

Basisinformationsblatt

Zweck

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Produkt

Assenagon Alpha Premium (P2)

ISIN: LU2053561937, WKN: A2PR2C

Anteilsklasse (P2) des Assenagon Alpha Premium (der "Fonds"), Teilfonds des Umbrella-Fonds Assenagon Alpha.

Der als OGAW-Sondervermögen aufgelegte Fonds wird von **Assenagon Asset Management S.A.** (die "Verwaltungsgesellschaft") verwaltet und ist der Luxemburger Aufsichtsbehörde Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) unterstellt. Weitere Informationen sind unter www.assenagon.com oder telefonisch unter +49 89 519966-0 verfügbar. Dieses Dokument wurde am 08.07.2024 erstellt.

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art: Es handelt sich um ein in Luxemburg aufgelegtes OGAW-Sondervermögen.

Laufzeit: Der Fonds hat eine unbegrenzte Laufzeit. Anteile an dem Fonds können grundsätzlich bewertungstätig zurückgegeben werden. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Rücknahme von Anteilen aussetzen, wenn außergewöhnliche Umstände dies unter Berücksichtigung der Anlegerinteressen erforderlich machen.

Ziele: Der Fonds verfolgt das Ziel, durch die Vereinnahmung von Risikoprämien am Volatilitätsmarkt mittelfristig einen Wertzuwachs zu erwirtschaften. Zwischenzeitliche Wertschwankungen werden dabei toleriert. Der Fonds wird aktiv verwaltet, ohne dass die Investitionen auf ein bestimmtes Benchmarkuniversum beschränkt sind. Alle Erträge verbleiben im Fonds und erhöhen den Wert der Anteile. Um das Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds auf eine Kombination aus größtenteils mittels Derivaten umgesetzten Volatiliäts-Strategien und einem Basisportfolio. Die Volatiliäts-Strategien nutzen strukturelle oder temporäre Ineffizienzen an den globalen Derivatemärkten. Dazu gehört, dass die für einen Zeitraum erwartete Volatilität oft höher ist als die sich im Zeitverlauf realisierende Volatilität. Mögliche Kurs- und Währungsrisiken können durch Terminkontrakte abgesichert werden. Das Basisportfolio des Fonds zielt darauf ab, Wertbeiträge in Höhe des kurzfristigen Rentenmarkts zu erzielen. Je nach Marktphasen und identifizierten Chancen für die Investment-Strategien können, zwischen 0 % und 100% in das Basisportfolio investiert werden. Zur Umsetzung der Anlagestrategie nutzt der Fonds vor allem Derivate. Eingesetzt werden vor allem Swaps, Optionen, Forwards und Futures, auf Einzeltitel, Körbe von Einzeltiteln, Indizes und abgeleitete Größen wie Zinssätze, Volatilität oder Varianz. Derivate können sowohl zu Anlage- als auch zu Absicherungszwecken eingesetzt werden. Als Anlageinstrumente können vom Portfolio Management außerdem Aktien, Zertifikate, Termingelder und Sichteinlagen, Schuldverschreibungen, Währungsgeschäfte, Anteile anderer OGA sowie OGAW, und Anleihen von Industrieunternehmen, Staaten und sonstigen Schuldnern eingesetzt werden. Schuldverschreibungen haben ein Mindestrating von BBB- nach Standard & Poor's und Fitch oder Baa3 nach Moody's. Wenn die Währung einer Anteilklasse nicht der Referenzwährung des Fonds entspricht, nutzt der Fonds Devisenderivate, um die Währungsrisiken zwischen Anteilklassenwährung und Referenzwährung des Fonds zu kompensieren. Im Rahmen der Anlagepolitik kann das Portfolio Management weitere zulässige Anlageinstrumente verwenden. Die Währung des Fonds ist EUR. Die Verwahrstelle des Fonds ist Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. Den Prospekt und die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte, die aktuellen Anteilepreise sowie weitere Informationen zu dem Fonds finden Sie kostenlos in deutscher Sprache unter www.assenagon.com/fonds/Assenagon-Alpha-Premium_P2.

Anleger-Zielgruppe: Der Fonds richtet sich primär an alle Arten von Anlegern mit durchschnittlichen Kenntnissen und Erfahrungen in den zugrundeliegenden Anlageklassen des Fonds, die das Ziel der Vermögensbildung verfolgen.

Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

Risikoindikator



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 2 Jahre halten.

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubehalten.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei 3 einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass unsere Fähigkeit beeinträchtigt wird, Ihr Rückgabeverlangen auszuführen.

Bitte beachten Sie die Risiken aus dem Derivateinsatz: Eine Anlage kann Chancen und Verlustrisiko des Fonds erhöhen und eine Absicherung durch Derivate kann zu verringerten Gewinnchancen führen.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

Basisinformationsblatt

Performance-Szenarien

Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Das dargestellte pessimistische, mittlere und optimistische Szenario veranschaulichen die schlechteste, durchschnittliche und beste Wertentwicklung des Produkts und einer geeigneten Benchmark in den letzten 10 Jahren. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln.

| Empfohlene Haltedauer: | 2 Jahre | | |
|---------------------------------|---|---------------------------------|-----------------------------------|
| Anlagebeispiel: | 10 000 EUR | | |
| Szenarien | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 2 Jahren aussteigen |
| Minimum | Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren. | | |
| Stressszenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 5 640 EUR | 6 420 EUR |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -43,6 % | -19,9 % |
| Pessimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 8 450 EUR | 8 680 EUR |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -15,5 % | -6,8 % |
| Mittleres Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 9 870 EUR | 10 230 EUR |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -1,3 % | 1,2 % |
| Optimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 10 950 EUR | 11 130 EUR |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 9,5 % | 5,5 % |

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen, sowie die Kosten Ihres Beraters oder Ihrer Vertriebsstelle. Unberücksichtigt ist auch Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann. Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten. Das pessimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen April 2018 und März 2020. Das mittlere Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen Mai 2015 und April 2017. Das optimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen Juli 2020 und Juni 2022. Zur Bestimmung dieser Szenarien wurde die Preishistorie des Fonds um eine geeignete Benchmark Entwicklung erweitert.

Was geschieht, wenn Assenagon Asset Management S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Der Ausfall der Verwaltungsgesellschaft hat keine direkten Auswirkungen auf Ihre Auszahlung, da die gesetzliche Regelung vorsieht, dass bei einer Insolvenz der Verwaltungsgesellschaft das Sondervermögen nicht in die Insolvenzmasse eingeht, sondern eigenständig erhalten bleibt.

Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen, wie lange Sie das Produkt halten und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume.

Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0 % Jahresrendite). Für die andere Halteperiode haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt
- 10 000 EUR werden angelegt

| | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 2 Jahren aussteigen |
|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| Kosten insgesamt | 623 EUR | 853 EUR |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten (*) | 6,2 % | 4,4 % pro Jahr |

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 5,6 % vor Kosten und 1,2 % nach Kosten betragen. Wir können einen Teil der Kosten zwischen uns und der Person aufteilen, die Ihnen das Produkt verkauft, um die für Sie erbrachten Dienstleistungen zu decken. Diese Zahlen enthalten die höchste Vertriebsgebühr, die die Person, die Ihnen das Produkt verkauft, berechnen kann (4,00 % des Anlagebetrags /400 EUR). Diese Person teilt Ihnen die tatsächliche Vertriebsgebühr mit.

Basisinformationsblatt

Zusammensetzung der Kosten

| Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen |
|--|---|---------------------------------|
| Einstiegskosten | 4,00 % des Betrags, den sie beim Einstieg in dieses Anlage zahlen. | 400 EUR |
| Ausstiegskosten | Für dieses Produkt werden keine Ausstiegskosten berechnet. | 0 EUR |
| Laufende Kosten (pro Jahr) | | |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 1,72 % des Wertes ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf der Grundlage der tatsächlichen Kosten aus dem Zeitraum 01.04.2023 - 31.03.2024. | 165 EUR |
| Transaktionskosten | 0,51 % des Wertes ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen oder verkaufen. | 49 EUR |
| Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen | | |
| Erfolgsgebühren | 15 % der Wertentwicklung, die über den 1-Monats-Euribor +2,0 % p. a. hinausgeht. Eine Performance Fee kann auch dann ausbezahlt werden, wenn sich der Fonds besser als 1-Monats-Euribor +2,0 % p. a. entwickelt hat, aber dennoch eine negative Wertentwicklung aufweist. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie gut sich ihre Anlage entwickelt. Die vorstehende Schätzung enthält den Durchschnitt der letzten fünf Jahre. | 9 EUR |

Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Haltedauer: 2 Jahre

Dieses Produkt ist geeignet für langfristige Investitionen. Für Rückgaben entstehen keine Kosten oder Gebühren.

Wie kann ich mich beschweren?

Bei Beschwerden können Sie sich an Assenagon Asset Management S.A., Aerogolf Center, 1B Heienhaff, 1736 Senningerberg, Luxembourg oder sales@assenagon.com wenden. Beschwerden über die Person, die zu dem Produkt berät oder es verkauft, können direkt an diese Person gerichtet werden. Weitere Kontaktinformationen finden Sie unter www.assenagon.com/kontakt.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Informationen zur vergangenen Wertentwicklung für 2020 bis 2023 finden Sie unter www.assenagon.com/fonds/Assenagon-Alpha-Premium_P2. Eine monatlich aktualisierte Veröffentlichung der Berechnungen früherer Performance-Szenarien können Sie dort ebenfalls abrufen.

Der Verwaltungsrat bildet den Vergütungsausschuss der Assenagon Asset Management S.A. Dieses Gremium entscheidet über die Leitsätze des Vergütungssystems sowie deren Umsetzung. Die Leitsätze des Vergütungssystems werden mindestens einmal jährlich einer Überprüfung unterzogen. Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik, darunter eine Beschreibung, wie die Vergütung und die sonstigen Zuwendungen berechnet werden, sind über die Website www.assenagon.com/anlegerinformationen zugänglich.

Die Steuervorschriften des Staates Luxemburg können Ihre persönliche Steuerlage beeinflussen.