01.2024	25.000.000	USD	-116.174,98	-0,01
S&P 500 Index 19,75 %	20.01.2023	19.500.000	USD	-256.216,20	-0,02
S&P 500 Index 23,57 %	19.01.2024	20.000.000	USD	-50.993,68	0,00
S&P 500 Index 20,78 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-51.502,27	0,00
S&P 500 Index 20,76 %	20.01.2023	21.000.000	USD	-91.930,51	-0,01
S&P 500 Index 20,88 %	20.01.2023	25.000.000	USD	-157.040,05	-0,01
S&P 500 Index 24,00 %	19.01.2024	20.000.000	USD	13.969,36	0,00
S&P 500 Index 23,58 %	19.01.2024	18.000.000	USD	-30.884,11	0,00
S&P 500 Index 22,60 %	16.06.2023	14.000.000	USD	-168.652,09	-0,02
S&P 500 Index 26,26 %	20.01.2023	19.800.000	USD	322.333,24	0,03
S&P 500 Index 23,22 %	16.06.2023	25.000.000	USD	-417.138,44	-0,04
S&P 500 Index 22,42 %	16.06.2023	10.200.000	USD	-213.931,26	-0,02
S&P 500 Index 25,38 %	15.12.2023	8.000.000	USD	102.746,61	0,01
S&P 500 Index 20,37 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-62.808,57	-0,01
S&P 500 Index 25,99 %	19.01.2024	18.000.000	USD	353.176,11	0,03
S&P 500 Index 20,65 %	20.01.2023	15.000.000	USD	-134.616,16	-0,01
S&P 500 Index 25,45 %	19.01.2024	27.500.000	USD	388.395,85	0,04
S&P 500 Index 21,93 %	20.01.2023	9.900.000	USD	266.579,61	0,03
S&P 500 Index 22,16 %	20.01.2023	10.400.000	USD	-252.732,52	-0,02
S&P 500 Index 23,67 %	19.01.2024	22.500.000	USD	-57.369,14	-0,01
S&P 500 Index 24,11 %	15.12.2023	16.731.000	USD	6.042,60	0,00
S&P 500 Index 20,86 %	20.01.2023	15.000.000	USD	23.030,78	0,00
S&P Global, Inc. 34,84 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-41.033,15	0,00
Sanofi 24,80 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	7.407,04	0,00
Sanofi 23,62 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	14.029,58	0,00
Sanofi 24,07 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	10.058,96	0,00
Sanofi 24,11 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	5.480,48	0,00
SAP SE 29,10 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-7.813,99	0,00
SAP SE 30,82 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-24.674,16	0,00
SAP SE 32,96 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-50.643,05	0,00
SAP SE 29,80 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-17.454,87	0,00
Schneider Electric SE 33,15 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-37.336,80	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Schneider Electric SE 34,36 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-42.190,48	0,00
Schneider Electric SE 32,45 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-27.364,09	0,00
Schneider Electric SE 31,37 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-7.026,82	0,00
Schneider Electric SE 34,89 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-58.596,68	-0,01
Schneider Electric SE 32,40 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-29.500,12	0,00
Schneider Electric SE 29,81 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	314,68	0,00
Schneider Electric SE 33,07 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-15.743,56	0,00
Schneider Electric SE 31,36 %	15.12.2023	1.300.000	EUR	-17.738,84	0,00
Sempra Energy 29,85 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-89.967,19	-0,01
Sempra Energy 27,70 %	19.01.2024	1.200.000	USD	9.806,05	0,00
Sempra Energy 28,64 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-663,78	0,00
Sempra Energy 29,68 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-9.190,07	0,00
Sempra Energy 28,13 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-92.218,48	-0,01
Sempra Energy 26,37 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-55.803,57	-0,01
Sempra Energy 30,31 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-47.755,45	0,00
Sempra Energy 29,38 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-8.229,49	0,00
Sempra Energy 26,61 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-24.184,87	0,00
Sempra Energy 27,31 %	19.01.2024	1.500.000	USD	29.527,90	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 45,17 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-21.819,01	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 38,07 %	20.01.2023	1.300.000	USD	25.830,70	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 45,04 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-32.256,17	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 40,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	56.800,80	0,01
Skyworks Solutions, Inc. 35,67 %	20.01.2023	1.500.000	USD	43.751,59	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 44,87 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-17.695,64	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 44,93 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-13.219,18	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 44,99 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-31.851,92	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 42,37 %	19.01.2024	2.000.000	USD	22.768,52	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 37,01 %	20.01.2023	1.500.000	USD	30.269,28	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 39,95 %	20.01.2023	2.500.000	USD	67.683,09	0,01
Skyworks Solutions, Inc. 40,21 %	20.01.2023	550.000	USD	-14.238,20	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 41,28 %	20.01.2023	2.000.000	USD	32.721,65	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 38,80 %	20.01.2023	1.111.100	USD	17.925,40	0,00
Skyworks Solutions, Inc. 38,80 %	20.01.2023	1.200.000	USD	8.833,56	0,00
Societe Generale S.A. 43,91 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-70.591,83	-0,01
Societe Generale S.A. 41,02 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-64.295,04	-0,01
Societe Generale S.A. 42,55 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-86.440,63	-0,01
Societe Generale S.A. 44,05 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-147.741,36	-0,01
Southern Co./The 27,01 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-31.725,69	0,00
Southern Co./The 26,46 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-24.313,21	0,00
Southern Co./The 22,66 %	20.01.2023	2.000.000	USD	7.389,63	0,00
Southern Co./The 27,32 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-34.124,23	0,00
Southern Co./The 25,11 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-7.063,00	0,00
Southwest Airlines Co. 42,33 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-58.610,82	-0,01
Square, Inc. 43,60 %	20.01.2023	1.111.100	USD	386.987,92	0,04
Square, Inc. 61,50 %	20.01.2023	550.000	USD	-104.326,05	-0,01
Starbucks Corp. 32,09 %	20.01.2023	1.100.000	USD	46.396,85	0,00
Starbucks Corp. 35,11 %	20.01.2023	1.400.000	USD	13.214,74	0,00
Starbucks Corp. 30,82 %	20.01.2023	2.000.000	USD	59.658,86	0,01
Starbucks Corp. 33,20 %	19.01.2024	2.000.000	USD	17.641,62	0,00
Starbucks Corp. 28,19 %	20.01.2023	1.500.000	USD	52.235,86	0,00
Starbucks Corp. 29,10 %	20.01.2023	1.500.000	USD	68.199,49	0,01
Starbucks Corp. 28,41 %	20.01.2023	2.500.000	USD	74.759,10	0,01
Starbucks Corp. 34,71 %	20.01.2023	1.800.000	USD	25.685,10	0,00
Starbucks Corp. 30,21 %	20.01.2023	1.300.000	USD	35.422,17	0,00
Starbucks Corp. 29,10 %	20.01.2023	2.500.000	USD	58.639,15	0,01
Starbucks Corp. 35,69 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-15.563,59	0,00
Starbucks Corp. 32,15 %	20.01.2023	1.200.000	USD	51.530,59	0,00
State Street Corp. 41,25 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-21.093,13	0,00
Stellantis NV 36,85 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-34.066,06	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Swiss Life Holding AG 27,80 %	15.12.2023	1.190.600	CHF	-52.533,02	-0,01
Swiss Life Holding AG 28,14 %	16.06.2023	2.024.000	CHF	-70.623,09	-0,01
Swiss Life Holding AG 29,67 %	15.12.2023	1.491.000	CHF	-94.031,98	-0,01
Swiss Life Holding AG 28,20 %	15.12.2023	2.069.034	CHF	-79.512,54	-0,01
Swiss Life Holding AG 26,73 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-29.101,37	0,00
Swiss Life Holding AG 27,08 %	16.06.2023	2.033.200	CHF	-51.006,42	0,00
Swiss Life Holding AG 28,92 %	15.12.2023	1.964.600	CHF	-92.787,67	-0,01
Swiss Life Holding AG 28,96 %	15.12.2023	984.000	CHF	-55.900,76	-0,01
Swiss Life Holding AG 27,14 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-47.184,33	0,00
Swiss Life Holding AG 28,25 %	15.12.2023	1.478.000	CHF	-72.147,79	-0,01
Swiss Life Holding AG 28,39 %	15.12.2023	1.531.500	CHF	-60.616,64	-0,01
Swiss Life Holding AG 25,84 %	15.12.2023	980.300	CHF	-20.912,11	0,00
Swiss Life Holding AG 26,42 %	16.06.2023	2.040.000	CHF	-37.178,68	0,00
Swiss Life Holding AG 28,27 %	16.06.2023	1.439.000	CHF	-53.769,54	-0,01
Swiss Re AG 28,57 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-85.159,91	-0,01
Swiss Re AG 26,17 %	16.06.2023	2.040.000	CHF	-43.336,34	0,00
Swiss Re AG 28,00 %	16.06.2023	2.024.000	CHF	-79.351,27	-0,01
Swiss Re AG 28,42 %	15.12.2023	1.478.000	CHF	-59.936,46	-0,01
Swiss Re AG 29,01 %	15.12.2023	1.531.500	CHF	-69.618,96	-0,01
Swiss Re AG 25,94 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-18.928,21	0,00
Swiss Re AG 28,40 %	15.12.2023	1.964.600	CHF	-81.606,02	-0,01
Swiss Re AG 30,87 %	15.12.2023	2.034.400	CHF	-139.899,84	-0,01
Swiss Re AG 30,00 %	16.06.2023	1.768.500	CHF	-116.433,14	-0,01
Swiss Re AG 28,05 %	16.06.2023	2.546.409	CHF	-113.922,68	-0,01
Swiss Re AG 28,33 %	16.06.2023	1.439.000	CHF	-65.450,40	-0,01
Swiss Re AG 27,65 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-37.480,25	0,00
Swiss Re AG 26,96 %	15.12.2023	2.069.034	CHF	-53.175,62	-0,01
Swiss Re AG 27,91 %	15.12.2023	1.552.500	CHF	-53.918,74	-0,01
Telefonica S.A. 26,92 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-13.802,74	0,00
Telefonica S.A. 28,82 %	16.06.2023	2.000.000	EUR	-76.310,76	-0,01
Telefonica S.A. 28,95 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-35.285,39	0,00
Telefonica S.A. 28,00 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-50.193,34	0,00
Telefonica S.A. 25,21 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	19.577,10	0,00
Texas Instruments, Inc. 31,00 %	20.01.2023	2.500.000	USD	12.370,21	0,00
Texas Instruments, Inc. 30,95 %	20.01.2023	2.500.000	USD	11.821,86	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,90 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-58.625,25	-0,01
Texas Instruments, Inc. 30,77 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-24.675,74	0,00
Texas Instruments, Inc. 30,88 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-26.307,84	0,00
Texas Instruments, Inc. 31,70 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-34.397,26	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,52 %	20.01.2023	1.100.000	USD	-45.325,82	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,58 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-8.682,50	0,00
Texas Instruments, Inc. 32,08 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-73.890,15	-0,01
Texas Instruments, Inc. 32,90 %	16.06.2023	2.000.000	USD	3.192,62	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,56 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-45.856,34	0,00
Texas Instruments, Inc. 33,59 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-5.982,57	0,00
Texas Instruments, Inc. 31,32 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-56.134,85	-0,01
T-Mobile US, Inc. 35,04 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-92.406,60	-0,01
T-Mobile US, Inc. 31,86 %	20.01.2023	550.000	USD	22.133,34	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,64 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-52.807,32	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,23 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-64.095,18	-0,01
T-Mobile US, Inc. 32,92 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-56.567,05	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,30 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-25.630,58	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,09 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-44.379,99	0,00
T-Mobile US, Inc. 31,44 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-35.949,82	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-33.227,31	0,00
T-Mobile US, Inc. 33,88 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-57.817,43	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,65 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-85.481,35	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,25 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-106.367,97	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,58 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-39.129,66	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
T-Mobile US, Inc. 36,09 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-102.670,45	-0,01
T-Mobile US, Inc. 31,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-24.147,51	0,00
T-Mobile US, Inc. 29,63 %	19.01.2024	1.500.000	USD	1.623,49	0,00
T-Mobile US, Inc. 35,26 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-115.092,77	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,40 %	20.01.2023	1.111.100	USD	-20.986,17	0,00
T-Mobile US, Inc. 35,50 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-67.610,79	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,30 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-58.563,36	-0,01
T-Mobile US, Inc. 32,09 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-47.303,30	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,21 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-58.729,70	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,64 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-77.443,34	-0,01
T-Mobile US, Inc. 30,20 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-26.389,61	0,00
T-Mobile US, Inc. 30,10 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-3.438,01	0,00
T-Mobile US, Inc. 28,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	15.462,05	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,30 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-44.274,85	0,00
T-Mobile US, Inc. 31,55 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-27.423,70	0,00
T-Mobile US, Inc. 35,31 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-120.076,23	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,92 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-55.651,78	-0,01
T-Mobile US, Inc. 29,53 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-26.999,76	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,76 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-79.184,88	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,49 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-57.751,96	-0,01
T-Mobile US, Inc. 32,76 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-75.112,34	-0,01
T-Mobile US, Inc. 32,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-32.656,41	0,00
T-Mobile US, Inc. 34,76 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-67.523,19	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,93 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-65.958,44	-0,01
T-Mobile US, Inc. 34,47 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-66.936,68	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 28,78 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-100.017,61	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 30,06 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-61.890,36	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 26,22 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-10.360,70	0,00
Travelers Cos., Inc./The 28,17 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-51.585,64	0,00
Travelers Cos., Inc./The 30,14 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-58.777,57	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 31,75 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-61.937,15	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 31,41 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-85.971,19	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 28,60 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-42.418,03	0,00
Travelers Cos., Inc./The 28,01 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-43.162,99	0,00
Travelers Cos., Inc./The 29,42 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-50.686,01	0,00
Travelers Cos., Inc./The 30,21 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-58.307,00	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 31,34 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-74.684,29	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 30,00 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-44.151,78	0,00
Travelers Cos., Inc./The 29,46 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-59.731,33	-0,01
Travelers Cos., Inc./The 27,08 %	16.06.2023	1.900.000	USD	-33.162,77	0,00
Travelers Cos., Inc./The 29,10 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-42.770,35	0,00
Travelers Cos., Inc./The 32,16 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-63.543,71	-0,01
Truist Financial Corp. 34,05 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-15.962,54	0,00
Twitter, Inc. 47,95 %	20.01.2023	550.000	USD	-19.946,60	0,00
Tyson Foods, Inc. 32,10 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-7.737,46	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,28 %	19.01.2024	2.500.000	USD	8.301,23	0,00
Tyson Foods, Inc. 32,04 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-34.177,30	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,77 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-7.467,92	0,00
Tyson Foods, Inc. 34,69 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-24.586,91	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	38.680,68	0,00
Tyson Foods, Inc. 31,33 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-4,30	0,00
Tyson Foods, Inc. 33,05 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-13.571,39	0,00
Tyson Foods, Inc. 32,42 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-42.654,53	0,00
Tyson Foods, Inc. 26,75 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-19.011,78	0,00
Tyson Foods, Inc. 30,26 %	19.01.2024	1.500.000	USD	15.167,36	0,00
Tyson Foods, Inc. 28,20 %	19.01.2024	2.500.000	USD	63.906,85	0,01
Tyson Foods, Inc. 29,70 %	19.01.2024	2.000.000	USD	26.000,69	0,00
Tyson Foods, Inc. 29,24 %	19.01.2024	1.500.000	USD	26.429,39	0,00
Tyson Foods, Inc. 28,40 %	19.01.2024	1.500.000	USD	38.361,77	0,00

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



## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Tyson Foods, Inc. 32,40 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-12.069,51	0,00
U.S. Bancorp 34,39 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-81.527,01	-0,01
U.S. Bancorp 35,41 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-88.047,30	-0,01
U.S. Bancorp 32,41 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-26.346,76	0,00
U.S. Bancorp 30,97 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-8.625,32	0,00
U.S. Bancorp 33,00 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-24.919,06	0,00
U.S. Bancorp 33,13 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-59.201,51	-0,01
U.S. Bancorp 30,70 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-4.432,33	0,00
U.S. Bancorp 31,30 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-40.177,39	0,00
U.S. Bancorp 31,71 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-14.036,66	0,00
U.S. Bancorp 30,84 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-16.169,94	0,00
U.S. Bancorp 33,32 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-68.723,95	-0,01
UBS Group AG 33,45 %	16.06.2023	2.040.000	CHF	-20.457,10	0,00
UBS Group AG 34,49 %	15.12.2023	1.932.000	CHF	-44.645,88	0,00
UBS Group AG 33,49 %	15.12.2023	1.531.500	CHF	-8.297,54	0,00
UBS Group AG 32,27 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	7.499,49	0,00
UBS Group AG 33,02 %	15.12.2023	1.276.000	CHF	-12.735,80	0,00
UBS Group AG 33,73 %	15.12.2023	2.069.034	CHF	-17.958,02	0,00
UBS Group AG 33,75 %	16.06.2023	1.439.000	CHF	-12.414,89	0,00
Union Pacific Corp. 31,21 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-32.909,04	0,00
Union Pacific Corp. 30,43 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-10.418,10	0,00
Union Pacific Corp. 30,93 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-39.868,59	0,00
Union Pacific Corp. 29,50 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-50.267,94	0,00
Union Pacific Corp. 31,09 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-84.032,16	-0,01
Union Pacific Corp. 30,81 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-112.590,35	-0,01
Union Pacific Corp. 29,99 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-10.006,51	0,00
Union Pacific Corp. 30,36 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-10.108,26	0,00
Union Pacific Corp. 30,80 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-17.642,90	0,00
Union Pacific Corp. 31,28 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-76.454,73	-0,01
Union Pacific Corp. 29,62 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-2.368,06	0,00
Union Pacific Corp. 30,21 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-53.189,00	-0,01
Union Pacific Corp. 29,61 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-32.242,68	0,00
Union Pacific Corp. 32,37 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-136.618,03	-0,01
Union Pacific Corp. 32,41 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-50.925,22	0,00
Union Pacific Corp. 29,82 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-83.472,21	-0,01
Union Pacific Corp. 33,24 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-63.236,01	-0,01
Union Pacific Corp. 30,31 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-96.863,64	-0,01
Union Pacific Corp. 31,77 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-59.316,78	-0,01
Union Pacific Corp. 31,64 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-67.577,56	-0,01
Union Pacific Corp. 29,20 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-68.318,89	-0,01
Union Pacific Corp. 32,40 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-98.219,68	-0,01
Union Pacific Corp. 33,34 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-74.824,41	-0,01
Union Pacific Corp. 29,40 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-57.212,07	-0,01
United Rentals, Inc. 44,71 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-42.872,95	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 30,00 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-74.518,86	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 32,62 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-130.186,79	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,87 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-42.206,99	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 29,03 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-15.405,24	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,87 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-89.997,38	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,16 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-50.589,86	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,30 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-53.643,29	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 28,50 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-72.575,24	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 28,77 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-78.630,42	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,73 %	16.06.2023	1.700.000	USD	-96.703,54	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,09 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-54.482,37	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 30,76 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-70.247,69	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 29,50 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-89.644,31	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,14 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-56.610,26	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 33,50 %	16.06.2023	1.000.000	USD	-68.398,46	-0,01

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
UnitedHealth Group, Inc. 32,49 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-41.389,44	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 31,01 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-44.655,07	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 32,29 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-46.101,98	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 30,99 %	16.06.2023	2.500.000	USD	-107.682,36	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 33,75 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-91.574,12	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 33,88 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-92.365,19	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 30,68 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-57.270,52	-0,01
Verizon Communications, Inc. 21,09 %	20.01.2023	2.000.000	USD	33.785,67	0,00
Verizon Communications, Inc. 22,92 %	16.06.2023	2.500.000	USD	66.338,96	0,01
Verizon Communications, Inc. 21,38 %	20.01.2023	1.300.000	USD	31.651,06	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 32,41 %	16.06.2023	1.300.000	USD	14.633,54	0,00
Vertex Pharmaceuticals, Inc. 36,36 %	16.06.2023	1.300.000	USD	-31.834,42	0,00
Vinci S.A. 31,43 %	15.12.2023	1.000.000	EUR	-55.675,05	-0,01
Vinci S.A. 31,70 %	16.06.2023	1.750.000	EUR	-136.791,93	-0,01
Vinci S.A. 31,16 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-79.624,51	-0,01
Vinci S.A. 31,30 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-107.124,54	-0,01
Vinci S.A. 30,40 %	15.12.2023	1.500.000	EUR	-73.831,63	-0,01
Vinci S.A. 30,56 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-55.168,78	-0,01
Vinci S.A. 30,73 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-95.028,38	-0,01
Vinci S.A. 31,23 %	15.12.2023	2.001.000	EUR	-111.514,15	-0,01
Vinci S.A. 31,68 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-125.123,22	-0,01
Vinci S.A. 31,40 %	16.06.2023	2.500.000	EUR	-185.515,07	-0,02
Vinci S.A. 32,11 %	16.06.2023	1.400.000	EUR	-113.808,07	-0,01
Vinci S.A. 32,90 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-83.193,79	-0,01
Vinci S.A. 30,79 %	15.12.2023	1.200.000	EUR	-61.814,77	-0,01
Vinci S.A. 30,28 %	15.12.2023	2.000.000	EUR	-99.582,90	-0,01
VMware, Inc. 35,39 %	16.06.2023	2.000.000	USD	-25.955,06	0,00
VMware, Inc. 37,33 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-45.905,16	0,00
VMware, Inc. 39,30 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-69.302,35	-0,01
VMware, Inc. 37,60 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-34.746,16	0,00
VMware, Inc. 33,06 %	20.01.2023	1.500.000	USD	10.412,72	0,00
VMware, Inc. 41,86 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-77.198,86	-0,01
VMware, Inc. 36,46 %	20.01.2023	1.300.000	USD	-12.551,29	0,00
VMware, Inc. 35,69 %	16.06.2023	1.200.000	USD	-21.985,85	0,00
VMware, Inc. 30,75 %	20.01.2023	1.700.000	USD	45.235,88	0,00
VMware, Inc. 31,03 %	20.01.2023	2.500.000	USD	53.924,32	0,01
VMware, Inc. 29,91 %	20.01.2023	2.500.000	USD	80.090,05	0,01
VMware, Inc. 35,00 %	20.01.2023	1.800.000	USD	1.601,91	0,00
Walmart, Inc. 23,52 %	16.06.2023	1.200.000	USD	48.665,12	0,00
Walmart, Inc. 23,66 %	20.01.2023	1.700.000	USD	77.263,90	0,01
Walmart, Inc. 23,10 %	20.01.2023	2.000.000	USD	72.138,43	0,01
Walmart, Inc. 27,26 %	20.01.2023	1.200.000	USD	8.487,10	0,00
Walt Disney Co./The 28,77 %	20.01.2023	550.000	USD	-53.099,39	-0,01
Walt Disney Co./The 30,13 %	20.01.2023	2.000.000	USD	151.470,85	0,01
Walt Disney Co./The 30,90 %	20.01.2023	2.000.000	USD	131.164,41	0,01
Walt Disney Co./The 31,29 %	20.01.2023	1.300.000	USD	48.661,20	0,00
Walt Disney Co./The 30,50 %	20.01.2023	1.111.100	USD	51.204,25	0,00
Waste Management, Inc. 29,81 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-44.681,01	0,00
Waste Management, Inc. 26,18 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-15.956,13	0,00
Waste Management, Inc. 31,83 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-124.473,60	-0,01
Waste Management, Inc. 26,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-18.204,23	0,00
Waste Management, Inc. 26,95 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-28.198,89	0,00
Western Union Co./The 35,14 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-19.853,05	0,00
Western Union Co./The 37,86 %	16.06.2023	1.500.000	USD	-57.238,38	-0,01
Williams Cos., Inc./The 30,74 %	20.01.2023	1.600.000	USD	-8.620,65	0,00
Williams Cos., Inc./The 35,11 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-58.029,21	-0,01
Williams Cos., Inc./The 34,79 %	20.01.2023	2.500.000	USD	-111.790,55	-0,01
Williams Cos., Inc./The 33,31 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-38.210,09	0,00
Williams Cos., Inc./The 28,89 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-31.553,93	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Williams Cos., Inc./The 34,19 %	20.01.2023	1.700.000	USD	-66.562,22	-0,01
Williams Cos., Inc./The 32,65 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-17.028,98	0,00
Williams Cos., Inc./The 33,42 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-61.641,00	-0,01
Williams Cos., Inc./The 35,23 %	20.01.2023	1.400.000	USD	-68.981,69	-0,01
Williams Cos., Inc./The 35,01 %	16.06.2023	1.800.000	USD	-61.211,23	-0,01
Williams Cos., Inc./The 31,07 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-33.194,72	0,00
Williams Cos., Inc./The 32,59 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-14.828,05	0,00
Williams Cos., Inc./The 31,92 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-43.978,96	0,00
Williams Cos., Inc./The 32,41 %	19.01.2024	2.500.000	USD	-40.482,19	0,00
Williams Cos., Inc./The 30,55 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-24.513,83	0,00
Williams Cos., Inc./The 30,00 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-21.518,09	0,00
Williams Cos., Inc./The 32,58 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-45.801,33	0,00
Williams Cos., Inc./The 30,60 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-43.244,39	0,00
Williams Cos., Inc./The 29,58 %	20.01.2023	1.500.000	USD	-20.448,52	0,00
Williams Cos., Inc./The 30,74 %	20.01.2023	3.000.000	USD	-35.364,75	0,00
Williams Cos., Inc./The 34,18 %	20.01.2023	1.800.000	USD	-72.086,89	-0,01
Yum China Holdings, Inc. 29,70 %	20.01.2023	1.500.000	USD	214.832,90	0,02
Yum! Brands, Inc. 27,34 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-41.883,81	0,00
Yum! Brands, Inc. 30,83 %	20.01.2023	1.200.000	USD	-77.349,48	-0,01
Yum! Brands, Inc. 27,44 %	20.01.2023	2.000.000	USD	-64.897,11	-0,01
Yum! Brands, Inc. 30,74 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-65.259,83	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,78 %	19.01.2024	1.200.000	USD	-75.009,94	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,16 %	19.01.2024	2.000.000	USD	-107.678,89	-0,01
Yum! Brands, Inc. 28,13 %	19.01.2024	1.500.000	USD	-39.944,27	0,00
Yum! Brands, Inc. 29,74 %	19.01.2024	1.800.000	USD	-83.306,33	-0,01
Yum! Brands, Inc. 31,82 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-82.282,02	-0,01
Yum! Brands, Inc. 27,78 %	19.01.2024	1.600.000	USD	-38.250,91	0,00
Yum! Brands, Inc. 30,21 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-48.082,74	0,00
Yum! Brands, Inc. 31,18 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-55.925,48	-0,01
Zoom Video Communications, Inc. 61,94 %	20.01.2023	550.000	USD	-5.505,80	0,00
Zoom Video Communications, Inc. 44,40 %	20.01.2023	1.111.100	USD	168.296,14	0,02
Zurich Insurance Group AG 24,00 %	15.12.2023	2.069.034	CHF	-57.940,07	-0,01
Zurich Insurance Group AG 22,74 %	16.06.2023	2.603.000	CHF	-44.228,63	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,90 %	15.12.2023	1.276.000	CHF	-23.860,95	0,00
Zurich Insurance Group AG 25,45 %	16.06.2023	1.439.000	CHF	-80.666,36	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,69 %	15.12.2023	1.183.764	CHF	-46.022,30	0,00
Zurich Insurance Group AG 23,39 %	15.12.2023	1.441.500	CHF	-38.610,71	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,71 %	15.12.2023	1.238.400	CHF	-18.438,41	0,00
Zurich Insurance Group AG 24,81 %	16.06.2023	2.024.000	CHF	-91.952,41	-0,01
Zurich Insurance Group AG 28,25 %	16.06.2023	2.038.900	CHF	-150.606,02	-0,01
Zurich Insurance Group AG 25,92 %	15.12.2023	1.531.500	CHF	-71.312,38	-0,01
Zurich Insurance Group AG 23,74 %	15.12.2023	1.552.500	CHF	-40.454,97	0,00
Zurich Insurance Group AG 22,06 %	15.12.2023	2.916.000	CHF	-39.082,71	0,00
Zurich Insurance Group AG 24,21 %	15.12.2023	980.300	CHF	-32.300,62	0,00
Zurich Insurance Group AG 26,43 %	15.12.2023	2.034.400	CHF	-121.181,97	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,74 %	16.06.2023	2.546.409	CHF	-123.865,86	-0,01
Zurich Insurance Group AG 23,82 %	16.06.2023	2.040.000	CHF	-73.236,54	-0,01
Zurich Insurance Group AG 25,00 %	16.06.2023	1.768.500	CHF	-99.703,45	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,44 %	15.12.2023	1.932.000	CHF	-68.396,62	-0,01
Zurich Insurance Group AG 27,94 %	15.12.2023	1.963.300	CHF	142.729,44	0,01
Zurich Insurance Group AG 25,50 %	15.12.2023	1.948.000	CHF	-91.745,00	-0,01
Zurich Insurance Group AG 25,18 %	15.12.2023	1.964.600	CHF	-79.643,84	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,28 %	16.06.2023	2.033.200	CHF	-78.455,44	-0,01
Zurich Insurance Group AG 24,79 %	15.12.2023	2.058.000	CHF	-77.739,42	-0,01
Zurich Insurance Group AG 27,10 %	16.06.2023	1.174.100	CHF	90.734,42	0,01
Zurich Insurance Group AG 25,10 %	15.12.2023	1.190.600	CHF	-51.873,64	-0,01
<b>Summe Volatility Swaps</b>				<b>-45.776.842,41</b>	<b>-4,33</b>
				<b>-45.776.842,41</b>	<b>-4,33</b>

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Differenzkontrakte	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
<b>Deutschland</b>				
Allianz SE	-12.166.744	EUR	-54.928,82	-0,01
Bayerische Motoren Werke AG	-8.568.148	EUR	-58.211,91	-0,01
			<b>-113.140,73</b>	<b>-0,02</b>
<b>Frankreich</b>				
AXA S.A.	-2.370.188	EUR	295.534,86	0,03
BNP Paribas S.A.	5.366.191	EUR	4.320,86	0,00
Credit Agricole S.A.	21.016.226	EUR	-667.069,85	-0,06
			<b>-367.214,13</b>	<b>-0,03</b>
<b>Niederlande</b>				
ING Groep NV	775.661	EUR	58.272,66	0,01
			<b>58.272,66</b>	<b>0,01</b>
<b>Schweiz</b>				
Roche Holding AG	-6.991.344	CHF	-194.443,42	-0,02
UBS Group AG	1.729.423	CHF	283.931,68	0,03
Zurich Insurance Group AG	-4.969.782	CHF	357,40	0,00
			<b>89.845,66</b>	<b>0,01</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
American International Group, Inc.	-1.448.323	USD	24.319,89	0,00
Apple, Inc.	-14.584.156	USD	-219.289,99	-0,02
Bank of America Corp.	-5.282.503	USD	-9.019,59	0,00
Broadcom, Inc.	-1.383.063	USD	28.458,66	0,00
Citigroup, Inc.	-10.258.636	USD	46.794,55	0,00
CVS Health Corp.	-6.052.251	USD	-242.994,65	-0,02
General Electric Co.	-5.151.152	USD	51.985,48	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	-24.688.796	USD	-773.198,23	-0,07
JPMorgan Chase & Co.	1.244.871	USD	-8.118,58	0,00
MetLife, Inc.	2.660.167	USD	8.916,76	0,00
T-Mobile US, Inc.	-21.456.713	USD	-483.988,69	-0,05
U.S. Bancorp	-5.118.128	USD	-3.519,77	0,00
UnitedHealth Group, Inc.	-6.615.766	USD	-100.459,79	-0,01
			<b>-1.680.113,95</b>	<b>-0,16</b>
<b>Summe Differenzkontrakte</b>			<b>-2.012.350,49</b>	<b>-0,19</b>
<b>Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder, Optionen, Volatility Swaps und Differenzkontrakte (Anschaffungskosten EUR 790.004.276,80)</b>			<b>723.878.654,25</b>	<b>68,48</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>333.585.115,08</b>	<b>31,56</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>			<b>49.426.958,95</b>	<b>4,67</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>			<b>-49.775.139,14</b>	<b>-4,71</b>
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen</b>			<b>1.057.115.589,14</b>	<b>100,00</b>

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

## ASSENAGON ALPHA VOLATILITY ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS PER 31. DEZEMBER 2022 IN EUR

<b>Aktiva</b>	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	374.418.395,68
Unrealisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	651.265,03
Tagesgelder (Erl. 2)	340.000.000,00
Optionen (Erl. 2)	57.249.451,47
Bankguthaben (Erl. 2) *	333.585.115,08
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	46.769.289,01
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	244.236,65
Zinsforderungen	1.745.479,78
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.154.663.232,70</b>
<b>Passiva</b>	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	43.568.370,30
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	576.049,02
Unrealisierte Verluste aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	1.586.923,63
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	45.776.842,41
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	2.012.350,49
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	668.354,20
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	216.054,99
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	36.144,52
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	56.859,95
Zinsverbindlichkeiten	104.541,66
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	1.979.083,12
Gebühren für Differenzkontrakte	939.877,99
Sonstige Verbindlichkeiten	26.191,28
<b>Summe Passiva</b>	<b>97.547.643,56</b>
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen</b>	<b>1.057.115.589,14</b>

Anteilklassen	I	I2 CHF	I2 SPEZ	I GBP	P	R
Umlaufende Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres	723.855,27	170.948,28	97.510,00	23.706,30	201.657,51	2.920.700,06
Zeichnungen	261.391,96	40.641,72	6.900,00	7.548,24	148.937,00	1.591.341,91
Rücknahmen	239.599,12	171.056,00	33.400,00	3.916,12	97.170,00	2.809.619,17
<b>Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>745.648,11</b>	<b>40.534,00</b>	<b>71.010,00</b>	<b>27.338,42</b>	<b>253.424,51</b>	<b>1.702.422,80</b>

\* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.  
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.

**ASSENAGON ALPHA VOLATILITY**  
**AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS**  
**FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR VOM 1. JANUAR 2022 BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022 IN EUR**

<b>Nettoteilfondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>1.172.697.765,00</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	1.571.534,50
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	949.125,00
Dividendenerträge	21.205,66
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.819.748,34
Sonstige Erträge	26,65
<b>Summe Erträge</b>	<b>5.361.640,15</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Abschreibung des Agios	3.463.505,71
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	665.626,92
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	104.541,66
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	131.974,90
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	7.567.933,49
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	1.331.965,84
Performance Fee (Erl. 3)	1.979.083,12
Prüfungskosten	56.859,95
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	125.935,88
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	4.119.445,64
Transaktionskosten (Erl. 10)	577.135,07
Sonstige Zinsaufwendungen*	1.502.685,76
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	1.301.356,13
<b>Summe Aufwendungen</b>	<b>22.928.050,07</b>
<b>Nettogewinn/(-verlust)</b>	<b>-17.566.409,92</b>
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	2.519.936.698,05
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-2.472.087.848,97
<b>Realisierter Nettogewinn</b>	<b>30.282.439,16</b>
<b>Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses</b>	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-73.968.838,49
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	128.510.766,33
<b>Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva</b>	<b>84.824.367,00</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>	
Ausgabe von Anteilen	438.381.803,48
Rücknahme von Anteilen	-638.788.346,34
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>1.057.115.589,14</b>

\* Die Position beinhaltet Zinsen aus Overnight Deposits.  
 Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Statistische Angaben

### Teilfondsangaben in EUR

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
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Volatility per 31.12.2020	744.448.860,17

### Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

Anteilklasse	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2020
I	1.096,96	1.035,41	1.157,02
I2 CHF*	1.038,88	945,23	–
I2 SPEZ	951,80	891,32	988,09
I GBP	1.140,13	1.117,83	1.152,28
P	50,24	47,79	53,80
R	50,26	47,45	53,04

### Umlaufende Anteile zum Stichtag

Anteilklasse	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2020
I	745.648,11	723.855,27	544.637,21
I2 CHF*	40.534,00	170.948,28	–
I2 SPEZ	71.010,00	97.510,00	46.610,00
I GBP	27.338,42	23.706,30	8.077,28
P	253.424,51	201.657,51	147.019,51
R	1.702.422,80	2.920.700,06	961.869,00

\*Die Anteilklasse I2 CHF wurde am 13. August 2021 neu aufgelegt.

## Finanzaufstellung

### ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022

ISIN	Festverzinsliche Wertpapiere	Nennbetrag	Währung	Marktwert (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind.					
<b>Deutschland</b>					
DE0001141794	Bundesobligation 0 %, 05.04.2024	10.000.000	EUR	9.700.250,00	13,34
DE0001102366	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1 %, 15.08.2024	4.900.000	EUR	4.783.277,10	6,58
DE0001102333	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 %, 15.02.2024	5.200.000	EUR	5.159.285,04	7,09
DE0001102325	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2 %, 15.08.2023	5.200.000	EUR	5.201.757,60	7,15
DE0001104834	Bundesschatzanweisungen 0 %, 10.03.2023	7.500.000	EUR	7.481.505,00	10,29
DE0001104867	Bundesschatzanweisungen 0 %, 15.12.2023	5.400.000	EUR	5.285.433,60	7,27
DE0001104842	Bundesschatzanweisungen 0 %, 16.06.2023	5.400.000	EUR	5.356.281,60	7,36
DE0001104883	Bundesschatzanweisungen 0,2 %, 14.06.2024	2.500.000	EUR	2.416.722,50	3,32
				<b>45.384.512,44</b>	<b>62,40</b>
<b>Summe Festverzinsliche Wertpapiere</b>				<b>45.384.512,44</b>	<b>62,40</b>

**Summe der Wertpapiere, die an einer amtlichen Wertpapierbörse zugelassen sind. 45.384.512,44 62,40**

#### Tagesgelder

Kontrahent	Zinssatz	Währung	Nominale (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
<b>Deutschland</b>				
	Bayerische Landesbank 1,40 %, Tagesgeld	EUR	4.000.000,00	5,50
	DekaBank 1,82 %, Tagesgeld	EUR	5.000.000,00	6,88
	DZ Bank AG 1,85 %, Tagesgeld	EUR	5.000.000,00	6,87
	Landesbank Baden Württemberg 1,70 %, Tagesgeld	EUR	5.000.000,00	6,87
			<b>19.000.000,00</b>	<b>26,12</b>
<b>Summe Tagesgelder</b>			<b>19.000.000,00</b>	<b>26,12</b>

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ABB Ltd. 27,89 %	15.12.2023	630.000	CHF	-16.860,46	-0,02
Abbott Laboratories 26,64 %	19.01.2024	130.000	USD	701,58	0,00
Abbott Laboratories 29,48 %	20.01.2023	120.000	USD	-3.073,58	0,00
Abbott Laboratories 28,86 %	19.01.2024	110.000	USD	-1.739,37	0,00
Abbott Laboratories 28,66 %	16.06.2023	110.000	USD	-1.218,89	0,00
Abbott Laboratories 27,40 %	19.01.2024	130.000	USD	-177,21	0,00
AbbVie, Inc. 31,37 %	19.01.2024	440.000	USD	-17.262,80	-0,02
AbbVie, Inc. 27,67 %	16.06.2023	150.000	USD	-2.487,93	0,00
AbbVie, Inc. 28,29 %	19.01.2024	200.000	USD	-2.991,49	0,00
AbbVie, Inc. 30,69 %	19.01.2024	170.000	USD	-6.336,77	-0,01
AbbVie, Inc. 28,59 %	19.01.2024	200.000	USD	-3.524,45	-0,01
AbbVie, Inc. 31,10 %	20.01.2023	150.000	USD	-10.864,10	-0,02

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



## ASSENAGON ALPHA PREMIUM

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Accenture PLC 32,80 %	19.01.2024	130.000	USD	345,39	0,00
Accenture PLC 34,32 %	19.01.2024	110.000	USD	-1.409,15	0,00
Accenture PLC 32,38 %	20.01.2023	110.000	USD	1.490,69	0,00
Accenture PLC 32,14 %	16.06.2023	110.000	USD	2.549,73	0,00
Accenture PLC 31,99 %	19.01.2024	130.000	USD	1.282,48	0,00
Adobe, Inc. 29,68 %	20.01.2023	270.000	USD	39.721,16	0,05
Adobe, Inc. 43,01 %	20.01.2023	110.000	USD	2.389,43	0,00
Adobe, Inc. 41,01 %	16.06.2023	110.000	USD	4.986,05	0,01
Adobe, Inc. 34,67 %	20.01.2023	340.000	USD	33.033,87	0,05
Adobe, Inc. 43,91 %	16.06.2023	300.000	USD	-10.379,26	-0,01
Adobe, Inc. 42,10 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.858,79	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 55,46 %	16.06.2023	260.000	USD	7.760,71	0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 52,00 %	16.06.2023	80.000	USD	5.121,63	0,01
Advanced Micro Devices, Inc. 51,60 %	20.01.2023	220.000	USD	19.218,14	0,03
Advanced Micro Devices, Inc. 57,62 %	20.01.2023	80.000	USD	1.601,26	0,00
Advanced Micro Devices, Inc. 31,33 %	20.01.2023	180.000	USD	49.894,72	0,07
Airbus SE 39,31 %	17.03.2023	1.280.000	EUR	-145.154,64	-0,20
Allianz SE 28,22 %	17.03.2023	1.700.000	EUR	-128.698,86	-0,18
Alphabet, Inc. 30,45 %	20.01.2023	710.000	USD	54.699,98	0,07
Alphabet, Inc. 30,70 %	20.01.2023	680.000	USD	50.289,48	0,07
Alphabet, Inc. 35,58 %	16.06.2023	390.000	USD	14.903,49	0,02
Alphabet, Inc. 35,92 %	16.06.2023	360.000	USD	12.896,31	0,02
Alphabet, Inc. 36,65 %	19.01.2024	370.000	USD	335,95	0,00
Alphabet, Inc. 36,74 %	19.01.2024	370.000	USD	39,68	0,00
Alphabet, Inc. 30,26 %	20.01.2023	560.000	USD	44.472,65	0,06
Alphabet, Inc. 38,31 %	16.06.2023	790.000	USD	8.984,94	0,01
Alphabet, Inc. 36,82 %	19.01.2024	410.000	USD	285,63	0,00
Alphabet, Inc. 38,73 %	19.01.2024	1.000.000	USD	-5.463,59	-0,01
Alphabet, Inc. 37,98 %	19.01.2024	360.000	USD	-4.179,82	-0,01
Alphabet, Inc. 30,31 %	20.01.2023	530.000	USD	41.389,56	0,06
Alphabet, Inc. 38,90 %	20.01.2023	400.000	USD	3.883,10	0,01
Alphabet, Inc. 36,49 %	19.01.2024	410.000	USD	1.488,70	0,00
Alphabet, Inc. 38,61 %	19.01.2024	330.000	USD	-6.079,89	-0,01
Alphabet, Inc. 37,58 %	19.01.2024	1.070.000	USD	5.260,61	0,01
Alphabet, Inc. 38,10 %	16.06.2023	830.000	USD	11.831,08	0,02
Alphabet, Inc. 38,94 %	20.01.2023	370.000	USD	4.052,83	0,01
Amazon.com, Inc. 43,73 %	16.06.2023	1.610.000	USD	61.168,20	0,08
Amazon.com, Inc. 39,85 %	16.06.2023	680.000	USD	51.770,77	0,07
Amazon.com, Inc. 40,06 %	20.01.2023	710.000	USD	74.855,61	0,10
Amazon.com, Inc. 32,38 %	20.01.2023	1.320.000	USD	219.079,22	0,30
Amazon.com, Inc. 43,89 %	19.01.2024	580.000	USD	-5.479,19	-0,01
Amazon.com, Inc. 32,44 %	20.01.2023	1.030.000	USD	168.251,39	0,23
Amazon.com, Inc. 44,19 %	19.01.2024	530.000	USD	-8.176,48	-0,01
Amazon.com, Inc. 43,60 %	19.01.2024	580.000	USD	-3.982,31	-0,01
Amazon.com, Inc. 43,00 %	19.01.2024	1.920.000	USD	26.406,84	0,04
Amgen, Inc. 28,39 %	19.01.2024	90.000	USD	-2.256,20	0,00
Amgen, Inc. 29,70 %	16.06.2023	260.000	USD	-9.775,29	-0,01
Amgen, Inc. 38,80 %	20.01.2023	130.000	USD	-20.696,05	-0,03
Amgen, Inc. 29,58 %	20.01.2023	170.000	USD	-12.276,50	-0,02
Analog Devices, Inc. 36,08 %	20.01.2023	120.000	USD	698,03	0,00
Analog Devices, Inc. 34,17 %	20.01.2023	90.000	USD	1.989,91	0,00
Apple, Inc. 35,52 %	19.01.2024	1.570.000	USD	11.898,65	0,02
Apple, Inc. 37,56 %	20.01.2023	1.400.000	USD	7.872,18	0,01
Apple, Inc. 35,64 %	19.01.2024	1.570.000	USD	10.223,19	0,01
Apple, Inc. 33,27 %	16.06.2023	1.410.000	USD	81.515,75	0,11
Apple, Inc. 31,94 %	20.01.2023	1.770.000	USD	64.581,12	0,09
Apple, Inc. 36,91 %	16.06.2023	3.120.000	USD	66.940,49	0,09
Apple, Inc. 35,62 %	19.01.2024	1.380.000	USD	7.605,44	0,01
Apple, Inc. 33,78 %	20.01.2023	2.290.000	USD	45.239,46	0,06
Apple, Inc. 36,75 %	19.01.2024	4.070.000	USD	26.745,73	0,04

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Applied Materials, Inc. 41,40 %	20.01.2023	140.000	USD	11.993,26	0,02
Applied Materials, Inc. 42,08 %	20.01.2023	180.000	USD	14.565,88	0,02
ASML Holding NV 40,62 %	20.01.2023	70.000	USD	6.850,39	0,01
Autodesk, Inc. 43,96 %	20.01.2023	60.000	USD	1.681,61	0,00
Automatic Data Processing, Inc. 36,35 %	20.01.2023	100.000	USD	-7.505,44	-0,01
Automatic Data Processing, Inc. 29,65 %	20.01.2023	130.000	USD	-1.448,98	0,00
Bank of America Corp. 32,59 %	19.01.2024	190.000	USD	889,79	0,00
Bank of America Corp. 37,13 %	19.01.2024	420.000	USD	-13.668,47	-0,02
Bank of America Corp. 39,44 %	20.01.2023	150.000	USD	-10.550,21	-0,01
Bank of America Corp. 33,12 %	16.06.2023	140.000	USD	-341,17	0,00
Bank of America Corp. 34,38 %	19.01.2024	160.000	USD	-2.166,68	0,00
Bank of America Corp. 32,74 %	19.01.2024	190.000	USD	636,57	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 23,34 %	19.01.2024	400.000	USD	1.957,47	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 26,91 %	19.01.2024	870.000	USD	-18.019,77	-0,03
Berkshire Hathaway, Inc. 25,20 %	16.06.2023	300.000	USD	-1.763,28	0,00
Berkshire Hathaway, Inc. 25,94 %	19.01.2024	340.000	USD	-6.621,92	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 26,07 %	20.01.2023	340.000	USD	-7.220,88	-0,01
Berkshire Hathaway, Inc. 24,85 %	19.01.2024	400.000	USD	-3.411,62	0,00
Booking Holdings, Inc. 27,56 %	20.01.2023	100.000	USD	13.845,07	0,02
Booking Holdings, Inc. 38,68 %	20.01.2023	130.000	USD	4.717,60	0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 26,63 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.310,04	0,00
Bristol-Myers Squibb Co. 27,29 %	20.01.2023	90.000	USD	-5.255,51	-0,01
Bristol-Myers Squibb Co. 24,37 %	16.06.2023	90.000	USD	-1.452,74	0,00
Broadcom, Inc. 39,63 %	20.01.2023	140.000	USD	-3.403,26	0,00
Broadcom, Inc. 36,67 %	19.01.2024	150.000	USD	-2.271,41	0,00
Broadcom, Inc. 34,65 %	20.01.2023	360.000	USD	7.716,51	0,01
Broadcom, Inc. 38,25 %	19.01.2024	130.000	USD	-4.065,63	-0,01
Broadcom, Inc. 38,02 %	20.01.2023	270.000	USD	-2.591,53	0,00
Broadcom, Inc. 39,53 %	16.06.2023	430.000	USD	-12.365,66	-0,02
Broadcom, Inc. 37,14 %	19.01.2024	150.000	USD	-2.898,79	0,00
Broadcom, Inc. 35,5 %	16.06.2023	120.000	USD	1.091,34	0,00
Charter Communications Operating LLC 30,50 %	20.01.2023	150.000	USD	15.878,78	0,02
Charter Communications Operating LLC 28,97 %	20.01.2023	120.000	USD	14.261,82	0,02
Chevron Corp. 34,98 %	19.01.2024	200.000	USD	-3.848,82	-0,01
Chevron Corp. 35,26 %	16.06.2023	180.000	USD	-3.609,66	-0,01
Chevron Corp. 35,15 %	19.01.2024	230.000	USD	-4.601,80	-0,01
Chevron Corp. 34,54 %	19.01.2024	230.000	USD	-3.353,83	0,00
Chevron Corp. 38,21 %	19.01.2024	550.000	USD	-23.820,53	-0,03
Chevron Corp. 36,17 %	20.01.2023	170.000	USD	-3.684,01	-0,01
Cie Financiere Richemont S.A. 36,95 %	15.12.2023	800.000	CHF	2.861,74	0,00
Cie Financiere Richemont S.A. 38,72 %	15.12.2023	870.000	CHF	-11.882,68	-0,02
Cisco Systems, Inc. 33,44 %	20.01.2023	270.000	USD	-9.709,67	-0,01
Cisco Systems, Inc. 30,23 %	20.01.2023	330.000	USD	-1.930,05	0,00
Cisco Systems, Inc. 29,56 %	19.01.2024	140.000	USD	-1.134,77	0,00
Cisco Systems, Inc. 32,52 %	20.01.2023	120.000	USD	-1.129,42	0,00
Cisco Systems, Inc. 31,53 %	19.01.2024	110.000	USD	-2.905,97	0,00
Cisco Systems, Inc. 29,70 %	16.06.2023	110.000	USD	-1.108,98	0,00
Cisco Systems, Inc. 32,15 %	16.06.2023	380.000	USD	-13.539,79	-0,02
Cisco Systems, Inc. 29,24 %	19.01.2024	140.000	USD	-743,42	0,00
Coca-Cola Co./The 20,74 %	19.01.2024	170.000	USD	-341,43	0,00
Coca-Cola Co./The 23,59 %	19.01.2024	140.000	USD	-4.000,76	-0,01
Coca-Cola Co./The 20,52 %	19.01.2024	170.000	USD	-8,82	0,00
Coca-Cola Co./The 24,91 %	20.01.2023	140.000	USD	-5.983,29	-0,01
Coca-Cola Co./The 22,69 %	16.06.2023	140.000	USD	-3.909,87	-0,01
Comcast Corp. 39,59 %	20.01.2023	230.000	USD	-19.758,40	-0,03
Comcast Corp. 38,26 %	16.06.2023	330.000	USD	-11.435,04	-0,02
Comcast Corp. 35,27 %	16.06.2023	90.000	USD	-139,95	0,00
Comcast Corp. 32,15 %	20.01.2023	300.000	USD	-4.454,09	-0,01
Comcast Corp. 34,20 %	20.01.2023	110.000	USD	-866,79	0,00
Comcast Corp. 37,57 %	19.01.2024	90.000	USD	-2.577,78	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
ConocoPhillips 46,25 %	19.01.2024	100.000	USD	-4.636,32	-0,01
ConocoPhillips 45,53 %	16.06.2023	80.000	USD	-2.558,55	0,00
Costco Wholesale Corp. 32,92 %	16.06.2023	470.000	USD	-11.718,13	-0,02
Costco Wholesale Corp. 31,03 %	19.01.2024	140.000	USD	-1.833,22	0,00
Costco Wholesale Corp. 30,32 %	16.06.2023	140.000	USD	280,41	0,00
Costco Wholesale Corp. 28,47 %	20.01.2023	250.000	USD	7.203,53	0,01
Costco Wholesale Corp. 28,79 %	20.01.2023	320.000	USD	8.498,73	0,01
Costco Wholesale Corp. 31,56 %	20.01.2023	140.000	USD	3.087,29	0,00
Costco Wholesale Corp. 29,49 %	19.01.2024	170.000	USD	482,22	0,00
Costco Wholesale Corp. 29,99 %	19.01.2024	170.000	USD	-272,75	0,00
CSX Corp. 32,39 %	20.01.2023	80.000	USD	-3.018,67	0,00
Danaher Corp. 32,63 %	16.06.2023	110.000	USD	1.806,56	0,00
Danaher Corp. 33,27 %	19.01.2024	120.000	USD	-712,34	0,00
Danaher Corp. 34,61 %	19.01.2024	110.000	USD	-2.177,93	0,00
Danaher Corp. 36,22 %	20.01.2023	90.000	USD	-1.563,34	0,00
Danaher Corp. 32,54 %	19.01.2024	120.000	USD	66,50	0,00
DAX Index 26,27 %	17.03.2023	10.000.000	EUR	697.708,20	0,96
Deutsche Telekom AG 25,01 %	17.03.2023	1.560.000	EUR	-81.612,63	-0,11
Eli Lilly and Co. 36,28 %	19.01.2024	170.000	USD	-6.619,59	-0,01
Eli Lilly and Co. 37,77 %	20.01.2023	120.000	USD	-10.800,33	-0,02
Eli Lilly and Co. 35,77 %	16.06.2023	150.000	USD	-6.648,77	-0,01
Eli Lilly and Co. 33,56 %	19.01.2024	200.000	USD	-2.383,15	0,00
Eli Lilly and Co. 35,24 %	19.01.2024	200.000	USD	-5.373,36	-0,01
Eli Lilly and Co. 36,53 %	19.01.2024	420.000	USD	-16.332,11	-0,02
Exxon Mobil Corp. 34,80 %	19.01.2024	330.000	USD	-3.927,01	-0,01
Exxon Mobil Corp. 35,54 %	19.01.2024	330.000	USD	-6.099,67	-0,01
Exxon Mobil Corp. 39,54 %	19.01.2024	690.000	USD	-34.977,69	-0,05
Exxon Mobil Corp. 36,09 %	20.01.2023	200.000	USD	-1.315,64	0,00
Exxon Mobil Corp. 37,45 %	16.06.2023	240.000	USD	-8.104,13	-0,01
Exxon Mobil Corp. 36,10 %	19.01.2024	290.000	USD	-6.969,78	-0,01
Facebook, Inc. 52,18 %	20.01.2023	240.000	USD	28.098,28	0,04
Facebook, Inc. 36,34 %	20.01.2023	930.000	USD	264.783,68	0,36
Facebook, Inc. 36,90 %	20.01.2023	740.000	USD	205.195,71	0,28
Fiserv, Inc. 33,33 %	20.01.2023	70.000	USD	-1.962,69	0,00
Gilead Sciences, Inc. 28,23 %	20.01.2023	90.000	USD	-2.769,56	0,00
Givaudan S.A. 28,98 %	15.12.2023	340.000	CHF	116,87	0,00
Holcim Ltd. 27,75 %	15.12.2023	360.000	CHF	-6.224,58	-0,01
Home Depot, Inc./The 30,92 %	19.01.2024	240.000	USD	790,75	0,00
Home Depot, Inc./The 29,14 %	16.06.2023	180.000	USD	5.929,04	0,01
Home Depot, Inc./The 33,26 %	19.01.2024	490.000	USD	-5.849,03	-0,01
Home Depot, Inc./The 32,75 %	19.01.2024	200.000	USD	-2.722,74	0,00
Home Depot, Inc./The 33,02 %	20.01.2023	180.000	USD	-3.593,89	-0,01
Home Depot, Inc./The 30,89 %	19.01.2024	240.000	USD	854,81	0,00
Honeywell International, Inc. 27,35 %	20.01.2023	140.000	USD	-3.108,12	0,00
Honeywell International, Inc. 31,25 %	16.06.2023	260.000	USD	-11.711,32	-0,02
Honeywell International, Inc. 26,62 %	20.01.2023	190.000	USD	-2.738,12	0,00
Honeywell International, Inc. 28,69 %	19.01.2024	90.000	USD	-1.346,23	0,00
Illumina, Inc. 39,29 %	20.01.2023	60.000	USD	9.023,77	0,01
Intel Corp. 34,90 %	20.01.2023	210.000	USD	6.966,47	0,01
Intel Corp. 40,77 %	20.01.2023	110.000	USD	-913,86	0,00
Intel Corp. 36,86 %	20.01.2023	280.000	USD	4.675,61	0,01
Intuit, Inc. 38,61 %	20.01.2023	230.000	USD	19.656,83	0,03
Intuit, Inc. 35,80 %	20.01.2023	180.000	USD	20.027,63	0,03
Intuitive Surgical, Inc. 40,68 %	20.01.2023	160.000	USD	4.888,70	0,01
Intuitive Surgical, Inc. 27,66 %	20.01.2023	130.000	USD	19.757,40	0,03
Johnson & Johnson 22,18 %	19.01.2024	280.000	USD	-6.696,58	-0,01
Johnson & Johnson 21,44 %	16.06.2023	250.000	USD	-6.474,70	-0,01
Johnson & Johnson 20,58 %	19.01.2024	330.000	USD	-2.686,73	0,00
Johnson & Johnson 24,58 %	20.01.2023	270.000	USD	-20.156,55	-0,03
Johnson & Johnson 24,93 %	19.01.2024	750.000	USD	-37.403,80	-0,05

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Johnson & Johnson 19,89 %	19.01.2024	330.000	USD	-666,53	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,45 %	19.01.2024	600.000	USD	-19.429,66	-0,03
JPMorgan Chase & Co. 31,56 %	19.01.2024	240.000	USD	-3.729,21	-0,01
JPMorgan Chase & Co. 29,84 %	19.01.2024	280.000	USD	323,17	0,00
JPMorgan Chase & Co. 29,73 %	19.01.2024	280.000	USD	593,41	0,00
JPMorgan Chase & Co. 30,66 %	16.06.2023	200.000	USD	-725,94	0,00
JPMorgan Chase & Co. 34,36 %	20.01.2023	210.000	USD	-10.200,19	-0,01
KLA Corp. 49,65 %	20.01.2023	70.000	USD	-752,28	0,00
Lam Research Corp. 61,41 %	20.01.2023	100.000	USD	-6.881,18	-0,01
Lam Research Corp. 39,81 %	20.01.2023	130.000	USD	17.523,55	0,02
Linde PLC 31,42 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.700,46	0,00
Linde PLC 28,39 %	19.01.2024	120.000	USD	129,77	0,00
Linde PLC 33,31 %	16.06.2023	80.000	USD	-3.498,65	-0,01
Linde PLC 37,14 %	20.01.2023	90.000	USD	-8.123,59	-0,01
Linde PLC 30,75 %	19.01.2024	120.000	USD	-2.385,82	0,00
Lonza Group AG 33,98 %	15.12.2023	490.000	CHF	1.452,07	0,00
Lowe's Cos., Inc. 36,87 %	19.01.2024	80.000	USD	-1.760,17	0,00
Lowe's Cos., Inc. 34,83 %	16.06.2023	80.000	USD	1.158,63	0,00
McDonald's Corp. 25,97 %	20.01.2023	100.000	USD	-5.741,80	-0,01
McDonald's Corp. 23,98 %	16.06.2023	110.000	USD	-1.851,00	0,00
McDonald's Corp. 21,99 %	19.01.2024	140.000	USD	1.196,37	0,00
McDonald's Corp. 23,96 %	19.01.2024	120.000	USD	-1.274,48	0,00
McDonald's Corp. 23,14 %	19.01.2024	140.000	USD	-219,72	0,00
Medtronic, Inc. 30,55 %	20.01.2023	80.000	USD	-3.005,69	0,00
MercadoLibre, Inc. 34,56 %	20.01.2023	70.000	USD	27.358,54	0,04
Merck & Co., Inc. 26,87 %	19.01.2024	160.000	USD	-3.443,67	0,00
Merck & Co., Inc. 27,07 %	16.06.2023	130.000	USD	-4.000,98	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,19 %	19.01.2024	190.000	USD	-1.106,35	0,00
Merck & Co., Inc. 26,95 %	20.01.2023	120.000	USD	-6.784,87	-0,01
Merck & Co., Inc. 25,14 %	19.01.2024	190.000	USD	-1.022,31	0,00
Meta Platforms, Inc. 48,81 %	16.06.2023	230.000	USD	33.229,58	0,05
Meta Platforms, Inc. 52,84 %	19.01.2024	180.000	USD	3.049,66	0,00
Meta Platforms, Inc. 50,95 %	19.01.2024	600.000	USD	45.469,34	0,06
Meta Platforms, Inc. 53,13 %	19.01.2024	180.000	USD	2.585,11	0,00
Meta Platforms, Inc. 52,02 %	16.06.2023	640.000	USD	72.186,16	0,10
Meta Platforms, Inc. 53,37 %	19.01.2024	160.000	USD	1.302,13	0,00
Micron Technology, Inc. 44,51 %	20.01.2023	110.000	USD	2.892,49	0,00
Micron Technology, Inc. 47,31 %	20.01.2023	140.000	USD	291,85	0,00
Microsoft Corp. 32,79 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-5.822,08	-0,01
Microsoft Corp. 34,87 %	16.06.2023	2.340.000	USD	33.708,87	0,05
Microsoft Corp. 31,77 %	20.01.2023	1.540.000	USD	49.874,66	0,07
Microsoft Corp. 32,94 %	19.01.2024	1.300.000	USD	-7.544,11	-0,01
Microsoft Corp. 31,35 %	16.06.2023	1.150.000	USD	56.525,44	0,08
Microsoft Corp. 37,92 %	20.01.2023	1.150.000	USD	-20.460,30	-0,03
Microsoft Corp. 34,71 %	19.01.2024	1.110.000	USD	-25.840,66	-0,04
Microsoft Corp. 34,46 %	19.01.2024	3.190.000	USD	-8.193,43	-0,01
Microsoft Corp. 31,58 %	20.01.2023	1.920.000	USD	64.606,35	0,09
Moderna, Inc. 39,14 %	20.01.2023	100.000	USD	29.652,88	0,04
Moderna, Inc. 62,89 %	20.01.2023	120.000	USD	8.921,43	0,01
Mondelez International, Inc. 24,72 %	20.01.2023	90.000	USD	-3.359,08	0,00
Mondelez International, Inc. 23,99 %	20.01.2023	120.000	USD	-3.593,33	-0,01
NASDAQ 100 Index 26,70 %	20.01.2023	20.000.000	USD	-1.046.185,06	-1,44
NASDAQ 100 Index 31,15 %	16.06.2023	20.000.000	USD	162.994,05	0,22
NASDAQ 100 Index 25,40 %	20.01.2023	17.500.000	USD	-1.126.283,44	-1,55
Nestle S.A. 19,53 %	15.12.2023	2.540.000	CHF	-31.928,12	-0,04
Nestle S.A. 19,79 %	15.12.2023	2.640.000	CHF	-39.570,06	-0,05
Netflix, Inc. 40,70 %	20.01.2023	340.000	USD	109.716,44	0,15
Netflix, Inc. 55,61 %	19.01.2024	80.000	USD	-198,79	0,00
Netflix, Inc. 34,48 %	20.01.2023	270.000	USD	102.122,56	0,14
NextEra Energy, Inc. 29,15 %	16.06.2023	100.000	USD	1.655,11	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
NextEra Energy, Inc. 32,08 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.161,94	0,00
NextEra Energy, Inc. 32,04 %	20.01.2023	80.000	USD	-1.970,79	0,00
NIKE, Inc. 37,93 %	20.01.2023	90.000	USD	5.385,62	0,01
NIKE, Inc. 38,03 %	16.06.2023	80.000	USD	4.122,55	0,01
Novartis AG 20,47 %	15.12.2023	2.600.000	CHF	-19.089,32	-0,03
Novartis AG 19,95 %	15.12.2023	2.490.000	CHF	-7.892,09	-0,01
NVIDIA Corp. 58,56 %	20.01.2023	270.000	USD	9.552,42	0,01
NVIDIA Corp. 49,54 %	20.01.2023	630.000	USD	78.948,66	0,11
NVIDIA Corp. 53,58 %	19.01.2024	290.000	USD	9.341,38	0,01
NVIDIA Corp. 56,47 %	19.01.2024	560.000	USD	6.002,29	0,01
NVIDIA Corp. 52,84 %	19.01.2024	290.000	USD	11.251,22	0,02
NVIDIA Corp. 57,29 %	16.06.2023	590.000	USD	13.708,72	0,02
NVIDIA Corp. 53,11 %	16.06.2023	210.000	USD	13.739,48	0,02
NVIDIA Corp. 56,80 %	19.01.2024	240.000	USD	331,09	0,00
NVIDIA Corp. 51,14 %	20.01.2023	800.000	USD	88.315,14	0,12
NXP Semiconductors NV 38,74 %	20.01.2023	60.000	USD	3.933,23	0,01
PayPal Holdings, Inc. 30,33 %	20.01.2023	230.000	USD	62.735,74	0,09
PayPal Holdings, Inc. 39,61 %	20.01.2023	290.000	USD	54.542,17	0,07
PepsiCo, Inc. 23,44 %	20.01.2023	310.000	USD	-11.111,16	-0,02
PepsiCo, Inc. 21,47 %	19.01.2024	180.000	USD	-812,54	0,00
PepsiCo, Inc. 24,00 %	20.01.2023	240.000	USD	-10.102,14	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,99 %	16.06.2023	140.000	USD	-1.365,61	0,00
PepsiCo, Inc. 23,47 %	19.01.2024	150.000	USD	-3.472,37	-0,01
PepsiCo, Inc. 24,43 %	16.06.2023	490.000	USD	-17.501,63	-0,02
PepsiCo, Inc. 24,08 %	20.01.2023	130.000	USD	-4.377,10	-0,01
PepsiCo, Inc. 21,04 %	19.01.2024	180.000	USD	-131,36	0,00
Pfizer, Inc. 27,84 %	19.01.2024	190.000	USD	1.637,20	0,00
Pfizer, Inc. 29,25 %	19.01.2024	170.000	USD	-968,87	0,00
Pfizer, Inc. 32,74 %	19.01.2024	450.000	USD	-17.020,73	-0,02
Pfizer, Inc. 28,47 %	19.01.2024	190.000	USD	583,65	0,00
Pfizer, Inc. 33,77 %	20.01.2023	150.000	USD	-11.303,72	-0,02
Pfizer, Inc. 30,27 %	16.06.2023	160.000	USD	-4.536,43	-0,01
Philip Morris International, Inc. 28,38 %	16.06.2023	90.000	USD	-3.063,51	0,00
Philip Morris International, Inc. 30,86 %	20.01.2023	90.000	USD	-5.974,90	-0,01
Philip Morris International, Inc. 28,66 %	19.01.2024	90.000	USD	-2.647,23	0,00
Procter & Gamble Co./The 22,04 %	19.01.2024	250.000	USD	525,19	0,00
Procter & Gamble Co./The 26,69 %	19.01.2024	570.000	USD	-22.757,31	-0,03
Procter & Gamble Co./The 24,74 %	20.01.2023	220.000	USD	-4.822,87	-0,01
Procter & Gamble Co./The 24,20 %	16.06.2023	200.000	USD	-5.572,37	-0,01
Procter & Gamble Co./The 24,53 %	19.01.2024	210.000	USD	-4.389,69	-0,01
Procter & Gamble Co./The 22,54 %	19.01.2024	250.000	USD	-563,76	0,00
QUALCOMM, Inc. 38,94 %	20.01.2023	270.000	USD	20.065,24	0,03
QUALCOMM, Inc. 38,86 %	20.01.2023	210.000	USD	15.247,72	0,02
QUALCOMM, Inc. 41,86 %	16.06.2023	90.000	USD	3.395,22	0,00
QUALCOMM, Inc. 46,64 %	20.01.2023	80.000	USD	-931,43	0,00
QUALCOMM, Inc. 42,98 %	19.01.2024	80.000	USD	-229,64	0,00
QUALCOMM, Inc. 45,12 %	16.06.2023	300.000	USD	1.985,00	0,00
Raytheon Technologies Corp. 30,46 %	19.01.2024	90.000	USD	-2.374,14	0,00
Raytheon Technologies Corp. 31,60 %	20.01.2023	80.000	USD	-3.689,47	-0,01
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 37,84 %	20.01.2023	70.000	USD	-3.261,47	0,00
Roche Holding AG 21,11 %	15.12.2023	2.380.000	CHF	-58.650,52	-0,08
Roche Holding AG 21,38 %	15.12.2023	2.450.000	CHF	-65.152,21	-0,09
S&P 500 Index 25,88 %	19.01.2024	30.000.000	USD	558.129,58	0,77
S&P 500 Index 23,50 %	19.01.2024	15.000.000	USD	142.016,17	0,19
S&P 500 Index 23,55 %	16.06.2023	15.000.000	USD	-67.586,50	-0,09
S&P 500 Index 23,40 %	19.01.2024	15.000.000	USD	129.857,49	0,18
S&P 500 Index 26,30 %	20.01.2023	15.000.000	USD	165.525,79	0,23
S&P 500 Index 24,70 %	19.01.2024	15.000.000	USD	301.377,80	0,41
salesforce.com, Inc. 43,81 %	20.01.2023	90.000	USD	3.178,91	0,00
salesforce.com, Inc. 45,76 %	19.01.2024	90.000	USD	-1.985,77	0,00

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
salesforce.com, Inc. 41,00 %	16.06.2023	90.000	USD	3.953,05	0,01
SAP SE 31,51 %	17.03.2023	2.070.000	EUR	-78.807,43	-0,11
Siemens AG 38,71 %	17.03.2023	1.800.000	EUR	-155.308,50	-0,21
Starbucks Corp. 30,37 %	20.01.2023	140.000	USD	6.524,28	0,01
Starbucks Corp. 30,78 %	20.01.2023	170.000	USD	7.243,36	0,01
Swiss Market Index 19,03 %	15.12.2023	15.000.000	CHF	196.727,29	0,27
Swiss Market Index 18,86 %	15.12.2023	12.500.000	CHF	135.936,37	0,19
Tesla, Inc. 69,13 %	20.01.2023	470.000	USD	-3.213,73	0,00
Tesla, Inc. 65,13 %	20.01.2023	900.000	USD	23.451,71	0,03
Tesla, Inc. 60,09 %	16.06.2023	440.000	USD	64.209,32	0,09
Tesla, Inc. 66,19 %	19.01.2024	340.000	USD	29.455,86	0,04
Tesla, Inc. 64,91 %	19.01.2024	1.330.000	USD	111.749,41	0,15
Tesla, Inc. 65,18 %	20.01.2023	650.000	USD	16.546,11	0,02
Tesla, Inc. 67,14 %	19.01.2024	340.000	USD	26.581,28	0,04
Tesla, Inc. 63,36 %	16.06.2023	1.200.000	USD	147.025,84	0,20
Tesla, Inc. 64,89 %	19.01.2024	310.000	USD	30.090,22	0,04
Texas Instruments, Inc. 31,94 %	20.01.2023	230.000	USD	407,85	0,00
Texas Instruments, Inc. 32,21 %	16.06.2023	90.000	USD	1.013,05	0,00
Texas Instruments, Inc. 37,26 %	20.01.2023	90.000	USD	-4.320,86	-0,01
Texas Instruments, Inc. 51,78 %	20.01.2023	180.000	USD	-33.251,21	-0,05
Texas Instruments, Inc. 35,11 %	19.01.2024	100.000	USD	-2.526,47	0,00
Texas Instruments, Inc. 35,22 %	16.06.2023	320.000	USD	-5.800,65	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 30,82 %	19.01.2024	150.000	USD	374,68	0,00
Thermo Fisher Scientific, Inc. 31,19 %	19.01.2024	150.000	USD	-118,46	0,00
Thermo Fisher Scientific, Inc. 35,31 %	19.01.2024	130.000	USD	-5.084,56	-0,01
Thermo Fisher Scientific, Inc. 34,96 %	20.01.2023	120.000	USD	-2.603,16	0,00
Thermo Fisher Scientific, Inc. 31,68 %	16.06.2023	130.000	USD	-584,83	0,00
T-Mobile US, Inc. 32,21 %	16.06.2023	370.000	USD	-10.649,14	-0,01
T-Mobile US, Inc. 35,60 %	20.01.2023	180.000	USD	-10.389,01	-0,01
T-Mobile US, Inc. 33,30 %	20.01.2023	150.000	USD	-5.637,15	-0,01
UBS Group AG 32,44 %	15.12.2023	770.000	CHF	-494,47	0,00
UBS Group AG 32,44 %	15.12.2023	740.000	CHF	-1.625,91	0,00
Union Pacific Corp. 28,40 %	16.06.2023	80.000	USD	1.000,44	0,00
Union Pacific Corp. 33,05 %	20.01.2023	80.000	USD	-4.947,93	-0,01
United Parcel Service, Inc. 30,96 %	16.06.2023	90.000	USD	1.973,24	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 32,10 %	19.01.2024	850.000	USD	-34.832,92	-0,05
UnitedHealth Group, Inc. 29,33 %	16.06.2023	290.000	USD	-8.033,48	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 31,28 %	20.01.2023	270.000	USD	-16.898,26	-0,02
UnitedHealth Group, Inc. 29,74 %	19.01.2024	290.000	USD	-4.430,49	-0,01
UnitedHealth Group, Inc. 27,39 %	19.01.2024	350.000	USD	1.770,52	0,00
UnitedHealth Group, Inc. 27,80 %	19.01.2024	350.000	USD	497,26	0,00
Verizon Communications, Inc. 25,25 %	16.06.2023	100.000	USD	716,22	0,00
Verizon Communications, Inc. 28,67 %	19.01.2024	100.000	USD	-1.262,09	0,00
Verizon Communications, Inc. 24,50 %	20.01.2023	120.000	USD	-1.011,08	0,00
Walmart, Inc. 24,71 %	19.01.2024	150.000	USD	-415,03	0,00
Walmart, Inc. 24,24 %	19.01.2024	150.000	USD	210,39	0,00
Walmart, Inc. 25,80 %	20.01.2023	120.000	USD	3.923,36	0,01
Walmart, Inc. 26,15 %	16.06.2023	110.000	USD	-2.013,39	0,00
Walmart, Inc. 26,18 %	19.01.2024	130.000	USD	-2.272,25	0,00
Walt Disney Co./The 37,19 %	19.01.2024	130.000	USD	1.618,23	0,00
Walt Disney Co./The 38,85 %	20.01.2023	120.000	USD	507,38	0,00
Walt Disney Co./The 37,05 %	19.01.2024	130.000	USD	1.780,13	0,00
Walt Disney Co./The 38,72 %	19.01.2024	110.000	USD	171,16	0,00
Walt Disney Co./The 34,42 %	16.06.2023	120.000	USD	9.485,64	0,01
Wells Fargo & Co. 39,27 %	20.01.2023	100.000	USD	-6.675,75	-0,01
Wells Fargo & Co. 34,40 %	16.06.2023	100.000	USD	-1.760,88	0,00
Wells Fargo & Co. 32,96 %	19.01.2024	130.000	USD	1.398,26	0,00
Wells Fargo & Co. 35,38 %	19.01.2024	110.000	USD	-1.487,51	0,00
Wells Fargo & Co. 33,39 %	19.01.2024	130.000	USD	900,78	0,00
Zurich Insurance Group AG 23,20 %	15.12.2023	890.000	CHF	-17.965,58	-0,02

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM

### WERTPAPIERBESTAND UND SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE PER 31. DEZEMBER 2022 (FORTSETZUNG)

Volatility Swaps	Fälligkeit	Nennbetrag	Währung	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
Zurich Insurance Group AG 23,78 %	15.12.2023	930.000	CHF	-23.205,99	-0,03
				<b>1.881.185,55</b>	<b>2,59</b>
<b>Summe Volatility Swaps</b>				<b>1.881.185,55</b>	<b>2,59</b>
<b>Summe Festverzinsliche Wertpapiere, Tagesgelder und Volatility Swaps (Anschaffungskosten EUR 65.438.369,29)</b>				<b>66.265.697,99</b>	<b>91,11</b>
<b>Bankguthaben</b>				<b>6.517.094,50</b>	<b>8,96</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>				<b>24.001.646,81</b>	<b>33,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>				<b>-24.051.987,15</b>	<b>-33,07</b>
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen</b>				<b>72.732.452,15</b>	<b>100,00</b>

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

## ASSENAGON ALPHA PREMIUM ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS PER 31. DEZEMBER 2022 IN EUR

<b>Aktiva</b>	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	45.384.512,44
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	31.020,38
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	1.881.185,55
Tagesgelder (Erl. 2)	19.000.000,00
Bankguthaben (Erl. 2) *	6.517.094,50
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	23.778.586,10
Zinsforderungen	192.040,33
<b>Summe Aktiva</b>	<b>96.784.439,30</b>
<b>Passiva</b>	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	23.647.407,83
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	47.927,92
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	21.103,00
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	2.544,43
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	14.513,55
Zinsverbindlichkeiten	19.216,94
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	283.726,28
Sonstige Verbindlichkeiten	15.547,20
<b>Summe Passiva</b>	<b>24.051.987,15</b>
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen</b>	<b>72.732.452,15</b>

<b>Anteilklassen</b>	<b>I</b>	<b>I2R</b>	<b>IS</b>	<b>P</b>	<b>R</b>	<b>RS</b>
Umlaufende Anteile zu Beginn des Geschäftsjahres	34.271,66	1.030,00	64.400,97	2.000,00	4.000,00	128.622,00
Zeichnungen	15.710,00	0,00	8.042,96	0,00	0,00	760,00
Rücknahmen	33.896,66	0,00	28.654,96	0,00	0,00	1.201,00
<b>Umlaufende Anteile am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>16.085,00</b>	<b>1.030,00</b>	<b>43.788,97</b>	<b>2.000,00</b>	<b>4.000,00</b>	<b>128.181,00</b>

\* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.  
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.



**ASSENAGON ALPHA PREMIUM**  
**AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOTEILFONDSVERMÖGENS**  
**FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR VOM 1. JANUAR 2022 BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022 IN EUR**

<b>Nettoteilfondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>111.517.394,10</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	265.348,46
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	85.225,84
Sonstige Erträge	217,82
<b>Summe Erträge</b>	<b>350.792,12</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Abschreibung des Agios	588.009,21
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	19.216,94
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	2.074,39
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	721.235,53
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	118.078,81
Performance Fee (Erl. 3)	283.726,28
Prüfungskosten	8.000,80
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	13.301,18
Transaktionskosten (Erl. 10)	67,35
Sonstige Zinsaufwendungen *	237.024,13
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	274.329,25
<b>Summe Aufwendungen</b>	<b>2.265.063,87</b>
<b>Nettogewinn/(-verlust)</b>	<b>-1.914.271,75</b>
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	76.645.663,88
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-70.722.434,63
<b>Realisierter Nettogewinn</b>	<b>4.008.957,50</b>
<b>Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses</b>	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	3.873.626,54
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	-4.436.953,65
<b>Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva</b>	<b>3.445.630,39</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>	
Ausgabe von Anteilen	25.004.167,27
Rücknahme von Anteilen	-66.325.242,70
Ausschüttungen (Erl. 8)	-909.496,91
<b>Summe Nettoteilfondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>72.732.452,15</b>

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

## Statistische Angaben

<b>Teilfondsangaben in EUR</b>	
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2022	72.732.452,15
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2021	111.517.394,10
Nettoteilfondsvermögen Assenagon Alpha Premium per 31.12.2020	135.611.265,97

### Nettoinventarwert pro Anteil zum Stichtag

<b>Anteilklasse</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>31.12.2020</b>
I	1.098,84	1.057,33	1.015,21
I2R	1.100,17	1.057,25	1.013,07
IS	1.062,50	1.041,26	1.017,86
P	53,94	52,21	50,39
R	54,87	52,82	50,74
RS	55,17	53,01	50,84

### Umlaufende Anteile zum Stichtag

<b>Anteilklasse</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>31.12.2020</b>
I	16.085,00	34.271,66	375,00
I2R	1.030,00	1.030,00	1.030,00
IS	43.788,97	64.400,97	124.249,97
P	2.000,00	2.000,00	2.000,00
R	4.000,00	4.000,00	2.000,00
RS	128.181,00	128.622,00	147.824,00

## Konsolidierte Darstellung

### ZUSAMMENSETZUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS PER 31. DEZEMBER 2022 IN EUR

<b>Aktiva</b>	
Wertpapiere zum Marktwert (Erl. 2)	419.802.908,12
Unrealisierte Gewinne aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	31.020,38
Unrealisierte Gewinne aus Devisentermingeschäften (Erl. 5)	651.265,03
Unrealisierte Gewinne aus Volatility Swaps (Erl. 2)	1.881.185,55
Tagesgelder (Erl. 2)	359.000.000,00
Optionen (Erl. 2)	57.249.451,47
Bankguthaben (Erl. 2) *	340.102.209,58
Forderungen aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	70.547.875,11
Forderungen aus Anteilscheingeschäften	244.236,65
Zinsforderungen	1.937.520,11
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.251.447.672,00</b>
<b>Passiva</b>	
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften und Derivaten	67.215.778,13
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften	576.049,02
Unrealisierte Verluste aus Finanzterminkontrakten (Erl. 4)	1.586.923,63
Unrealisierte Verluste aus Volatility Swaps (Erl. 2)	45.776.842,41
Unrealisierte Verluste aus Differenzkontrakten	2.012.350,49
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	716.282,12
Verbindlichkeiten aus Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	237.157,99
Verbindlichkeiten aus Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	38.688,95
Verbindlichkeiten aus Prüfungskosten	71.373,50
Zinsverbindlichkeiten	123.758,60
Verbindlichkeiten aus Performance Fee (Erl. 3)	2.262.809,40
Gebühren für Differenzkontrakte	939.877,99
Sonstige Verbindlichkeiten	41.738,48
<b>Summe Passiva</b>	<b>121.599.630,71</b>
<b>Summe Nettofondsvermögen</b>	<b>1.129.848.041,29</b>

\* Die Position kann Einlagen zur Besicherung von Derivaten beinhalten.  
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.

## AUFWANDS- UND ERTRAGSRECHNUNG SOWIE ENTWICKLUNG DES NETTOFONDSVERMÖGENS FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR VOM 1. JANUAR 2022 BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022 IN EUR

<b>Nettofondsvermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>1.284.215.159,10</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen aus Wertpapieren (Erl. 2)	1.836.882,96
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	1.034.350,84
Dividendenerträge	21.205,66
Erträge aus Differenzkontrakten (Erl. 2)	2.819.748,34
Sonstige Erträge	244,47
<b>Summe Erträge</b>	<b>5.712.432,27</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Abschreibung des Agios	4.051.514,92
Zinsen aus Volatility Swaps (Erl. 2)	665.626,92
Zinsen aus Tagesgeldern (Erl. 2)	123.758,60
Zinsen für Cash Collateral (Erl. 2)	134.049,29
Verwaltungsgebühren (Erl. 3)	8.289.169,02
Verwahrstellen- und Administrationsgebühren (Erl. 3)	1.450.044,65
Performance Fee (Erl. 3)	2.262.809,40
Prüfungskosten	64.860,75
Taxe d'Abonnement (Erl. 6)	139.237,06
Aufwendungen aus Differenzkontrakten	4.119.445,64
Transaktionskosten (Erl. 10)	577.202,42
Sonstige Zinsaufwendungen*	1.739.709,89
Sonstige Aufwendungen (Erl. 3)	1.575.685,38
<b>Summe Aufwendungen</b>	<b>25.193.113,94</b>
<b>Nettogewinn/(-verlust)</b>	<b>-19.480.681,67</b>
Realisierte Nettogewinne (Erl.2)	2.596.582.361,93
Realisierte Nettoverluste (Erl.2)	-2.542.810.283,60
<b>Realisierter Nettogewinn</b>	<b>34.291.396,66</b>
<b>Veränderung des nicht realisierten Ergebnisses</b>	
Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns	-70.095.211,95
Veränderung des nicht realisierten Nettoverlustes	124.073.812,68
<b>Nettozuwachs/(-abnahme) der Nettoaktiva</b>	<b>88.269.997,39</b>
<b>Entwicklung des Kapitals</b>	
Ausgabe von Anteilen	463.385.970,75
Rücknahme von Anteilen	-705.113.589,04
Ausschüttungen (Erl. 8)	-909.496,91
<b>Summe Nettofondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>1.129.848.041,29</b>

\* Die Position beinhaltet Zinsen aus Overnight Deposits.  
Die Erläuterungen im Anhang sind integraler Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Erläuterungen zum Jahresabschluss

### 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 Volatility aus den Anteilklassen:

Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum
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

Gegenwärtig besteht der Teilfonds Assenagon Premium aus den Anteilklassen:

Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum	Anteilklasse	Auflagedatum
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 Nettfondsvermögen des Fonds besteht aus der Summe der Nettoteilfondsvermögen und wird in EUR ausgedrückt.

### 2. Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

#### Allgemeines

Die Erstellung des Jahresabschlusses 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 nachprüfaren, 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 Jahresbericht 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, 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, 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 das abgelaufene Geschäftsjahr sind Performance Fees in Höhe von EUR 1.979.083,12 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee (esma34-39-992 Nr.5) sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Jahresberichtes 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 das abgelaufene Geschäftsjahr sind Performance Fees in Höhe von EUR 283.726,28 angefallen.

Detailinformation zur Performance Fee (esma34-39-992 Nr.5) sind im Abschnitt "Sonstige Angaben" im hinteren Teil des Jahresberichtes 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 Umtäusche in einem Teilfonds beziehungsweise einer Anteilsklasse negative Auswirkungen auf den Nettoinventarwert pro Anteil haben.

Wenn Ausgaben, Rücknahmen und Umtäusche 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.

Im abgelaufenen Geschäftsjahr wurde eine Verwässerungsabgabe in Höhe von 366.446,67 EUR angewendet.

## **4. Finanzterminkontrakte**

### **Teilfonds Assenagon Alpha Volatility**

Die am 31. Dezember 2022 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

<b>Underlying</b>	<b>Währung</b>	<b>Fälligkeit</b>	<b>Kontrakte</b>	<b>Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)</b>	<b>Nettoteilfondsvermögen (%)</b>
Euro Stoxx 50® Index Future	EUR	17.03.2023	1.067	-1.114.056,43	-0,11
DAX Index Future	EUR	17.03.2023	-53	-24.433,79	0,00
EURO/GBP Future	GBP	13.03.2023	-170	-538.464,67	-0,05
EURO FX Currency Future	USD	13.03.2023	122	205.981,96	0,02
Euro Stoxx® Banks Future	EUR	17.03.2023	4.209	529.414,23	0,05
S&P 500 E-Mini Future	USD	17.03.2023	-543	-728.328,63	-0,07
Swiss Market Index Future	CHF	17.03.2023	-81	82.963,70	0,01
				<b>-1.586.923,63</b>	<b>-0,15</b>

## Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Die am 31. Dezember 2022 ausstehenden Finanzterminkontrakte werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Underlying	Währung	Fälligkeit	Kontrakte	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
EURO FX Currency Future	USD	13.03.2023	12	31.020,38	0,04
				<b>31.020,38</b>	<b>0,04</b>

## 5. Devisentermingeschäfte

### Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Die am 31. Dezember 2022 ausstehenden Devisengeschäfte des Investmentportfolios werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
15.288.680,87	EUR	15.000.000,00	CHF	17.03.2023	52.984,65	0,01
2.541.647,43	EUR	2.500.000,00	CHF	17.03.2023	2.364,73	0,00
25.472.692,12	EUR	22.000.000,00	GBP	17.03.2023	754.340,88	0,07
37.624.501,83	EUR	40.000.000,00	USD	17.03.2023	330.794,30	0,03
					<b>1.140.484,56</b>	<b>0,11</b>

Die am 31. Dezember 2022 ausstehenden Devisentermingeschäfte für währungsgesicherte Anteilklassen werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Kauf	Währung	Verkauf	Währung	Fälligkeit	Unrealisierter Gewinn/(Verlust) (EUR)	Nettoteilfondsvermögen (%)
41.300.750,00	CHF	41.875.363,74	EUR	21.02.2023	36.715,85	0,00
27.212.290,00	GBP	31.133.490,91	EUR	21.02.2023	-525.935,38	-0,05
					<b>-489.219,53</b>	<b>-0,05</b>

## 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) und ausschüttende (I, I GBP, IS, P, R und RS) Anteile ausgegeben.

Für das Geschäftsjahr 2021 erfolgte in 2022 keine Ausschüttung für den Teilfonds Assenagon Alpha Volatility.

Durch den Beschluss des Verwaltungsrates vom 31. Oktober 2022 wurden Ausschüttungen des Assenagon Alpha Premium vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021 festgelegt. Die Ausschüttungen erfolgten per Ex-Datum 17. November 2022 und Valuta 21. November 2022 wie folgt:

Anteilklasse IS: EUR 20,77 pro Anteil

## 9. Umrechnung von Fremdwährungen

Die Vermögenswerte des Fonds sind auf der Grundlage der nachstehenden Kurse per 31. Dezember 2022 umgerechnet:

Britische Pfund	0,887231	= 1 Euro
Hong Kong Dollar	8,329833	= 1 Euro
Japanische Yen	140,818304	= 1 Euro
Schweizer Franken	0,987420	= 1 Euro
US-Dollar	1,067250	= 1 Euro

## 10. Transaktionskosten

Die Transaktionskosten resultierend aus den Käufen und Verkäufen der Wertpapiere und Derivate für das am 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr werden in der nachfolgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Transaktionskosten (EUR)
Assenagon Alpha Volatility	5.476.924,80
Assenagon Alpha Premium	155,65

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 zum Geschäftsjahresende ausgewiesenen Derivate. Die gestellten Sicherheiten sind im Bankguthaben in der Bilanz enthalten.

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BNP Paribas S.A. Paris	Barmittel	18.680.000,00
Citigroup Global Markets Europe AG	Barmittel	320.000,00
Goldman Sachs Bank Europe SE	Barmittel	15.930.000,00

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

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BofA Securities Europe SA	Barmittel	6.580.000,00
Credit Suisse Bank Europe SA	Barmittel	9.050.000,00
HSBC Continental Europe	Barmittel	6.930.000,00
JP Morgan SE	Barmittel	310.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	35.440.000,00
Société Générale (Paris)	Barmittel	10.650.000,00
UBS AG	Barmittel	68.630.000,00

## Teilfonds Assenagon Alpha Premium

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

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (EUR)
BNP Paribas S.A. Paris	Barmittel	340.000,00
Morgan Stanley Europe SE	Barmittel	390.000,00
UBS AG	Barmittel	360.000,00

## 12. Ausweis der Kontrahenten

### Teilfonds Assenagon Alpha Volatility

Der Teilfonds hat im Geschäftsjahr Derivategeschäfte mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

Kontrahent
Banco Bilbao Vizcaya Madrid S.A.
Bank of America
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 International
Goldman Sachs Bank Europe SE
Goldman Sachs International
HSBC Continental Europe
JP Morgan SE
JP Morgan Asset Management (Europe)
JP Morgan Securities PLC.
Morgan Stanley Bank AG
Morgan Stanley & Co. International
Morgan Stanley Europe SE
Natixis S.A.
Optiver VOF
Société Générale (Paris)
UBS AG (London)
U.S. Bancorp.

### Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Der Teilfonds hat im Geschäftsjahr Derivategeschäfte mit den folgenden Kontrahenten getätigt:

Kontrahent
BNP Paribas S.A.
Citigroup Global Markets Limited
Credit Suisse AG (Schweiz)
Goldman Sachs Bank Europe SE
Goldman Sachs International
HSBC Continental Europe
JP Morgan Securities PLC
Morgan Stanley Europe SE
UBS AG (London)

## 13. Verpflichtungen aus Derivategeschäften zum 31. Dezember 2022

Zum 31. Dezember 2022 hatten die Teilfonds die folgenden Eventualverbindlichkeiten aus Derivategeschäften:

	Eventualverbindlichkeiten aus geschriebenen Equity Optionen (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventualverbindlichkeiten aus Equity Futures (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventualverbindlichkeiten aus anderen Equity Swaps (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventualverbindlichkeiten aus anderen Equity Derivaten (Volatility Swaps, etc.) gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventualverbindlichkeiten aus Devisen-Termingeschäften gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventualverbindlichkeiten aus FX Futures gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR
Assenagon Alpha Volatility	2.675.156.022,92	224.924.563,41	185.512.516,99	5.469.635.698,04	153.325.520,76	0,00
Assenagon Alpha Premium	0,00	1.405.481,38	0,00	329.971.338,65	0,00	0,00

## 14. Wesentliche Ereignisse im Laufe des Geschäftsjahres

Zum 18. Februar 2022 wurde Dr. Stephan Höcht als Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft berufen.

Am 30. April 2022 ist Holger Herber als Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft zurückgetreten und hat diese verlassen.

Zum 20. Dezember 2022 wurde Jens Meiser als Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft berufen.

Die für das Jahr 2022 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.

## 15. Wesentliche Ereignisse nach Bilanzstichtag 31. Dezember 2022

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](http://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 31. Dezember 2022 (inkl. Performance Fee)	Performance Fee per 31. Dezember 2022
Assenagon Alpha Volatility	I	1,07 %	0,00 %
	I2 CHF	4,23 %	3,22 %
	I2 SPEZ	0,26 %	-
	I GBP	1,07 %	0,00 %
	P	1,81 %	0,00 %
	R	1,10 %	0,00 %
Assenagon Alpha Premium	I	1,32 %	0,19%
	I2R	1,29 %	-
	IS	1,20 %	0,30 %
	P	2,02 %	0,24 %
	R	1,47 %	0,34 %
	RS	1,30 %	0,37 %

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 Swiss Fund & Asset Management Association (SFAMA) 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	79,18 % <sup>(1)</sup>
Minimum	30,85 % <sup>(1)</sup>
Durchschnitt	46,90 % <sup>(1)</sup>
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	1.304,53 % <sup>(2)</sup>

\* Das VaR Limit wird entsprechend des Risikoprofils und der Assenagon Risk Management Policy definiert.

<sup>(1)</sup> Das Risikomaß gibt an, welchen Wert der Verlust des Portfolios mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % bei einer Haltedauer von 20 Tagen nicht überschreitet.

<sup>(2)</sup> Es handelt sich um die durchschnittliche Hebelwirkung im abgelaufenen Geschäftsjahr.

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	120,08 % <sup>(1)</sup>
Minimum	33,80 % <sup>(1)</sup>
Durchschnitt	73,25 % <sup>(1)</sup>
Hebelwirkung (Leverage) – Summe der Nennwerte	
	533,36 % <sup>(2)</sup>

\* Das VaR Limit wird entsprechend des Risikoprofils und der Assenagon Risk Management Policy definiert.

<sup>(1)</sup> Das Risikomaß gibt an, welchen Wert der Verlust des Portfolios mit einer Wahrscheinlichkeit von 99 % bei einer Haltedauer von 20 Tagen nicht überschreitet.

<sup>(2)</sup> Es handelt sich um die durchschnittliche Hebelwirkung im abgelaufenen Geschäftsjahr.

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.	Angabe 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](http://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	30.806,61	0,00 %
I2 CHF	1.947.463,94	4,62 %
I2 SPEZ	0,00	0,00 %
I GBP	639,47	0,00 %
P	168,25	0,00 %
R	4,85	0,00 %
insgesamt	1.979.083,12	

### Teilfonds Assenagon Alpha Premium

Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee in %*
I	84.963,14	0,48 %
I2R	0,00	0,00 %
IS	172.777,01	0,37 %
P	247,24	0,23 %
R	711,23	0,32 %
RS	25.027,66	0,35 %
insgesamt	283.726,28	

\* Die relative Performance Fee ergibt sich als Summe aus

a) der Summe der täglichen Kristallisierungen aus Anteilscheinrückgaben relativ zum Nettovermögen der Anteilklasse des Vortages und

b) 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 Gesamtrendite-Swaps im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022. 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](http://www.assenagon.com)

© 2023