

Halbjahresbericht

Global Fixed Income AMI

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Investmentanteile	166.058.437,25	99,79
Gemischte Fonds	4.375.800,00	2,63
Rentenfonds	156.370.477,25	93,97
Alternative Investments ¹⁾	5.312.160,00	3,19
Bankguthaben	447.885,60	0,27
Verbindlichkeiten	-103.854,57	-0,06
Fondsvermögen	166.402.468,28	100,00²⁾

¹⁾ Z. B. Rohstoff-Fonds, Private-Equity-Fonds etc.

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Investmentanteile						EUR	166.058.437,25	99,79
Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	166.058.437,25	99,79
Algebris UCITS Funds plc - Algebris Global Credit	IE00BYT35D51	ANT	34.000	36.000	2.000	EUR 128,7000	4.375.800,00	2,63
BayernInvest Renten Europa-Fonds	DE000A0ETKT9	ANT	9.200	2.000	800	EUR 894,5300	8.229.676,00	4,95
BlackRock Global Funds - Euro Bond Fund	LU0368229703	ANT	620.000	205.000	85.000	EUR 13,0800	8.109.600,00	4,87
BlueBay Inv. Grade Euro Government Bond Fund	LU0549539178	ANT	38.000	6.000	8.000	EUR 157,3900	5.980.820,00	3,59
DPAM L - Bonds Emerging Markets Sustainable-F	LU0907928062	ANT	48.000	8.000	12.000	EUR 145,1800	6.968.640,00	4,19
Epsilon Fund - Euro Bond	LU0278427041	ANT	35.000	9.000	2.000	EUR 170,2600	5.959.100,00	3,58
Erste Bond Emerging Markets Corporate I01-V	AT0000A1W4C5	ANT	40.000	9.000	7.000	EUR 193,0600	7.722.400,00	4,64
Fidelity Funds - Euro Bond Fund	LU1322386183	ANT	364.000	74.000	310.000	EUR 9,5770	3.486.028,00	2,09
Flossbach von Storch - Bond Opportunities IT	LU1481584016	ANT	62.000	13.000	9.000	EUR 114,6800	7.110.160,00	4,27
GAM Star-Cat Bond Fund-INAC	IE00B6TLWG59	ANT	350.000	0	50.000	EUR 14,7177	5.151.195,00	3,10
Generali Investments SICAV - Euro Bond	LU0145476148	ANT	23.500	2.000	2.500	EUR 208,4780	4.899.233,00	2,94
Henderson - Euro High Yield Bond Fund	LU0828818087	ANT	18.000	0	4.000	EUR 151,4800	2.726.640,00	1,64
Jupiter-Dynamic Bond Fund-IA	LU0853555893	ANT	510.000	60.000	80.000	EUR 12,4700	6.359.700,00	3,82
Kepler Europa Rentenfonds-IT	AT0000A1CTD8	ANT	62.000	13.500	0	EUR 136,6600	8.472.920,00	5,09
Lazard Global Convertibles Investment Grade Fund	IE00BMW2DG44	ANT	44.000	0	2.000	EUR 94,9732	4.178.820,80	2,51
Legal & General SICAV - L&G Euro High Alpha Corp.	LU1003761993	ANT	8.000.000	600.000	0	EUR 0,9069	7.255.200,00	4,36
Nomura Funds Ireland plc - Global Dynamic Bond Fun	IE00BTL1GS46	ANT	56.500	5.500	7.000	EUR 112,4873	6.355.532,45	3,82
Nordea 1 - Danish Mortgage Bond Fund	LU0772917414	ANT	168.000	10.000	52.000	EUR 30,3074	5.091.643,20	3,06
Nordea 1 SICAV - European Covered Bond Opportuniti	LU1915690835	ANT	38.000	38.000	0	EUR 110,8928	4.213.926,40	2,53
Nordea 1-European Covered Bond Fund BI EUR	LU0539144625	ANT	388.000	78.000	100.000	EUR 13,2211	5.129.786,80	3,08
PGIM Funds PLC - PGIM European High Yield Bond	IE00BFLR1S95	ANT	2.800	0	0	EUR 1.228,5370	3.439.903,60	2,07
Pimco-Euro Bond	IE0004931386	ANT	400.000	140.000	40.000	EUR 22,0300	8.812.000,00	5,30
Robeco Capital Growth Funds - High Yield Bonds	LU0227757233	ANT	14.000	0	0	EUR 235,9800	3.303.720,00	1,99
SEB Prime Solutions - Sisse- ner Corporate Bond Fund	LU2262944817	ANT	440.000	50.000	110.000	EUR 11,1000	4.884.000,00	2,94
Threadn.-European Corporate Bond	LU1849561870	ANT	700.000	100.000	80.000	EUR 9,5760	6.703.200,00	4,03
Twelve Cat Bond Fund	IE00BD2B9827	ANT	48.000	0	6.000	EUR 110,6700	5.312.160,00	3,19
UBS Lux Bond SICAV - Convert Global EUR	LU0396331836	ANT	8.000	0	0	EUR 201,1200	1.608.960,00	0,97

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
UI - Aktia EM Frontier Bond+	LU1848876493	ANT	56.000	12.000	2.000	EUR	116,9400	6.548.640,00	3,94
XAIA Credit Basis II	LU0946790796	ANT	4.400	0	1.600	EUR	1.128,3300	4.964.652,00	2,98
iShares Fallen Angels High Yield Corp Bond UCITS E	IE00BF3N7219	ANT	600.000	0	0	EUR	4,5073	2.704.380,00	1,63
Summe Wertpapiervermögen							166.058.437,25		99,79
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	447.885,60		0,27
Bankguthaben						EUR	447.885,60		0,27
EUR - Guthaben bei						EUR	447.885,60		0,27
Verwahrstelle		EUR	447.885,60				447.885,60		0,27
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-103.854,57		-0,06
Fondsvermögen						EUR	166.402.468,28		100,00²⁾
Anteilwert						EUR	95,03		
Umlaufende Anteile						STK	1.751.063		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									99,79
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,00

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren und Verwahrstellenvergütung

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Zusätzliche Angaben nach § 16 Absatz 1 Nummer 2 KARBV – Angaben zum Bewertungsverfahren

Alle Wertpapiere, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt.

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen. Anteile an Investmentvermögen werden zum letzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis des Vortages.

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung.

Das bisherige Vorgehen bei der Bewertung der Assets des Sondervermögens findet auch vor dem Hintergrund der Auswirkungen durch Covid-19 Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen in diesem Zusammenhang waren bisher nicht notwendig.

Zum Stichtag 30. Juni 2023 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 100 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte per 29.06.2023 oder letztbekannte

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
IP Bond-Select-I	LU0204032410	ANT	25.000	95.000
M&G Lux Investment Funds 1 - M&G Lux Short Dated C	LU1670718482	ANT	60.000	450.000

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

Verwaltungsvergütung der im Global Fixed Income AMI enthaltenen Investmentanteile:	% p.a.
Algebris UCITS Funds plc - Algebris Global Credit	0,90000
BayernInvest Renten Europa-Fonds	0,40000
BlackRock Global Funds - Euro Bond Fund	0,65000
BlueBay Inv. Grade Euro Government Bond Fund	1,00000
DPAM L - Bonds Emerging Markets Sustainable-F	0,53000
Epsilon Fund - Euro Bond	0,25000
Erste Bond Emerging Markets Corporate I01-V	0,50000
Fidelity Funds - Euro Bond Fund	0,40000
Flossbach von Storch - Bond Opportunities IT	1,03000
GAM Star-Cat Bond Fund-INAC	1,10000
Generali Investments SICAV - Euro Bond	0,40000
Henderson - Euro High Yield Bond Fund	1,05000
IP Bond-Select-I	0,55500
Jupiter-Dynamic Bond Fund-IA	0,50000
Kepler Europa Rentenfonds-IT	0,96000
Lazard Global Convertibles Investment Grade Fund	0,35000
Legal & General SICAV - L&G Euro High Alpha Corp.	0,50000
M&G Lux Investment Funds 1 - M&G Lux Short Dated C	0,15000
Nomura Funds Ireland plc - Global Dynamic Bond Fun	0,60000
Nordea 1 - Danish Mortgage Bond Fund	0,30000
Nordea 1 SICAV - European Covered Bond Opportuniti	0,35000
Nordea 1-European Covered Bond Fund BI EUR	0,30000
PGIM Funds PLC - PGIM European High Yield Bond	0,50000
Pimco-Euro Bond	0,46000
Robeco Capital Growth Funds - High Yield Bonds	0,50000
SEB Prime Solutions - Sissener Corporate Bond Fund	0,70000
Threadn.-European Corporate Bond	0,60000
Twelve Cat Bond Fund	k.A.
UBS Lux Bond SICAV - Convert Global EUR	1,20000
UI - Aktia EM Frontier Bond+	1,35000
XAIA Credit Basis II	0,80000
iShares Fallen Angels High Yield Corp Bond UCITS E	0,55000

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im Juli 2023

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Postfach 10 16 65
50456 Köln
Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com

Amtsgericht Köln: HRB 3495
USt-Id-Nr. DE 115658034

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.06.2023)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

Ampega Asset Management GmbH (94,9 %)
Talanx AG (5,1 %)

Aufsichtsrat

Dr. Jan Wicke, Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Clemens Jungsthöfel, Stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der Hannover Rück SE, Hannover

Jens Hagemann
Dipl.-Kaufmann, München

Dr. Christian Hermelingmeier
Mitglied des Vorstands der HDI Global SE, Hannover

Sven Lixenfeld
Mitglied des Vorstands der HDI Deutschland AG, Düsseldorf

Geschäftsführung

Dr. Thomas Mann, Sprecher
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Dr. Dirk Erdmann
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Stefan Kampmeyer
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Auslagerung

Compliance, Revision, Rechnungswesen und IT-Dienstleistungen sind auf Konzernunternehmen ausgelagert, d. h. die Talanx AG (Compliance und Revision), die HDI AG (Rechnungswesen und IT-Dienstleistungen).

Anlageberater

Skandia PortfolioManagement GmbH
Dornhofstraße 36
63263 Neu-Isenburg
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Straße 24 - 28
60439 Frankfurt am Main
Deutschland

Über Änderungen wird in den regelmäßig zu erstellenden Halbjahres- und Jahresberichten sowie auf der Homepage der Ampega Investment GmbH (www.ampega.com) informiert.



Ampega Investment GmbH
Postfach 10 16 65, 50456 Köln, Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com