Mitteilung an die Anteilsinhaber

Assenagon Alpha *fonds commun de placement*

Verwaltungsgesellschaft

Assenagon Asset Management S.A.
Aerogolf Center, 1B Heienhaff
1736 Senningerberg
Luxemburg
Handelsregister: B 129 914

Die Anteilinhaber des Teilfonds **Assenagon Alpha Volatility** (*fonds commun de placement*) werden hiermit von folgenden Änderungen in Kenntnis gesetzt:

- I. Die Berechnungsmethode des Hurdle-Index bei der Performance Fee wird neu gefasst:

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 Anteilscheinklasse zum jeweiligen Geschäftsjahresende nach Anpassung um Ausschüttungen angepasst.

- II. Erweiterung des Feiertagskalenders um London und New York:

Anteilswertberechnung An jedem Bankarbeitstag in Frankfurt am Main, Luxemburg, London und New York mit Ausnahme des 24. und 31. Dezember eines jeden Jahres.

Die Anteilinhaber des Teilfonds **Assenagon Alpha Premium** (*fonds commun de placement*) werden hiermit von folgenden Änderungen in Kenntnis gesetzt:

- I. Änderung der LIBOR Zinssätze für CHF, GBP, JPY, USD für Performance Fee Berechnung auf Ersatzzinssätze SARON, SONIA, TONA, SOFR:

Der Hurdle-Index liegt bei Auflegung einer Anteilsklasse auf dem Erstausgabepreis der jeweiligen Anteilsklasse 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).

Die Anteilinhaber des Teilfonds **Assenagon Alpha Volatility** und des Teilfonds **Assenagon Alpha Premium** werden hiermit von folgenden Änderungen in Kenntnis gesetzt:

- I. Änderung des länderspezifischen Anhangs für Deutschland, um Assenagon Asset Management S.A., Luxemburg, als Kontaktstelle einzufügen.
- II. Änderung des länderspezifischen Anhangs für Österreich, um Assenagon Asset Management S.A., Luxemburg, als Kontaktstelle, Assenagon Asset Management S.A., Zweigniederlassung München als Informationsstelle und Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. als Zahlstelle einzufügen.

Die Anteilsinhaber sind berechtigt, ihre Fondsanteile innerhalb eines Monats ab Bekanntgabe dieser Änderungen, die am 29. November 2021 in Kraft treten werden, an die Verwaltungsgesellschaft kostenfrei zurückzugeben.

Der gemäß dieser Änderung angepasste Verkaufsprospekt sowie das Verwaltungs- und das Sonderreglement sind kostenfrei bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Luxemburg, den 28. Oktober 2021

Assenagon Asset Management S.A.