

Halbjahresbericht

Ampega ISP Dynamik

1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020

OGAW-Sondervermögen



Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.06.2020

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Zertifikate	3.176.791,18	5,37
Jersey	3.176.791,18	5,37
Investmentanteile	54.883.728,31	92,81
Geldmarktfonds	7.947.229,38	13,44
Geldmarktnahe Fonds	7.310.084,52	12,36
Aktienfonds	13.602.814,84	23,00
Gemischte Fonds	7.376.749,59	12,47
Rentenfonds	17.652.929,49	29,85
Alternative Investments ¹⁾	993.920,49	1,68
Bankguthaben	1.103.932,16	1,87
Sonstige Vermögensgegenstände	9.199,03	0,02
Verbindlichkeiten	-41.079,86	-0,07
Fondsvermögen	59.132.570,82	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 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	3.176.791,18	5,37
Zertifikate						EUR	3.176.791,18	5,37
Invesco Physical Gold ETC	IE00B579F325	STK	20.800	20.800	0	USD 171,7300	3.176.791,18	5,37
Investmentanteile						EUR	46.936.498,93	79,38
Gruppeneigene Investmentanteile						EUR	9.441.598,58	15,97
Ampega DividendePlus Aktienfonds I(a)	DE000A0NBPK6	ANT	1.244	0	1.818	EUR 1.200,9800	1.494.019,12	2,53
Ampega Reserve Rentenfonds P (a)	DE0008481144	ANT	122.757	122.757	0	EUR 49,8100	6.114.526,17	10,34
Ampega Unternehmensanleihenfonds	DE0008481078	ANT	33.836	0	0	EUR 24,8000	839.132,80	1,42
Tresides Commodity One A (a)	DE000A1W1MH5	ANT	13.059	0	0	EUR 76,1100	993.920,49	1,68
Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	37.494.900,35	63,41
AXA WF - Global Inflation Bonds-IR	LU0482270666	ANT	3.400	0	0	EUR 80,4600	273.564,00	0,46
Anima-Star High Potential Europe-I	IE0032464921	ANT	421.930	0	0	EUR 8,3052	3.504.213,04	5,93
CS Lux AgaNola Global Convertible Bond Fund	LU1732803868	ANT	2.070	2.070	0	USD 1.087,2900	2.001.681,16	3,39
Candriam Index Arbitrage C	FR0010016477	ANT	469	0	0	EUR 1.396,7500	655.075,75	1,11
DNCA Alpha GOV	FR0013412533	ANT	15.000	0	0	EUR 95,2800	1.429.200,00	2,42
Fisch CB - Global Defensive BQ2	LU1353173815	ANT	18.217	0	0	EUR 102,7300	1.871.432,41	3,16
HSBC Discountstrukturen	DE000A0NA4K9	ANT	51.152	51.152	0	EUR 62,9000	3.217.460,80	5,44
Invesco JPX-Nikkei 400 UCITS ETF	IE00BPRCH686	ANT	7.626	0	30.757	EUR 131,4900	1.002.742,74	1,70
Invesco-Japanese Equity Advantage Fund AI	LU0607514634	ANT	21.415	0	22.085	EUR 23,4600	502.395,90	0,85
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income PDS	IE00B0D43V07	ANT	29.807	0	0	USD 88,2600	2.339.706,35	3,96
Loomis Sayles Sh. Term Em. Markets Bond H-I/A EUR	LU0980584436	ANT	11.613	0	3.087	EUR 102,9500	1.195.558,35	2,02
Mirova - Global Climate Ambition Equity Fund-I	LU1847729222	ANT	4.253	0	8.947	EUR 108,4000	461.025,20	0,78

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	LU0733665771	ANT	290.958	290.958	0 EUR	13,9100	4.047.225,78	6,84
Ossiam US Min Variance ESG NR UCITS ETF 1AUSD C	IE00BHNGHW42	ANT	7.771	7.771	0 USD	225,0250	1.555.202,13	2,63
PowerShares FTSE RAFI Europ. ETF	IE00B23D8539	ANT	58.673	0	211.327 EUR	15,7020	921.283,45	1,56
Robeco High Yield Bonds Fund-I	LU0398248921	ANT	2.369	0	6.953 USD	300,1600	632.407,54	1,07
Robeco US Conservative Equities-G	LU1113137761	ANT	17.966	0	29.378 USD	106,8200	1.706.801,96	2,89
SPDR Euro Stoxx Low Volatility UCITS ETF	IE00BFTWP510	ANT	25.743	9.922	66.006 EUR	37,1000	955.065,30	1,62
SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats ETF	IE00B5M1WJ87	ANT	29.346	0	117.528 EUR	20,0800	589.267,68	1,00
SPDR S&P US Dividend Aristocrats ETF	IE00B6YX5D40	ANT	32.629	12.223	50.594 EUR	44,1850	1.441.712,37	2,44
UBS ETF-MSCI EMU Value UCITS	LU0446734369	ANT	20.142	0	42.438 EUR	31,1750	627.926,85	1,06
iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF	IE00BKM4GZ66	ANT	54.230	0	126.958 EUR	24,0140	1.302.279,22	2,20
iShares Core MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF	IE00B52MJY50	ANT	8.629	0	16.148 USD	135,9200	1.043.092,92	1,76
iShares Euro Covered Bond UCITS ETF	IE00B3B8Q275	ANT	2.000	0	0 EUR	158,9250	317.850,00	0,54
iShares USD TIPS UCITS ETF	IE00B1FZSC47	ANT	18.749	13.703	0 EUR	208,0500	3.900.729,45	6,60
Summe Wertpapiervermögen							50.113.290,11	84,75
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	9.051.161,54	15,31
Bankguthaben						EUR	1.103.932,16	1,87
EUR - Guthaben bei						EUR	1.103.932,16	1,87
Verwahrstelle		EUR	1.103.932,16				1.103.932,16	1,87
Geldmarktfonds						EUR	7.947.229,38	13,44
Gruppenfremde Geldmarktfonds						EUR	7.947.229,38	13,44
Lyxor Smart Overnight Return ETF Class C	LU1190417599	ANT	6.047	6.047	0 EUR	986,0720	5.962.777,38	10,08
ODDO BHF Money Market	DE000A1CUGJ8	ANT	400	400	0 EUR	4.961,1300	1.984.452,00	3,36
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	9.199,03	0,02
Forderungen aus Zielfondsausschüttungen		EUR					9.199,03	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-41.079,86	-0,07
Fondsvermögen						EUR	59.132.570,82	100,00²⁾
Anteilwert						EUR	110,96	
Umlaufende Anteile						STK	532.924,559	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								98,19
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung und Veröffentlichungskosten

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.

Zum Stichtag 30. Juni 2020 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.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.06.2020

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,12440	= 1 (EUR)
----------------------------	-------	---------	-----------

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

per 29.06.2020 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				
Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF	LU0599612412	ANT	0	25.359
Thema Fund	IE0030487957	ANT	0	1.000

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Abs. 1 Nr. 3d KARBV

Verwaltungsvergütung der im Ampega ISP Dynamik enthaltenen Investmentanteile: % p.a.

AXA WF - Global Inflation Bonds-IR	0,80000
Ampega DividendePlus Aktienfonds I(a)	0,60000
Ampega Reserve Rentenfonds P (a)	0,40000
Ampega Unternehmensanleihenfonds	0,75000
Anima-Star High Potential Europe-I	0,60000
CS Lux AgaNola Global Convertible Bond Fund	k.A.
Candriam Index Arbitrage C	0,50000
DNCA Alpha GOV	0,80000
Fisch CB - Global Defensive BQ2	0,75000
HSBC Discountstrukturen	0,37500
Invesco JPX-Nikkei 400 UCITS ETF	0,19000
Invesco-Japanese Equity Advantage Fund AI	1,80000
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income PDS	0,75000
Loomis Sayles Sh. Term Em. Markets Bond H-I/A EUR	k.A.
Lyxor Smart Overnight Return ETF Class C	0,20000
Mirova - Global Climate Ambition Equity Fund-I	k.A.
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	0,30000
ODDO BHF Money Market	0,05000
Ossiam US Min Variance ESG NR UCITS ETF 1AUSD C	k.A.
Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF	k.A.
PowerShares FTSE RAFI Europ. ETF	0,39000
Robeco High Yield Bonds Fund-I	1,00000
Robeco US Conservative Equities-G	0,62000
SPDR Euro Stoxx Low Volatility UCITS ETF	0,30000
SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats ETF	0,30000
SPDR S&P US Dividend Aristocrats ETF	0,35000
Thema Fund	1,62500
Tresides Commodity One A (a)	1,50000
UBS ETF-MSCI EMU Value UCITS	0,25000
iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF	0,25000
iShares Core MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF	k.A.
iShares Euro Covered Bond UCITS ETF	k.A.
iShares USD TIPS UCITS ETF	0,25000

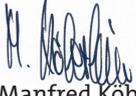
Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

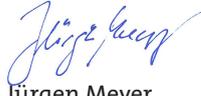
Köln, im August 2020

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Manfred Köberlein



Jürgen Meyer

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 30.06.2020)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

Ampega Asset Management GmbH (94,9 %)
Alstertor Erste Beteiligungs- und
Investitionssteuerungs-GmbH & Co. KG (5,1 %)

Aufsichtsrat

Harry Ploemacher, Vorsitzender
Vorsitzender der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Dr. Immo Querner, stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Norbert Eickermann
Mitglied des Vorstandes der HDI Vertriebs AG, Hannover

Prof. Dr. Alexander Kempf
Direktor des Seminars für Allgemeine BWL und
Finanzierungslehre, Köln

Dr. jur. Dr. rer. pol. Günter Scheipermeier
Rechtsanwalt, Köln

Geschäftsführung

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

Manfred Köberlein

Jürgen Meyer

Ralf Pohl (bis zum 31.01.2020)

Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers 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 Service AG (Rechnungswesen) und die HDI Systeme AG (IT-Dienstleistungen).

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