

Halbjahres- bericht

Assenagon I

Ungeprüfter Halbjahresbericht zum 31. März 2024

– Anlagefonds nach Luxemburger Recht –

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

R.C.S.-Nr. K80

Der vorliegende Bericht für den Umbrella-Fonds

"Assenagon I"

umfasst folgende Teilfonds:

- Assenagon I - Multi Asset Conservative
- Assenagon I - Multi Asset Balanced

Inhalt

Informationen an die Anleger	2
Verwaltung, Vertrieb und Beratung.....	3
Assenagon I – Multi Asset Conservative	5
Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens	5
Währungsübersicht des Teilfonds.....	5
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	5
Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	6
Vermögensaufstellung des Teilfonds.....	6
Devisenkurse (in Mengennotiz)	9
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	10
Vermögensentwicklung des Teilfonds	11
Entwicklung im Jahresvergleich	11
Assenagon I – Multi Asset Balanced	13
Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens	13
Währungsübersicht des Teilfonds.....	13
Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds	13
Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds	14
Vermögensaufstellung des Teilfonds.....	14
Devisenkurse (in Mengennotiz)	17
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds	18
Vermögensentwicklung des Teilfonds	19
Entwicklung im Jahresvergleich	19
Zusammenfassung des Assenagon I	20
Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens	20
Vermögensentwicklung des Netto-Fondsvermögens	20
Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds	21
Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht	22
Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz	29

Informationen an die Anleger

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

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

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

Die Berichte sowie der jeweils gültige Verkaufsprospekt/Emissionsdokument (nebst Anhängen) und wesentlichen Anlegerinformationen bzw. Basisinformationsblätter sind bei der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft und den Zahl- und Informationsstellen kostenlos erhältlich.

Die Assenagon Asset Management S.A. bestätigt, sich während des Berichtszeitraums in ihrer Tätigkeit für den Fonds in allen wesentlichen Belangen an die von der ALFI im "ALFI Code of Conduct for Luxembourg Investment Funds" von 2009 (in der letzten Fassung vom Juni 2022) festgelegten Grundsätze gehalten zu haben.

Zusätzliche Informationen für die Schweiz

Der Prospekt, das Basisinformationsblatt, das Fondsreglement, die jährlichen und halbjährlichen Berichte auf Deutsch, sowie weitere Informationen sind kostenlos beim Vertreter und der Zahlstelle in der Schweiz erhältlich: REYL & CIE SA, 4, rue du Rhône, 1204 Genf, Schweiz, Tel.: + 41 22 816 80 00, Fax: + 41 22 816 80 01, Web: www.reyl.com. Die aktuellen Anteilspreise können unter www.fundinfo.com abgerufen werden.

Verwaltung, Vertrieb und Beratung

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

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

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

Dr. Stephan Höcht
Matthias Kunze
Jens Meiser
Dr. Dr. Heimo Plössnig
Thomas Romig
Philip Seegerer

Zentralverwaltungsstelle

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

Verwahrstelle

European Depositary Bank SA
9a, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg
www.europeandepositorybank.com

Register- und Transferstelle

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

Aufsichtsbehörde im Großherzogtum Luxemburg

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

Kontaktstelle für die Bundesrepublik Deutschland und die Republik Österreich

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

Vertriebs- und Informationsstelle für die Bundesrepublik Deutschland und Informationsstelle für die Republik Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Landsberger Straße 346
80687 München
Deutschland
www.assenagon.com

Steuerlicher Vertreter in der Republik Österreich

PricewaterhouseCoopers Österreich GmbH
Erdbergstraße 200
1030 Wien
Österreich
www.pwc.com/at

Zahlstelle in der Schweiz

Bis zum 31. Dezember 2023:
BANQUE CANTONALE DE GENÈVE
17, quai de l'Île
1204 Genf
Schweiz
www.bcge.ch

Seit dem 1. Januar 2024:

REYL & CIE SA
4, rue du Rhône
1204 Genf
Schweiz
www.reyl.com

Vertreter in der Schweiz

Bis zum 31. Dezember 2023:
CARNEGIE FUND SERVICES S.A.
11, rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz
www.carnegie-fund-services.ch

Seit dem 1. Januar 2024:

REYL & CIE SA
4, rue du Rhône
1204 Genf
Schweiz
www.reyl.com

Abschlussprüfer

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

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens

Assenagon I – Multi Asset Conservative per 31. März 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	436.329.730,96
(Wertpapiereinstandskosten EUR 393.763.971,11)	
Derivate	-126.878,00
Bankguthaben	29.548.599,45
Sonstige Vermögensgegenstände	264,65
Summe Aktiva	465.751.717,06
Bankverbindlichkeiten	-553.944,99
Zinsverbindlichkeiten	-1.937,40
Sonstige Verbindlichkeiten	-3.608.609,96
Summe Passiva	-4.164.492,35
Netto-Teilfondsvermögen	461.587.224,71

Währungsübersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Währung	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	433,03	93,80
USD	19,13	4,15
GBP	2,85	0,62
CAD	2,03	0,44
CHF	1,32	0,29
NOK	1,15	0,25
HKD	1,07	0,23
SEK	0,97	0,21
JPY	0,04	0,01
Summe	461,59	100,00

Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Wertpapier-Investmentanteile	410,82	89,00
Indexzertifikate	24,10	5,22
Aktien	1,41	0,31
Summe	436,33	94,53

Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

Länder	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Irland	223,05	48,32
Luxemburg	189,42	41,04
Bundesrepublik Deutschland	14,00	3,03
Liechtenstein	6,73	1,46
Kanada	1,72	0,37
Jersey	1,41	0,31
Summe	436,33	94,53

Vermögensaufstellung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Amtlich gehandelte Wertpapiere/Regulierter Markt						
Indezertifikate						
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Gold	IE00B579F325	STK	119.000,00 EUR	198,4500	23.615.550,00	5,12
iShares Physical Metals PLC OPEN END ZT 11(11/O.End) Platin	IE00B4LHWP62	STK	40.000,00 USD	13,0738	484.212,96	0,10
Organisierter Markt						
Aktien						
Yellow Cake PLC Registered Shares LS-,01	JE00BF50RG45	STK	200.000,00 GBP	6,0200	1.408.269,49	0,31
Wertpapier-Investmentanteile						
Sprott Physical Uranium Trust Registered Units o.N.	CA85210A1049	ANT	90.000,00 CAD	27,9000	1.718.097,84	0,37
A.I.I.S.-All.Europ.Micro Cap Inhaber-Ant. IT (EUR)Acc. o.N.	LU0594339896	ANT	125,00 EUR	3.804,8100	475.601,25	0,10
Assenagon Alpha Volatility Namens-Anteile I o.N.	LU0575255335	ANT	1.850,00 EUR	1.053,6400	1.949.234,00	0,42
Berenberg European Micro Cap Namens-Anteile M o.N.	LU1637618825	ANT	2.500,00 EUR	143,5200	358.800,00	0,08
BlueBay Fds-Inv.Gr.Euro Gov.Bd Namens-Ant. C-EUR o.N.	LU0842209909	ANT	102.500,00 EUR	104,0200	10.662.050,00	2,31
BNP Paribas EO H.Yld S.Dur.Bd Act. Nom. I H EUR Cap o.N.	LU1022395633	ANT	16.000,00 EUR	126,8500	2.029.600,00	0,44
Brown Adv Btl Gdmn US Val Reg. Shs SIUH EUR Acc. oN	IE00BN940Q96	ANT	170.000,00 EUR	12,8100	2.177.700,00	0,47
Carmignac Portf.-Credit Namens-Ant. FW EUR Acc. o.N.	LU1623763148	ANT	105.500,00 EUR	149,0200	15.721.610,00	3,41
CO.Bu.Cr.Str.-COR.B.Eur.H.Y.Fd Reg. Shs In.Fo.Po. EUR Acc. oN	IE00BMCT1J48	ANT	90.000,00 EUR	121,7504	10.957.536,00	2,37
Comgest Growth PLC-Europe Reg. Shares I Acc. EUR o.N.	IE00B5WN3467	ANT	165.000,00 EUR	50,6300	8.353.950,00	1,81
Comgest Growth-Europe Compoun. Reg.Shs SEA EUR Acc. oN	IE0004HHNTO4	ANT	200.000,00 EUR	11,5300	2.306.000,00	0,50
Eleva Fd-ELEV Absol.ret.Dyn.Fd Act.Nom. I EUR Acc. oN	LU2719143005	ANT	3.500,00 EUR	1.059,6000	3.708.600,00	0,80
Eleva UCITS-Eleva Abs.Ret.Eur. Nam.-Ant. S EUR acc. o.N.	LU1331974276	ANT	2.250,00 EUR	1.558,5100	3.506.647,50	0,76
F.Sent.Inv.Gl.U.-FSSA Jap.Equ. Reg. Shs VI EUR Acc. oN	IE00BFY84Q86	ANT	25.000,00 EUR	22,5796	564.490,00	0,12
FAM Renten Spezial Inhaber-Anteile I	DE000A14N878	ANT	40.000,00 EUR	112,1900	4.487.600,00	0,97
Fed.He.IF-F.H.As.Ex-Jap.Equ.Fd Reg. Shs F Dist.EUR o.N.	IE00B831WC11	ANT	150.000,00 EUR	4,6882	703.230,00	0,15
Flossbach von Storch-Bd Oppor. Inhaber-Anteile IT o.N.	LU1481584016	ANT	165.000,00 EUR	120,2900	19.847.850,00	4,30
FS Colibri Event Driven Bonds Inhaber-Ant. X T EUR o.N.	DE000A3DDTK9	ANT	7.000,00 EUR	1.090,6000	7.634.200,00	1,65
Fulcrum-Eq.Dispersion Fund Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2164655040	ANT	17.000,00 EUR	124,6930	2.119.781,00	0,46
Fundsmith SICAV-Equity Fund Namens-Anteile I Dis.o.N.	LU0690374532	ANT	140.000,00 EUR	59,4508	8.323.112,00	1,80

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto-Teilfondsvermögens
Helium Fd-Helium Selection Actions-Nom. S Cap. EUR o.N.	LU1112771768	ANT	2.400,00 EUR	1.759,6110	4.223.066,40	0,91
Heptagon Fd-Kop.Gl.All-Cap Eq. Reg. Shares CE Acc. EUR o.N.	IE00BH4GY991	ANT	7.500,00 EUR	251,2933	1.884.699,75	0,41
M.U.L.-Lyxor MSCI Russi.UC.ETF Nam.-Ant Acc.EUR o.N	LU1923627092	ANT	80.000,00 EUR	0,0000	0,00	0,00
Man Fds VI-Man GLG Hig.Yi.Opp. Reg.Acc.Shs I EUR o.N.	IE00BDTYYL24	ANT	112.500,00 EUR	142,6200	16.044.750,00	3,48
Man Fds-Man GLG Dyn.Inc. Reg.Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000230XXL4	ANT	123.000,00 EUR	149,1600	18.346.680,00	3,97
Man Fds-Man GLG EUR Corp.Bd Reg.Shs IF EUR Acc. oN	IE000BJKVS14	ANT	77.000,00 EUR	112,8800	8.691.760,00	1,88
Man Funds-M.GLG Jap.CoreAl.Eq. Reg.Shs.I H EUR Dis.o.N.	IE00B578XK25	ANT	50.000,00 EUR	375,3300	18.766.500,00	4,07
Man-GLG Gl.Invest Grade Opps Reg. Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000FTP5ZV4	ANT	280.000,00 EUR	112,1700	31.407.600,00	6,80
ML-Coop.Creek Part.N.A.L.S.Eq. Reg.Shs INST PLD EUR Acc. oN	IE00BG08P667	ANT	25.000,00 EUR	172,9337	4.323.342,50	0,94
MUL Amundi S&P 500 II UCITS ETF Inh.Ant. Dist	LU0496786574	ANT	410.000,00 EUR	49,8660	20.445.060,00	4,43
Pareto-Par.Nordic Corporate Bd Nam.-Ant. H Acc.EUR o.N.	LU1311575093	ANT	147.000,00 EUR	128,0837	18.828.303,90	4,08
PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Acc.Shs Inst.EUR Hed.o.N.	IE00B80G9288	ANT	2.100.000,00 EUR	14,6100	30.681.000,00	6,65
Plenum CAT Bd Dyn.Fd Inh.-Ant. P EUR Acc. oN	LI1115713706	ANT	60.000,00 EUR	112,2000	6.732.000,00	1,46
RDW Fds-RDW Next Gen.E.M.Eq.Fd Act. Nom. B EUR Acc. oN	LU1965309831	ANT	23.000,00 EUR	149,7607	3.444.496,10	0,75
Sissener S.Corp.Bd Fd Act. Nom. RF EUR Acc. oN	LU2262945038	ANT	700.000,00 EUR	12,1700	8.519.000,00	1,85
SPDR S+P US Comm.Ser.S.S.UETF Reg.Shs Acc.o.N.	IE00BFWFPX50	ANT	184.000,00 EUR	32,2650	5.936.760,00	1,29
SQUAD GALLO Europa Inh.-Ant. SI	DE000A2P3PK6	ANT	11.000,00 EUR	170,3000	1.873.300,00	0,41
Storm Fund II-Storm Bond Fund Inh.-Ant. ICL(EUR) o.N.	LU2058024444	ANT	54.000,00 EUR	134,0400	7.238.160,00	1,57
T. Rowe Pr-Euro Corp. Bond Act.Nom. I9 EUR Acc. oN	LU2573689044	ANT	190.000,00 EUR	10,9200	2.074.800,00	0,45
The Indep.Plat.Zennor Jap.Fd Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2394143205	ANT	30.000,00 EUR	131,5940	3.947.820,00	0,86
TRIGON - New Europe Fund Inh.-Ant. C EUR o.N.	LU1687402807	ANT	20.000,00 EUR	102,3900	2.047.800,00	0,44
Twelve Cat Bond Fund Reg. Shs SI1 EUR Acc. oN	IE00BKF1PS04	ANT	100.000,00 EUR	123,8500	12.385.000,00	2,68
W.M.Fds(I.)-W.Euro Hi.Yi.Bd Fd Reg.Shs E EUR Acc. oN	IE000EESGXZ0	ANT	100.000,00 EUR	11,4780	1.147.800,00	0,25
WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity Fd Reg.Shs. Cl. S EUR Acc. o.N.	IE00B6TYHG95	ANT	365.000,00 EUR	43,2376	15.781.724,00	3,42
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inh.-Ant. 1D o.N.	LU0274211217	ANT	45.000,00 EUR	52,7300	2.372.850,00	0,51
Xtrackers S&P 500 Swap Inh.-Ant. 1C USD o.N.	LU0490618542	ANT	469.500,00 EUR	95,7820	44.969.649,00	9,74
GIO ICAV-EM Corp.HY Debt.Fd Reg. Shs O4 USD Acc. oN	IE00BG4R4L74	ANT	43.500,00 USD	152,9780	6.161.613,89	1,33
Pzena Val-Em.Mkts Sel.Val Reg.Shs E USD Acc. oN	IE000OF7UAQ4	ANT	21.250,00 USD	118,5290	2.332.167,82	0,51
Smead Fds-Smead US Value UC.Fd Act. Nom. Y USD Acc. oN	LU2314635694	ANT	7.750,00 USD	363,4800	2.608.305,56	0,57
Summe Wertpapiervermögen			EUR		436.329.730,96	94,53
Derivate						
Aktienindex-Terminkontrakte						
Euro STOXX 50 Future 21.06.24		STK	230,00 EUR	5.045,0000	130.469,99	0,03
Nasdaq 100 E-Mini Future 21.06.24		STK	6,00 USD	18.475,0000	16.361,11	0,00
Nikkei 225 Stock Av. Index Future USD CME 13.06.24		STK	12,00 USD	40.400,0000	23.611,11	0,01
S&P 500 E-Mini Index Future 21.06.24		STK	82,00 USD	5.308,5000	252.777,78	0,05
STXE 600 Future 21.06.24		STK	415,00 EUR	510,8000	130.725,00	0,03
Optionsrechte auf Aktienindices						
Call FTSE 100 7800 17.05.24		STK	100,00 GBP	210,0000	245.628,40	0,05
Devisenterminkontrakte						
Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)						
EUR/USD Future 17.06.24		USD	710,00 EUR	1,0822	-926.451,39	-0,20
Summe Derivate			EUR		-126.878,00	-0,03

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand		Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Bankguthaben							
Bankkonten							
Bankkonto European Depositary Bank SA		CAD	171.537,43	EUR		117.370,80	0,03
Bankkonto European Depositary Bank SA		CHF	386.617,37	EUR		397.447,82	0,09
Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	8.841.109,13	EUR		8.841.109,13	1,92
Bankkonto European Depositary Bank SA		GBP	232.044,32	EUR		271.412,74	0,06
Bankkonto European Depositary Bank SA		HKD	5.286.200,85	EUR		625.397,17	0,14
Bankkonto European Depositary Bank SA		JPY	5.941.122,00	EUR		36.347,68	0,01
Bankkonto European Depositary Bank SA		NOK	1.000.000,00	EUR		85.349,72	0,02
Bankkonto European Depositary Bank SA		SEK	4.385.005,26	EUR		379.719,89	0,08
Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	2.469.601,35	EUR		2.286.667,92	0,50
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CAD	277.688,52	EUR		190.002,41	0,04
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CHF	895.191,53	EUR		920.268,86	0,20
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		EUR	3.679.255,30	EUR		3.679.255,30	0,80
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		GBP	792.465,94	EUR		926.914,95	0,20
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		HKD	3.769.686,53	EUR		445.982,16	0,10
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		NOK	12.496.501,77	EUR		1.066.572,93	0,23
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		SEK	6.819.428,26	EUR		590.528,95	0,13
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		USD	5.682.743,60	EUR		5.261.799,63	1,14
Forderungen aus Variation Margin		USD	1.000.567,50	EUR		926.451,39	0,20
Callgeld(er)							
Callgeld Bayerische Landesbank (München)		EUR	2.500.000,00	EUR		2.500.000,00	0,54
Summe Bankguthaben				EUR		29.548.599,45	6,40
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsforderung Bankkonto European Depositary Bank SA		JPY	124,00	EUR		0,76	0,00
Zinsforderung(en) Callgeld(er)		EUR	263,89	EUR		263,89	0,00
Summe Sonstige Vermögensgegenstände				EUR		264,65	0,00
Bankverbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-261.194,99	EUR		-261.194,99	-0,06
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-316.170,00	EUR		-292.750,00	-0,06
Summe Bankverbindlichkeiten				EUR		-553.944,99	-0,12
Zinsverbindlichkeiten							
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	-1.558,44	EUR		-1.558,44	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	-409,28	EUR		-378,96	0,00
Summe Zinsverbindlichkeiten				EUR		-1.937,40	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten¹)				EUR		-3.608.609,96	-0,78
Netto-Teilfondsvermögen				EUR		461.587.224,71	100,00*)

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

1) In den "Sonstigen Verbindlichkeiten" sind fremde Depotgebühren, Performance-Fees, Prüfungskosten, Register- und Zahlstellenvergütung, Risiko-Management-Gebühr, Taxe d'abonnement, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsvergütung enthalten.

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	EUR	1.264,04
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR	EUR	59,85
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	EUR	58,25
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR	EUR	49,10
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I2R EUR	EUR	1.094,51
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2R EUR	EUR	54,54
Anteilswert des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N2 EUR	EUR	52,26
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR	STK	175.763,98
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR	STK	3.349.302,60
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR	STK	489.552,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR	STK	209.899,02
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – I2R EUR	STK	50,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2R EUR	STK	1.000,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative – N2 EUR	STK	500,00
Bestand der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	94,53
Bestand der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	-0,03

Eventualverbindlichkeiten aus Derivaten

Eventual- verbindlichkeiten aus geschriebenen Equity Optionen (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- forderungen aus gekauften Equity Optionen (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Equity Futures (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus anderen Equity Swaps (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus anderen Equity Derivaten (Volatility Swaps, etc.) gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Devisen- Termingeschäften gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlich- keiten aus FX Futures gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Zinsderivaten (Zinsfutures, Zins- und Währungsswaps) gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR
0,00	6.533.071,04	46.559.130,87	0,00	0,00	0,00	82.175.925,93	0,00

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	28.03.2024
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,461500	= 1	EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,972750	= 1	EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,854950	= 1	EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	8,452550	= 1	EUR
Japanischer Yen	(JPY)	163,452600	= 1	EUR
Norwegische Kronen	(NOK)	11,716500	= 1	EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	11,548000	= 1	EUR
US-Dollar	(USD)	1,080000	= 1	EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative im Zeitraum vom 1. Oktober 2023 bis 31. März 2024

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	396.548,27
Zinsen aus Geldanlagen	642.704,11
Erträge aus Bestandsprovisionen	16.897,22
Ordentlicher Ertragsausgleich	20.075,92
Erträge insgesamt	1.076.225,52
Aufwendungen	
Performance-Fees	-3.005.802,24
Verwaltungsvergütung	-2.092.537,25
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-86.678,05
Verwahrstellenvergütung	-126.952,01
Taxe d'abonnement	-48.538,85
Veröffentlichungskosten	-11.327,30
Register- und Transferstellenvergütung	-39.368,42
Zinsaufwendungen	-53.061,80
Sonstige Aufwendungen	-100.667,55
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-97.657,86
Aufwendungen insgesamt	-5.662.591,33
Ordentlicher Nettoaufwand	-4.586.365,81
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	16.905.447,93
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	314.337,65
Realisierte Verluste	-3.401.327,75
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-59.801,57
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	13.758.656,26
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	9.172.290,45
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	33.031.168,90
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-339.592,78
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	32.691.576,12
Ergebnis des Berichtszeitraumes	41.863.866,57

Vermögensentwicklung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Conservative

	EUR
Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	416.507.128,86
Ausschüttungen	-5.188.417,64
Mittelzuflüsse	35.455.391,00
Mittelabflüsse	-26.873.789,94
Mittelzufluss/-abfluss netto	8.581.601,06
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-176.954,14
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	41.863.866,57
Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	461.587.224,71

Entwicklung im Jahresvergleich

Assenagon I – Multi Asset Conservative – I EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	175.763,977	EUR	222.171.977,10	1.264,04
30.09.2023	172.301,079	EUR	197.610.296,27	1.146,89
30.09.2022	150.539,645	EUR	162.666.924,69	1.080,56

Assenagon I – Multi Asset Conservative – P EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	3.349.302,600	EUR	200.455.781,22	59,85
30.09.2023	3.138.846,459	EUR	174.950.418,54	55,74
30.09.2022	2.724.957,809	EUR	148.038.423,87	54,33

Assenagon I – Multi Asset Conservative – R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	489.551,999	EUR	28.517.682,53	58,25
30.09.2023	633.684,482	EUR	34.310.872,36	54,15
30.09.2022	696.304,711	EUR	36.527.521,00	52,46

Assenagon I – Multi Asset Conservative – N EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	209.899,023	EUR	10.306.384,44	49,10
30.09.2023	208.206,747	EUR	9.536.883,97	45,80
30.09.2022	209.898,199	EUR	9.393.822,87	44,75

Assenagon I – Multi Asset Conservative – I2R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	50,000	EUR	54.725,52	1.094,51
30.09.2023	50,000	EUR	49.335,91	986,72
15.09.2023 *)	50,000	EUR	50.000,00	1.000,00

*) Datum der Erstausgabe.

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Assenagon I – Multi Asset Conservative – P2R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	1.000,000	EUR	54.542,65	54,54
30.09.2023	1.000,000	EUR	49.321,81	49,32
15.09.2023 *)	1.000,000	EUR	50.000,00	50,00

Assenagon I – Multi Asset Conservative – N2 EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	500,000	EUR	26.131,25	52,26
22.12.2023 *)	500,000	EUR	25.000,00	50,00

*) Datum der Erstausgabe.

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Zusammensetzung des Netto-Teilfondsvermögens

Assenagon I – Multi Asset Balanced per 31. März 2024

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	30.133.932,28
(Wertpapiereinstandskosten EUR 27.245.939,89)	
Derivate	99.898,63
Bankguthaben	3.348.383,14
Sonstige Vermögensgegenstände	5.482,44
Summe Aktiva	33.587.696,49
Bankverbindlichkeiten	-127.453,33
Zinsverbindlichkeiten	-225,12
Sonstige Verbindlichkeiten	-306.630,59
Summe Passiva	-434.309,04
Netto-Teilfondsvermögen	33.153.387,45

Währungsübersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Währung	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
EUR	29,69	89,54
USD	2,26	6,81
GBP	0,34	1,03
CAD	0,23	0,70
CHF	0,20	0,62
SEK	0,19	0,58
HKD	0,15	0,46
NOK	0,09	0,26
Summe	33,15	100,00

Wertpapierkategorie-Übersicht des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Wertpapierkategorie	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Wertpapier-Investmentanteile	27,81	83,90
Indezertifikate	2,14	6,46
Aktien	0,18	0,53
Summe	30,13	90,89

Länderübersicht des Wertpapiervermögens des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

Länder	Kurswert in Mio. EUR	In % des Netto- Teilfondsvermögens
Irland	16,84	50,81
Luxemburg	11,09	33,46
Bundesrepublik Deutschland	1,01	3,06
Liechtenstein	0,79	2,37
Kanada	0,22	0,66
Jersey	0,18	0,53
Summe	30,13	90,89

Vermögensaufstellung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Amtlich gehandelte Wertpapiere/Regulierter Markt						
Indexzertifikate						
Invesco Physical Markets PLC ETC 31.12.2100 Gold	IE00B579F325	STK	10.800,00 EUR	198,4500	2.143.260,00	6,46
Organisierter Markt						
Aktien						
Yellow Cake PLC Registered Shares LS-,01	JE00BF50RG45	STK	25.000,00 GBP	6,0200	176.033,69	0,53
Wertpapier-Investmentanteile						
Sprott Physical Uranium Trust Registered Units o.N.	CA85210A1049	ANT	11.500,00 CAD	27,9000	219.534,72	0,66
A.I.I.S.-All.Europ.Micro Cap Inh.-Ant. IT (EUR)Acc. o.N.	LU0594339896	ANT	10,00 EUR	3.804,8100	38.048,10	0,11
AIS-Amundi Stoxx Europe 600 Act.Nom.UCITS ETF Acc oN	LU0908500753	ANT	2.500,00 EUR	234,4500	586.125,00	1,77
Assenagon Alpha Volatility Nam.-Ant. I o.N.	LU0575255335	ANT	125,00 EUR	1.053,6400	131.705,00	0,40
Brown Adv Btl Gdmn US Val Reg. Shs SIUH EUR Acc. oN	IE00BN940Q96	ANT	14.000,00 EUR	12,8100	179.340,00	0,54
Carmignac Portf.-Credit Nam.-Ant. FW EUR Acc. o.N.	LU1623763148	ANT	4.600,00 EUR	149,0200	685.492,00	2,07
CO.Bu.Cr.Str.-COR.B.Eur.H.Y.Fd Reg. Shs In.Fo.Po. EUR Acc. oN	IE00BMCT1J48	ANT	5.450,00 EUR	121,7504	663.539,68	2,00
Comgest Growth PLC-Europe Reg. Shs I Acc. EUR o.N.	IE00B5WN3467	ANT	15.500,00 EUR	50,6300	784.765,00	2,37
Eleva Fd-ELEV Absol.ret.Dyn.Fd Act.Nom. I EUR Acc. oN	LU2719143005	ANT	300,00 EUR	1.059,6000	317.880,00	0,96
Eleva UCITS-Eleva Abs.Ret.Eur. Nam.-Ant. S EUR acc. o.N.	LU1331974276	ANT	240,00 EUR	1.558,5100	374.042,40	1,13
F.Sent.Inv.Gl.U.-FSSA Jap.Equ. Reg. Shs VI EUR Acc. oN	IE00BFY84Q86	ANT	2.000,00 EUR	22,5796	45.159,20	0,14
FAM Renten Spezial Inhaber-Anteile I	DE000A14N878	ANT	3.000,00 EUR	112,1900	336.570,00	1,02
Fed.He.IF-F.H.As.Ex-Jap.Equ.Fd Reg. Shs F Dist.EUR o.N.	IE00B831WC11	ANT	10.000,00 EUR	4,6882	46.882,00	0,14
Flossbach von Storch-Bd Oppor. Inh.-Ant. IT o.N.	LU1481584016	ANT	7.300,00 EUR	120,2900	878.117,00	2,65
FS Colibri Event Driven Bonds Inh.-Ant. X T EUR o.N.	DE000A3DDTK9	ANT	450,00 EUR	1.090,6000	490.770,00	1,48
Fulcrum-Eq.Dispersion Fund Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2164655040	ANT	1.200,00 EUR	124,6930	149.631,60	0,45
Fundsmith SICAV-Equity Fund Nam.-Ant. I Dis.o.N.	LU0690374532	ANT	15.000,00 EUR	59,4508	891.762,00	2,69
Helium Fd-Helium Selection Act. Nom. S Cap. EUR o.N.	LU1112771768	ANT	240,00 EUR	1.759,6110	422.306,64	1,27
Heptagon Fd-Kop.Gl.All-Cap Eq. Reg. Shares CE Acc. EUR o.N.	IE00BH4GY991	ANT	1.000,00 EUR	251,2933	251.293,30	0,76
M.U.L.-Lyxor MSCI Russi.UC.ETF Nam.-Ant. Acc.EUR o.N	LU1923627092	ANT	6.000,00 EUR	0,0000	0,00	0,00
Man Fds VI-Man GLG Hig.Yi.Opp. Reg. Acc.Shs I EUR o.N.	IE00BDTYYL24	ANT	7.100,00 EUR	142,6200	1.012.602,00	3,05
Man Fds-Man GLG Dyn.Inc. Reg.Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000230XXL4	ANT	14.000,00 EUR	149,1600	2.088.240,00	6,30

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Man Fds-Man GLG EUR Corp.Bd Reg.Shs IF EUR Acc. oN	IE000BJKVS14	ANT	3.750,00 EUR	112,8800	423.300,00	1,28
Man Funds-M.GLG Jap.CoreAl.Eq. Reg.Shs.I H EUR Dis.o.N.	IE00B578XK25	ANT	4.700,00 EUR	375,3300	1.764.051,00	5,32
Man-GLG Gl.Invest Grade Opps Reg. Shs IF Hgd EUR Acc. oN	IE000FTP5ZV4	ANT	14.900,00 EUR	112,1700	1.671.333,00	5,04
ML-Coop.Creek Part.N.A.L.S.Eq. Reg. Shs INST PLD EUR Acc. oN	IE00BG08P667	ANT	2.000,00 EUR	172,9337	345.867,40	1,04
MUL Amundi S&P 500 II UCITS ETF Inh.-Ant. Dist	LU0496786574	ANT	38.000,00 EUR	49,8660	1.894.908,00	5,72
Pareto-Par.Nordic Corporate Bd Nam.-Ant. H Acc.EUR o.N.	LU1311575093	ANT	7.250,00 EUR	128,0837	928.606,83	2,80
PIMCO Fds GIS - Income Fund Reg.Acc.Shs Inst.EUR Hed.o.N.	IE00B80G9288	ANT	110.000,00 EUR	14,6100	1.607.100,00	4,85
Plenum CAT Bd Dyn.Fd Inh.-Ant. P EUR Acc. oN	LI1115713706	ANT	7.000,00 EUR	112,2000	785.400,00	2,37
RDW Fds-RDW Next Gen.E.M.Eq.Fd Act. Nom. B EUR Acc. oN	LU1965309831	ANT	2.350,00 EUR	149,7607	351.937,65	1,06
Sissener S.Corp.Bd Fd Act. Nom. RF EUR Acc. oN	LU2262945038	ANT	25.500,00 EUR	12,1700	310.335,00	0,94
SPDR S+P US Comm.Ser.S.S.UETF Reg. Shs Acc.o.N.	IE00BFWFPX50	ANT	19.500,00 EUR	32,2650	629.167,50	1,90
SQUAD GALLO Europa Inh.-Ant. SI	DE000A2P3PK6	ANT	1.100,00 EUR	170,3000	187.330,00	0,57
Storm Fund II-Storm Bond Fund Inh.-Ant. ICL(EUR) o.N.	LU2058024444	ANT	2.400,00 EUR	134,0400	321.696,00	0,97
The Indep.Plat.Zennor Jap.Fd Act. Nom. I EUR Acc. oN	LU2394143205	ANT	2.300,00 EUR	131,5940	302.666,20	0,91
TRIGON - New Europe Fund Inh.-Ant. C EUR o.N.	LU1687402807	ANT	1.500,00 EUR	102,3900	153.585,00	0,46
Twelve Cat Bond Fund Reg. Shs SI1 EUR Acc. oN	IE00BKF1PS04	ANT	7.500,00 EUR	123,8500	928.875,00	2,80
WMF(I)-W.Strat.Europ.Equity Fd Reg.Shs. Cl. S EUR Acc. o.N.	IE00B6TYHG95	ANT	31.000,00 EUR	43,2376	1.340.365,60	4,04
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inh.-Ant. 1D o.N.	LU0274211217	ANT	12.300,00 EUR	52,7300	648.579,00	1,96
Xtrackers S&P 500 Swap Inh.-Ant. 1C USD o.N.	LU0490618542	ANT	15.000,00 EUR	95,7820	1.436.730,00	4,33
GIO ICAV-EM Corp.HY Debt.Fd Reg. Shs O4 USD Acc. oN	IE00BG4R4L74	ANT	4.750,00 USD	152,9780	672.819,91	2,03
Pzena Val-Em.Mkts Sel.Val Reg.Shs E USD Acc. oN	IE000OF7UAQ4	ANT	2.250,00 USD	118,5290	246.935,42	0,74
Smead Fds-Smead US Value UC.Fd Act. Nom. Y USD Acc. oN	LU2314635694	ANT	800,00 USD	363,4800	269.244,44	0,81
Summe Wertpapiervermögen			EUR		30.133.932,28	90,89
Derivate						
Aktienindex-Terminkontrakte						
Euro STOXX 50 Future 21.06.24		STK	24,00 EUR	5.045,0000	14.315,00	0,04
MSCI India Net Return Index Future 21.06.24		STK	2,00 USD	1.216,5000	3.953,71	0,01
Nasdaq 100 E-Mini Future 21.06.24		STK	1,00 USD	18.475,0000	2.726,85	0,01
Nasdaq 100 Micro E-Mini Future 21.06.24		STK	5,00 USD	18.475,0000	1.363,42	0,00
Nikkei 225 Stock Av. Index Future USD CME 13.06.24		STK	1,00 USD	40.400,0000	1.967,60	0,01
S&P 500 E-Mini Index Future 21.06.24		STK	26,00 USD	5.308,5000	88.321,76	0,27
STXE 600 Future 21.06.24		STK	47,00 EUR	510,8000	14.805,00	0,04
Optionsrechte auf Aktienindices						
Call FTSE 100 7800 17.05.24		STK	8,00 GBP	210,0000	19.650,27	0,06
Devisen-Derivate						
Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)						
EUR/USD Future 17.06.24		USD	37,00 EUR	1,0822	-47.204,98	-0,14
Summe Derivate			EUR		99.898,63	0,30

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.
Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Notierung	Bestand	Kurs zum 28.03.2024	Kurswert in EUR	In % des Netto- Teilfonds- vermögens
Bankguthaben						
Bankkonten						
Bankkonto European Depositary Bank SA		CAD	19.009,89 EUR		13.007,11	0,04
Bankkonto European Depositary Bank SA		CHF	169.519,70 EUR		174.268,52	0,53
Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	1.060.922,98 EUR		1.060.922,98	3,20
Bankkonto European Depositary Bank SA		GBP	16.379,32 EUR		19.158,22	0,06
Bankkonto European Depositary Bank SA		HKD	499.616,11 EUR		59.108,33	0,18
Bankkonto European Depositary Bank SA		NOK	100.000,00 EUR		8.534,97	0,03
Bankkonto European Depositary Bank SA		SEK	99.782,73 EUR		8.640,69	0,03
Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	179.935,05 EUR		166.606,53	0,50
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		CHF	29.052,38 EUR		29.866,23	0,09
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		EUR	375.114,33 EUR		375.114,33	1,13
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		GBP	108.391,50 EUR		126.781,10	0,38
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		HKD	792.128,10 EUR		93.714,69	0,28
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		NOK	917.332,69 EUR		78.294,09	0,24
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		SEK	2.122.943,70 EUR		183.836,48	0,55
Bankkonto Morgan Stanley wg. Futures/Options		USD	975.589,80 EUR		903.323,89	2,72
Forderungen aus Variation Margin		USD	50.981,38 EUR		47.204,98	0,14
Summe Bankguthaben			EUR		3.348.383,14	10,10
Sonstige Vermögensgegenstände						
Gründungskosten		EUR	5.482,44 EUR		5.482,44	0,02
Summe Sonstige Vermögensgegenstände			EUR		5.482,44	0,02
Bankverbindlichkeiten						
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		EUR	-29.120,00 EUR		-29.120,00	-0,09
Verbindlichkeiten aus Variation Margin		USD	-106.200,00 EUR		-98.333,33	-0,30
Summe Bankverbindlichkeiten			EUR		-127.453,33	-0,38
Zinsverbindlichkeiten						
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		EUR	-197,80 EUR		-197,80	0,00
Zinsverbindlichkeit Bankkonto European Depositary Bank SA		USD	-29,51 EUR		-27,32	0,00
Summe Zinsverbindlichkeiten			EUR		-225,12	0,00
Summe Sonstige Verbindlichkeiten ¹⁾			EUR		-306.630,59	-0,92
Netto-Teilfondsvermögen			EUR		33.153.387,45	100,00 *)

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

1) In den "Sonstigen Verbindlichkeiten" sind fremde Depotgebühren, Performance-Fees, Prüfungskosten, Register- und Zahlstellenvergütung, Risiko-Management-Gebühr, Taxe d'abonnement, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung und Zentralverwaltungsvergütung enthalten.

Die Notierung der Wertpapiere erfolgt in Stücken, bzw. Anteilen, bzw. in Währung in 1.000.

Der beigegefügte Anhang ist ein integraler Bestandteil dieses Halbjahresberichtes.

Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - I EUR	EUR	1.039,90
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - P EUR	EUR	49,90
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - R EUR	EUR	50,36
Anteilwert des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - ZZ EUR	EUR	107.917,23
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - I EUR	STK	275,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - P EUR	STK	2.927,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - R EUR	STK	6.874,00
Umlaufende Anteile des Teilfonds Assenagon I Multi Asset Balanced - ZZ EUR	STK	300,00
Bestand der Wertpapiere am Netto-Teilfondsvermögen	%	90,89
Bestand der Derivate am Netto-Teilfondsvermögen	%	0,30

Eventualverbindlichkeiten aus Derivaten

Eventual- verbindlichkeiten aus geschriebenen Equity Optionen (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- forderungen aus gekauften Equity Optionen (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Equity Futures (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus anderen Equity Swaps (berechnet als Summe der äquivalenten Positionen im Underlying) in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus anderen Equity Derivaten (Volatility Swaps, etc.) gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Devisen- Termingeschäften gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlich- keiten aus FX Futures gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR	Eventual- verbindlichkeiten aus Zinsderivaten (Zinsfutures, Zins- und Währungsswaps) gerechnet als Summe der Nennwerte in EUR
0,00	522.645,68	9.669.779,59	0,00	0,00	0,00	4.282.407,41	0,00

Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per	29.03.2024
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,461500	= 1	EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,972750	= 1	EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,854950	= 1	EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	8,452550	= 1	EUR
Norwegische Kronen	(NOK)	11,716500	= 1	EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	11,548000	= 1	EUR
US-Dollar	(USD)	1,080000	= 1	EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced im Zeitraum vom 1. Oktober 2023 bis 31. März 2024

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	37.566,46
Zinsen aus Geldanlagen	55.610,67
Erträge aus Bestandsprovisionen	785,12
Erträge insgesamt	93.962,25
Aufwendungen	
Performanceabhängige Anlageberatervergütung	-267.819,96
Verwaltungsvergütung	-54.380,30
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-10.013,32
Verwahrstellenvergütung	-9.154,30
Prüfungskosten	-4.661,78
Taxe d'abonnement	-1.289,98
Veröffentlichungskosten	-7.868,86
Register- und Transferstellenvergütung	-3.656,04
Gründungskosten	-1.001,87
Zinsaufwendungen	-5.347,85
Sonstige Aufwendungen	-26.385,34
Aufwendungen insgesamt	-391.579,60
Ordentlicher Nettoaufwand	-297.617,35
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	1.850.910,51
Realisierte Verluste	-280.578,78
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	1.570.331,73
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	1.272.714,38
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	2.634.902,16
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-31.282,28
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	2.603.619,88
Ergebnis des Berichtszeitraumes	3.876.334,26

Vermögensentwicklung des Teilfonds

Assenagon I – Multi Asset Balanced

	EUR
Netto-Teilfondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	28.918.739,07
Ausschüttungen	-10.844,43
Mittelzuflüsse	446.689,54
Mittelabflüsse	-77.530,99
Mittelzufluss/-abfluss netto	369.158,55
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	3.876.334,26
Netto-Teilfondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	33.153.387,45

Entwicklung im Jahresvergleich

Assenagon I – Multi Asset Balanced – I EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	275,000	EUR	285.972,67	1.039,90
30.09.2023	50,000	EUR	47.263,57	945,27
30.09.2022	50,000	EUR	43.840,57	876,81

Assenagon I – Multi Asset Balanced – P EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	2.927,000	EUR	146.056,06	49,90
30.09.2023	2.075,000	EUR	94.205,80	45,40
30.09.2022	2.580,000	EUR	112.666,74	43,67

Assenagon I – Multi Asset Balanced – R EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	6.874,000	EUR	346.189,06	50,36
30.09.2023	4.822,000	EUR	220.700,36	45,77
30.09.2022	4.131,000	EUR	181.038,25	43,82

Assenagon I – Multi Asset Balanced – ZZ EUR

Stichtag	Anteile	Währung	Vermögen	Anteilswert
31.03.2024	300,000	EUR	32.375.169,66	107.917,23
30.09.2023	300,000	EUR	28.556.569,34	95.188,56
30.09.2022	400,000	EUR	35.190.155,02	87.975,39

Zusammenfassung des Assenagon I

Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens

Position	Betrag in EUR
Wertpapiervermögen	466.463.663,24
Derivate	-26.979,37
Bankguthaben	32.896.982,59
Sonstige Vermögensgegenstände	5.747,09
Summe Aktiva	499.339.413,55
Bankverbindlichkeiten	-681.398,32
Zinsverbindlichkeiten	-2.162,52
Sonstige Verbindlichkeiten	-3.915.240,55
Summe Passiva	-4.598.801,39
Netto-Fondsvermögen	494.740.612,16

Vermögensentwicklung des Netto-Fondsvermögens

	EUR
Netto-Fondsvermögen zum Beginn des Berichtszeitraumes	445.425.867,93
Ausschüttungen	-5.199.262,07
Mittelzuflüsse	35.902.080,54
Mittelabflüsse	-26.951.320,93
Mittelzufluss/-abfluss netto	8.950.759,61
Ertrags- und Aufwandsausgleich	-176.954,14
Ergebnis des Berichtszeitraumes inkl. Ertrags-/Aufwandsausgleich	45.740.200,83
Netto-Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes	494.740.612,16

Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds

	EUR
Erträge	
Erträge aus Investmentanteilen	434.114,73
Zinsen aus Geldanlagen	698.314,78
Erträge aus Bestandsprovisionen	17.682,34
Ordentlicher Ertragsausgleich	20.075,92
Erträge insgesamt	1.170.187,77
Aufwendungen	
Performance-Fees	-3.273.622,20
Verwaltungsvergütung	-2.146.917,55
Zentralverwaltungsstellenvergütung	-96.691,37
Verwahrstellenvergütung	-136.106,31
Prüfungskosten	-4.661,78
Taxe d'abonnement	-49.828,83
Veröffentlichungskosten	-19.196,16
Register- und Transferstellenvergütung	-43.024,46
Gründungskosten	-1.001,87
Zinsaufwendungen	-58.409,65
Sonstige Aufwendungen	-127.052,89
Ordentlicher Aufwandsausgleich	-97.657,86
Aufwendungen insgesamt	-6.054.170,93
Ordentlicher Nettoaufwand	-4.883.983,16
Veräußerungsgeschäfte	
Realisierte Gewinne	18.756.358,44
Ertragsausgleich auf realisierte Gewinne	314.337,65
Realisierte Verluste	-3.681.906,53
Aufwandsausgleich auf realisierte Verluste	-59.801,57
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	15.328.987,99
Realisiertes Ergebnis des Berichtszeitraumes	10.445.004,83
Veränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste	
Veränderung der nicht realisierten Gewinne	35.666.071,06
Veränderung der nicht realisierten Verluste	-370.875,06
Nettoveränderung des nicht realisierten Ergebnisses des Berichtszeitraumes	35.295.196,00
Ergebnis des Berichtszeitraumes	45.740.200,83

Anhang zum ungeprüften Halbjahresbericht

Allgemein

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

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

Gegenwärtig sind zwei Teilfonds im Fonds Assenagon I aufgelegt:

- Assenagon I - Multi Asset Conservative
- Assenagon I - Multi Asset Balanced

Anteile der Anteilklassen I und P des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative werden seit dem 16. November 2015 zum Kauf angeboten, die Anteilklasse R seit dem 13. Dezember 2017, die Anteilklasse N seit dem 20. April 2021, die Anteilklassen I2R und P2R seit dem 15. September 2023 und die Anteilklasse N2 seit dem 22. Dezember 2022.

Anteile der Anteilklassen I, P, R und ZZ des Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced werden seit dem 8. Dezember 2021 zum Kauf angeboten.

Der Fonds und seine Teilfonds bilanzieren in Euro. Der Halbjahresbericht wurde auf der Basis der letzten Nettoinventarwertberechnung zum 28. März 2024 aufgestellt.

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften (LUX-GAAP) unter der Annahme der Unternehmensfortführung erstellt.

Bewertungs- und Bilanzierungsgrundsätze

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

1. Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird nachfolgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Vermögenswerte, die an einer Börse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs bewertet. Wenn ein Vermögenswert an mehreren Börsen notiert ist, ist der letzte verfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für diesen Vermögenswert ist.
- b) Vermögenswerte, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, werden zu dem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs zur Zeit der Bewertung sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Vermögenswerte verkauft werden können.
- c) Nicht börsennotierte Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfbaren Bewertung auf Tagesbasis bewertet. Die für die Preisfeststellung der Derivate bestimmten Kriterien erfolgen in üblicher, vom Wirtschaftsprüfer nachvollziehbaren, Weise.
- d) Falls die unter Buchstaben a) und b) genannten Kurse nicht marktgerecht sind oder sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in a) oder b) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, werden diese Vermögenswerte ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern 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 des Verwaltungsrates auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt. Der Liquidationswert von Futures oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures oder Optionen vom Teilfonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettoinventarwert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.

- g) Swaps werden zum Barwert (Present Value) bewertet.
 - h) Flüssige Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich anteiliger Zinsen bewertet. Festgelder können zum jeweiligen Renditekurs bewertet werden, vorausgesetzt, ein entsprechender Vertrag zwischen dem Finanzinstitut, welches die Festgelder verwahrt, und der Verwaltungsgesellschaft sieht vor, dass diese Festgelder zu jeder Zeit kündbar sind und dass im Falle einer Kündigung ihr Realisierungswert diesem Renditekurs entspricht.
 - i) Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Nettoinventarwert bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahme ausgesetzt ist oder keine Rücknahmepreise festgelegt werden, werden die Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben auf der Grundlage des wahrscheinlich errechenbaren Verkehrswertes festlegt.
 - j) Alle nicht auf die jeweilige Teilfondswährung lautenden Vermögenswerte werden zum letzten verfügbaren Devisenkurs in die betreffende Teilfondswährung umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisentransaktionen werden hinzugerechnet oder abgesetzt.
 - k) Sämtliche sonstigen Wertpapiere oder sonstigen Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Verkehrswert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben von der Verwaltungsgesellschaft und nach einem von ihr festgelegten Verfahren bestimmt wird.
2. Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Teilfonds für angebracht hält.
 3. Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Nettoinventarwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Nettoinventarwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Nettoinventarwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Nettoinventarwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.
 4. Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird gegebenenfalls um Ausschüttungen reduziert, die an die Anleger des Teilfonds gezahlt werden.
 5. Für die jeweiligen Anteilklassen erfolgt die daraus resultierende Anteilswertberechnung nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilsklasse getrennt. Die Zusammenstellung und Zuordnung der Aktiva erfolgt jedoch immer für den gesamten Teilfonds.
 6. Auf die ordentlichen und außerordentlichen Erträge kann ein Ertragsausgleich gerechnet werden.
 7. Die Aufstellungen „Zusammensetzung des Netto-Fondsvermögens“, „Vermögensentwicklung des Netto-Fondsvermögens“ und „Ertrags- und Aufwandsrechnung des Fonds“ im Abschnitt „Zusammenfassung des Assenagon I“ auf den Seiten 20 und 21 dieses Berichtes, entsprechen der Summe der beiden Teilfonds des Umbrella-Fonds Assenagon I.

Erträge

Dividenden werden an dem Datum, an dem die betreffenden Wertpapiere erstmals "Ex-Dividende" notiert werden, als Ertrag verbucht. Zinserträge laufen täglich auf.

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt.

Kosten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Für die Anteilsklasse I

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

Für die Anteilsklasse P

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,3 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse N

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,55 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse R

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

Für die Anteilsklasse I2R

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

Für die Anteilsklasse P2R

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,3 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoteilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse N2

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,55 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Für die Anteilsklasse I

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,75 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse P

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 1,2 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse R

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,75 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Für die Anteilsklasse ZZ

Die Verwaltungsgesellschaft entnimmt dem Teilfonds ein Entgelt von 0,35 % p. a. Diese Vergütung wird täglich berechnet und abgegrenzt und am Monatsultimo auf Basis des durchschnittlichen monatlichen Netto-Teilfondsvermögen ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

Die Verwahrstelle und die Zahlstelle in Luxemburg sind berechtigt ein Entgelt von bis zu 0,04 % p. a., mindestens jedoch EUR 10.000 p. a. zu erhalten. Zusätzliche fixe und transaktionsabhängige Gebühren werden von der Verwahrstelle entsprechend der erbrachten Dienstleistungen berechnet. Die Vergütung wird täglich abgegrenzt und am Ende des Kalenderquartals auf Basis des durchschnittlichen Teilfondsvermögens berechnet und ausbezahlt. Die Vergütung versteht sich zuzüglich einer etwaigen Mehrwertsteuer.

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

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

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

Hinweis zur Performance-Fee im Berichtszeitraum

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Netto-Teilfondsvermögen eine Performance Fee. Diese erfolgsabhängige Vergütung beträgt für die Anteilklassen I, P, R und N des Teilfonds 10% der Wertentwicklung, die über 2,5% („Hurdle Rate“) p.a. hinausgeht.

Diese Mehr- bzw. Minderperformance wird täglich ermittelt und ein möglicher Anspruch in der Fondspreisermittlung berücksichtigt. Ein positiver Anspruch wird in der Regel nach Abschluss eines Geschäftsjahres ausgezahlt. Eine High-Water-Mark gewährleistet, dass eine wiederkehrende Mehrperformance bei schwankenden Preisen der Verwaltungsgesellschaft nur einmalig vergütet wird.

Assenagon I	Anteil-Klasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee In % des durchschnittl. Nettovermögens der Anteilsklasse
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	1.585.544,64	0,79 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	1.157.092,38	0,65 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	198.410,58	0,63 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	64.647,35	0,66 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I2R EUR	-	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P2R EUR	-	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N2 EUR	107,29	0,42 %

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Die Verwaltungsgesellschaft erhält aus dem Netto-Teilfondsvermögen eine Performance Fee. Diese erfolgsabhängige Vergütung beträgt für den die Klassen I, P und R des Teilfonds 10% der Wertentwicklung, die über 3,0% („Hurdle Rate“) p.a. hinausgeht. Für die Anteilklasse ZZ des Teilfonds beträgt diese 20% der Wertentwicklung bei einer Hurdle Rate von 0,0%.

Diese Mehr- bzw. Minderperformance wird täglich ermittelt und ein möglicher Anspruch in der Fondspreisermittlung berücksichtigt. Ein positiver Anspruch wird in der Regel nach Abschluss eines Geschäftsjahres ausgezahlt. Eine High-Water-Mark gewährleistet, dass eine wiederkehrende Mehrperformance bei schwankenden Preisen der Verwaltungsgesellschaft nur einmalig vergütet wird.

Assenagon I	Anteil-Klasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee In % des durchschnittl. Nettovermögens der Anteilsklasse
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	811,41	1,38 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	845,14	0,81 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	2.257,52	0,96 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	263.905,89	0,90 %

Weitere Informationen zur Performance Fee-Berechnung befinden sich im Verkaufsprospekt.

Ausweis der Kontrahenten

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative und Assenagon I – Multi Asset Balanced

Beide Teilfonds haben im Berichtszeitraum Geschäfte über Derivate mit dem folgenden Kontrahenten getätigt:

- European Depositary Bank S.A.
- Morgan Stanley

Aufstellung über die Entwicklung des Wertpapierbestandes

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

Ertragsverwendung

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Die Anteilsklassen I, N2, I2R und P2R des Teilfonds sind thesaurierend. Die Anteilsklasse P, N und R des Teilfonds sind ausschüttend. Im Berichtszeitraum fanden folgende Ausschüttungen statt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Ex-Tag	Ausschüttung je Anteil	
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	14.11.2023	EUR	1,36
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	14.11.2023	EUR	1,12
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	14.11.2023	EUR	1,31

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Die Anteilklassen I, P, R und ZZ des Teilfonds sind ausschüttend. Im Berichtszeitraum fanden folgende Ausschüttungen statt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Ex-Tag	Ausschüttung je Anteil	
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	14.11.2023	EUR	27,23
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	14.11.2023	EUR	1,31
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	14.11.2023	EUR	1,32

Besteuerung (Taxe d'abonnement)

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Der Teilfonds unterliegt einer Abonnementsteuer (Taxe d'abonnement) in Höhe von 0,01 % p. a. für die Anteilsklasse I und 0,05 % p. a. für die Anteilsklasse P, N, N2, R, I2R und P2R, welche vierteljährlich auf der Grundlage des Gesamtnettovermögens am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird.

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

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

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

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

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

Verwaltungsgebühren der KAG-fremden Zielfonds

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

Verwaltungsgebühren der KAG-eigenen Zielfonds

Der / die Teilfonds des Assenagon I waren im Berichtszeitraum in folgende(n) ebenfalls von der Assenagon Asset Management S.A. verwalteten Zielfonds investiert:

ISIN	Fondsname	max. Verwaltungsgebühr in %
LU0575255335	Assenagon Alpha Volatility Namens-Anteile I o.N.	0,80%

Wichtige Ereignisse während des Berichtszeitraumes

Mit Wirkung zum 1. Januar 2024 wechselte die Zahlstelle und der Vertreter in der Schweiz für den Fonds.

Vertreter in der Schweiz bis zum 31. Dezember 2023:

Carnegie Fund Services S.A.
11, rue du Général-Dufour
CH-1204 Genf

Tel: +41 22 705 11 77
Fax: +41 22 705 11 78
www.carnegie-fund-services.ch

Zahlstelle in der Schweiz bis zum 31. Dezember 2023:

Banque Cantonale de Genève
17, Quai de l'Île
CH-1204 Genf

Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz seit dem 1. Januar 2024:

REYL & CIE SA
4, rue du Rhône
CH-1204 Genf

Tel: +41 22 816 80 00
Fax: +41 22 816 80 01
www.reyl.com

Seit dem 1. Januar 2024 ist die Zweigniederlassung München unter folgender Adresse registriert:

Vertriebs- und Informationsstelle für die Bundesrepublik Deutschland und Informationsstelle für die Republik Österreich

Assenagon Asset Management S.A.
Zweigniederlassung München
Landsberger Straße 346 *)
80687 München
Deutschland

Mit Wirkung zum 13. November 2023 wurden die Anteilklassen I2 und P2 des Teilfonds Assenagon I - Multi Asset Conservative in I2R und P2R umbenannt.

Die Teilfonds Assenagon I - Multi Asset Conservative und Assenagon I - Multi Asset Balanced halten Anteile am Lyxor MSCI Russia UCITS ETF. Die Börsennotiz dieses Fonds wurde am 4. März 2022 wegen anhaltenden kriegerischen Handlungen zwischen Russland und der Ukraine ausgesetzt. Daraufhin beschloss das Valuation Committee von Assenagon Asset Management S.A., die Bewertung dieses Instruments bis zu einer Wiederaufnahme der Börsennotiz mit einem Wert von EUR 0 anzusetzen.

Mit Wirkung zum 1. März 2024 änderte die Verwahrstelle European Depositary Bank SA ihre Adresse. Neuer Sitz der Verwahrstelle ist die 9a, Rue Gabriel Lippmann in L-5365 Munsbach (vormals 3, Rue Gabriel Lippmann).

Wichtige Ereignisse nach Ende des Berichtszeitraumes

Es lagen keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag vor.

*) vorher: Prannerstraße 8 in 80333 München.

Nachhaltigkeitsbezogene Angaben

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Conservative

Der Fonds erfüllt die zum 10. März 2021 in Kraft getretenen Anforderungen des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung). Dabei wurde bei aktiven Zielfonds-Investments ein best-in-class-Ansatz verfolgt, welcher im Jahres-Durchschnitt zu Fonds mit einer überdurchschnittlichen ESG-Ausprägung geführt hat. Auf Einzeltitel-Ebene, bestehend aus einer Position im Bereich Energie, wurde eine Verbesserung im absoluten ESG-Score erreicht. Da sich das herangezogene Vergleichsuniversum lt. MSCI stärker verbessert hat, wurde aktiv ein Engagement-Prozess initiiert. Darüber hinaus wurden Unternehmen mit besonders schwerwiegenden Kontroversen (inkl. Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact) sowie mit signifikanten Umsatzanteilen in umstrittenen Geschäftsfeldern (inkl. einer Null-Toleranz-Schwelle für Emittenten mit Bezug zu geächteten Waffen) als Direktinvestments ausgeschlossen.

Teilfonds Assenagon I – Multi Asset Balanced

Der Fonds erfüllt die zum 10. März 2021 in Kraft getretenen Anforderungen des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung). Dabei wurde bei aktiven Zielfonds-Investments ein best-in-class-Ansatz verfolgt, welcher im Jahres-Durchschnitt zu Fonds mit einer überdurchschnittlichen ESG-Ausprägung geführt hat. Auf Einzeltitel-Ebene, bestehend aus einer Position im Bereich Energie, wurde eine Verbesserung im absoluten ESG-Score erreicht. Da sich das herangezogene Vergleichsuniversum lt. MSCI stärker verbessert hat, wurde aktiv ein Engagement-Prozess initiiert. Darüber hinaus wurden Unternehmen mit besonders schwerwiegenden Kontroversen (inkl. Verstößen gegen die Prinzipien des UN Global Compact) sowie mit signifikanten Umsatzanteilen in umstrittenen Geschäftsfeldern (inkl. einer Null-Toleranz-Schwelle für Emittenten mit Bezug zu geächteten Waffen) als Direktinvestments ausgeschlossen.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und deren Weiterverwendung

Am 23. Dezember 2015 wurde die Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (SFTR) im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlicht.

Die SFTR regelt im Wesentlichen Verpflichtungen im Hinblick auf sogenannte "Wertpapierfinanzierungsgeschäfte" (WFG). Durch die SFTR werden für den Abschluss, die Änderung oder Beendigung von WFG neben den nach EMIR bereits bestehenden Reporting-Verpflichtungen (die aber für WFG grundsätzlich nicht anwendbar sind) zusätzliche Meldepflichten begründet.

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

Zusatzinformationen für Anleger in der Schweiz

Allgemein

Assenagon I ist ein Investmentfonds nach Luxemburger Recht, der als "Fonds Commun de Placement à Compartiments Multiples" aufgelegt wurde.

Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz:

REYL & CIE SA
4, rue du Rhône
CH-1204 Genf

Bezugsort für maßgebliche Dokumente

Das Verwaltungsreglement sowie der Prospekt und das "Basisinformationsblatt", die Liste über die Aufstellung der Käufe und Verkäufe sowie der Jahres- und Halbjahresbericht des Fonds können in der Schweiz kostenlos bei den oben genannten Vertretern bezogen werden. Die Veröffentlichungen der Anteilspreise in der Schweiz erfolgen auf der elektronischen Plattform der Gesellschaft fundinfo AG (www.fundinfo.com).

Total Expense Ratio

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio oder "TER"), drückt das Verhältnis der Kosten und Gebühren (mit Ausnahme der Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens innerhalb einer 12-Monats-Periode aus.

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

Assenagon I	Anteils- klasse	Total Expense Ratio*)	Synthetische Total Expense Ratio
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	0,87 %	1,46 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	1,50 %	2,09 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	0,90 %	1,49 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	1,74 %	2,33 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I2R EUR ¹⁾	1,01 %	1,60 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P2R EUR ¹⁾	1,63 %	2,22 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N2 EUR ²⁾	1,76 %	2,35 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	1,14 %	1,72 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	1,58 %	2,16 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	1,14 %	1,73 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	0,73 %	1,31 %

*) Die Total Expense Ratio im Halbjahresbericht setzt sich aus den Daten des Berichtshalbjahres und dem 2. Halbjahr des vorangegangenen Geschäftsjahres zusammen.

¹⁾ Annualisierte Kostenquote auf Basis des Zeitraums seit Erstausgabedatum der Anteilklasse am 15. September 2023 bis zum 31. März 2024.

²⁾ Annualisierte Kostenquote auf Basis des Zeitraums seit Erstausgabedatum der Anteilklasse am 22. Dezember 2023 bis zum 31. März 2024.

Die Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio entspricht der AMAS-Richtlinie vom 16. Mai 2008 (Stand 5. August 2021).

Erfolgsabhängige Kommission ("Performance Fee")

Assenagon I	Anteilklasse	Performance Fee in EUR	Performance Fee In % des durchschnittl. Nettovermögens der Anteilsklasse
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	1.585.544,64	0,79 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	1.157.092,38	0,65 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	198.410,58	0,63 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	64.647,35	0,66 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative ¹⁾	I2R EUR	-	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative ¹⁾	P2R EUR	-	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N2 EUR	107,29	0,42 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	811,41	1,38 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	845,14	0,81 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	2.257,52	0,96 %
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	263.905,89	0,90 %

1) Für die Anteilklasse wird derzeit, abweichend vom aktuell gültigen Verkaufsprospekt, keine Performance Fee erhoben.

Performance-Kennzahlen (Stand: 31. März 2024)

Assenagon I	Anteilklasse	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I EUR	10,21 %	6,14 %	-8,58 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P EUR	10,02 %	5,49 %	-8,99 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	R EUR	10,20 %	6,12 %	-8,64 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N EUR	9,85 %	5,24 %	-9,30 %
Assenagon I – Multi Asset Conservative	I2R EUR	10,92 %	-1,33 % ¹⁾	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative	P2R EUR	10,58 %	-1,36 % ¹⁾	-
Assenagon I – Multi Asset Conservative	N2 EUR	4,52 % ³⁾	-	-
Assenagon I – Multi Asset Balanced	I EUR	13,21 %	7,81 %	-12,32 % ²⁾
Assenagon I – Multi Asset Balanced	P EUR	13,12 %	7,31 %	-12,66 % ²⁾
Assenagon I – Multi Asset Balanced	R EUR	13,24 %	7,80 %	-12,36 % ²⁾
Assenagon I – Multi Asset Balanced	ZZ EUR	13,37 %	8,20 %	-12,02 % ²⁾

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performance-Daten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen erhobenen Kommissionen unberücksichtigt.

¹⁾ Für den Zeitraum seit Erstausgabedatum am 15. September 2023 bis zum 30. September 2023.

²⁾ Für den Zeitraum seit Erstausgabedatum am 8. Dezember 2021 bis zum 30. September 2022.

³⁾ Für den Zeitraum seit Erstausgabedatum am 22. Dezember 2023 bis zum 31. März 2024.



Assenagon Asset Management S.A.

Aerogolf Center, 1B, Heienhaff

1736 Senningerberg

Luxemburg

Telefon +352 27049-100

Telefax +352 27049-111

www.assenagon.com

© 2024