ampega.

Jahresbericht

Ampega CrossoverPlus Rentenfonds

1. Juli 2015 bis 30. Juni 2016

Anlagefonds
luxemburgischen Rechts



Inhaltsverzeichnis

Jahresbericht Ampega CrossoverPlus Rentenfonds für den Zeitraum vom 1. Juli 2015 bis 30. Juni 2016

Hinweise zu den Tätigkeiten der Gesellschaft	4
Hinweise zu den Anteilklassen des Sondervermögens	5
Anlageziele, Anlagegrundsätze und Anlagegrenzen	6
Auf einen Blick	7
Bericht des Fondsmanagements	8
Vermögensübersicht	11
Vermögensaufstellung	12
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	17
Marktschlüssel	20
Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	20
Überblick über die Anteilklassen	20
Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertrags- und Aufwandsausgleich)	21
Entwicklung des Sondervermögens	22
Vergleichende Übersicht	22
Sonstige Angaben	22
Angaben gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512	23
Angaben zum Bewertungsverfahren	23
Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote	24
Angaben zur Mitarbeitervergütung	24
Bericht des Réviseur d'Entreprises agréé	25
Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 InvStG - AK P (a)	26
Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 InvStG - AK I (a)	28
Bescheinigung über die steuerlichen Angaben - AK P (a)	30
Bescheinigung über die steuerlichen Angaben - AK I (a)	32
Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft	34
Angaben zum Sondervermögen	36
Angaben für Anleger aus Deutschland	37
Angaben für Anleger aus Österreich	37

Hinweise zu den Tätigkeiten der Gesellschaft

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

auf den nachfolgenden Seiten informieren wir Sie über die Entwicklung unseres Publikumsfonds **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** innerhalb des Geschäftsjahres vom 1. Juli 2015 bis 30. Juni 2016.

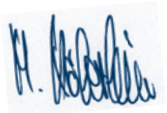
Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates, den Gesellschafterkreis sowie über das gezeichnete und eingezahlte Kapital finden Sie im Abschnitt „Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft".

Köln, im Juli 2016

Ampega Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Jörg Burger



Manfred Köberlein

Hinweise zu den Anteilklassen des Sondervermögens

Derzeit bietet die Gesellschaft für den **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** die Anteilklasse P (a) und die Anteilklasse I (a) an. Die Bildung von Anteilklassen mit unterschiedlichen Ausgestaltungsmerkmalen und Ausgabe entsprechender Anteile ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Anteile mit gleichen Ausgestaltungsmerkmalen bilden in diesem Fall jeweils eine Anteilklasse. Über die Einrichtung von unterschiedlichen Anteilklassen wird die Gesellschaft die Anleger auf ihrer Homepage **(www.ampega.de)** unterrichten.

Alle Anteile sind vom Tage ihrer Ausgabe in gleicher Weise an Erträgen, Kursgewinnen und am Liquidationserlös ihrer Anteilklasse berechtigt. Die Anteilklassen können sich hinsichtlich der Kostenstruktur im Hinblick auf die Verkaufsprovisionen, die Rücknahmeprovision und ggf. die Vertriebsstellenprovision, hinsichtlich der Kostenstruktur im Hinblick auf das Entgelt für die Kapitalverwaltungsgesellschaft, hinsichtlich der Regelungen über den Vertrieb und des Mindestzeichnungsbetrags oder der Mindesteinlage, hinsichtlich der Verwendung der Erträge, hinsichtlich der Währung, im Hinblick darauf, ob die Anteilklasse institutionellen Anlegern vorbehalten ist („institutionelle Anteilklasse“) oder für nicht-institutionelle Anleger („nicht-institutionelle Anteilklasse“) vorgesehen ist und hinsichtlich jedweder anderer Kriterien, die von der Kapitalverwaltungsgesellschaft bestimmt werden, unterscheiden.

Nähere Informationen und Einzelheiten insbesondere hinsichtlich der Anteilpreisberechnung bei der Bildung von unterschiedlichen Anteilklassen sind im Verkaufsprospekt beschrieben, den Sie kostenlos bei der Gesellschaft erhalten.

Anlageziele, Anlagegrundsätze und Anlagegrenzen

Das Hauptziel der Anlagepolitik des **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** besteht in der möglichst kontinuierlichen Wertsteigerung der eingebrachten Anlagemittel. Das Fondsvermögen wird dabei nach dem Grundsatz der Risikostreuung angelegt.

Die Anlagepolitik umfasst, entsprechend der detaillierten Beschreibung im Verkaufsprospekt, die Anlage in Renten und rentenähnlichen Wertpapieren einschließlich flüssiger Mittel. Die Auswahl der Werte für den **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** erfolgt mit der Zielsetzung, einen möglichst kontinuierlichen Wertzuwachs zu erzielen. Dabei wird der Fonds in Schuldtiteln von Unternehmen fest- oder variabel verzinslicher Natur, welche auf Euro lauten, investieren. Der Anlageschwerpunkt liegt auf Emittenten, die mit BB (BB+, BB, BB-) bewertet werden.

Der Fonds kann bis zu 100 % seines Netto-Fondsvermögens in flüssigen Mittel halten und in ähnlichen Vermögenswerten anlegen. Für das Fondsvermögen werden keine Anteile an anderen Investmentfonds erworben.

Zu Absicherungszwecken sowie zur effizienten Verwaltung des Portfolios oder zum Laufzeiten- oder Risikomanagement des Portfolios darf der Fonds derivative Finanzinstrumente und -techniken einsetzen. Weitere Informationen sind unter Artikel 4 das Allgemeinen Verwaltungsreglements im Verkaufsprospekt beschrieben. Diesen finden Sie auf unserer Homepage **www.ampega.de** oder erhalten ihn kostenlos bei der Gesellschaft.

Auf einen Blick (Stand 30.06.2016)

	Anteilklasse P (a)	Anteilklasse I (a)
ISIN:	LU0905727250	LU0905728654
Auflagedatum:	13.01.2014	13.01.2014
Währung:	Euro	Euro
Geschäftsjahr:	01.07. - 30.06.	01.07. - 30.06.
Ertragsverwendung:	Ausschüttung	Ausschüttung
Ausgabeaufschlag (derzeit):	3,00 %	0,00 %
Verwaltungsvergütung (p.a.):	0,90 %	0,40 %
Verwahrstellenvergütung (p.a.) zzgl. MwSt.:	0,10 %	0,10 %
Fondsvermögen per 30.06.2016:	31.847.636,80 EUR*	31.847.636,80 EUR*
Nettomittelaufkommen (01.07.2015 – 30.06.2016):	-5.477.538,28 EUR**	-5.477.538,28 EUR**
Anteilumlauf per 30.06.2016:	146.006 Stück	155.713 Stück
Anteilwert (= Rücknahmepreis) per 30.06.2016:	105,14 EUR	105,95 EUR
Wertentwicklung (im Berichtszeitraum):	+1,45 %	+1,96 %
TER (Total Expense Ratio) nach BVI-Methode:	1,25 %	0,74 %

** Das Fondsvermögen wird nicht nach Anteilklassen aufgeteilt.*

*** Das Nettomittelaufkommen wird nicht nach Anteilklassen aufgeteilt.*

Bericht des Fondsmanagements

Anlageziel

Der **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** ist ein aktiv gemanagter Rentenfonds mit Anlagefokus auf Finanz- und Unternehmensanleihen an der Qualitätsschwelle zwischen Investmentgrade und High Yield.

Anlageziel ist eine kontinuierliche, risikoadäquate Wertentwicklung. Um eine attraktive Ausschüttung zu ermöglichen, steht auch die Erwirtschaftung ausreichender ordentlicher Zinserträge im Fokus der Anlagepolitik. Dabei kommen die klassischen Kriterien Qualität, Liquidität und Diversifizierung zum Einsatz.

Anlagestrategie und Anlageergebnis

In seiner Anlagestrategie setzt der **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** auf eine ausgewogene Mischung von Finanz- und Industrieanleihen. Auch nachrangige Anleihen finden im Fondskonzept Beachtung. Festgelegt wird die Assetallokation über den Credit-Top-Down Analyseansatz der Ampega Investment GmbH.

Die Emittentenauswahl erfolgt aus dem von der Ampega Investment GmbH definierten Anlageuniversum für die jeweilige Assetklasse. Hierbei wird über den jeweiligen Bottom-Up-Investmentprozess mit quantitativer und qualitativer Analyse eine Einzeltitelselektion erreicht, die die jeweilige Rendite der Position ins Verhältnis zum Ausfallrisiko setzt. Dieser Prozess führt zu einer im Crossover-Segment konservativen Titelselektion, da die Erwartung einer risikoadäquaten Entlohnung keiner linearen, sondern einer exponentiellen Funktion folgt, und damit werden für höhere Risiken überproportional höhere Risikoaufschläge eingefordert. Der Fonds orientiert sich in der Steuerung des Zinsänderungsrisikos an den aus dem Durationsprozess[1] der Ampega Investment GmbH resultierenden Empfehlungen.

Im Berichtszeitraum wurden Anleihen aus den Assetklassen Industrie-, Banken- und Agency-Anleihen gekauft. Dabei wurde weiterhin auf eine hohe Diversifikation im Fonds geachtet. Zum Stichtag befanden sich 107 (VJ 116) Emittenten mit 129 (VJ 151) Anleihen im Bestand. Es wurde zudem auf eine gute Streuung hinsichtlich Länder und Sektoren geachtet. Wichtigste Bausteine dabei waren Industrieanleihen mit einer Gewichtung zum Stichtag von etwa 72 % (VJ 81 %) des Fondsvermögens, gefolgt von Bankanleihen mit etwa 21 % (VJ 17 %) des Fondsvermögens. Während des Berichtszeitraums wurden die Quoten an Industrials und Versorgern zugunsten von Konsumgütern und Finanztiteln reduziert. Schwerpunkt der Länderallokation lag mit knapp 14 % des Fondsvermögens in Frankreich sowie mit etwa je 13 % in Deutschland und den Niederlanden.

Der Anteilwert des **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** ist im laufenden Geschäftsjahr um +1,45 % in der Anteilklasse P (a) und +1,96 % in der Anteilklasse I (a) gestiegen. Die Volatilität lag im Berichtszeitraum bei 4,56 % in der Anteilklasse P (a) und bei 4,55 % in der Anteilklasse I (a).

Die Marktvolatilität in den letzten 12 Monaten war recht hoch. Im zweiten Halbjahr 2015 stieg die Risikoaversion wegen schwächeren Wachstums in China, einem massiven Rückgang des Ölpreises und Zinserhöhungssorgen in den USA deutlich an. Entsprechend erhöhten sich Spreads und Renditen deutlich und der Fonds verlor bis zum Jahresende an Wert. Bis Mitte Februar setzte sich diese Tendenz – einhergehend mit einem weiter fallenden Ölpreis – weiter fort. Schließlich sorgten Zusagen der OECD über eine Kürzung der Produktion für eine Stabilisierung der Lage. Anfang März überraschte dann die EZB (Europäische Zentralbank) mit der Verkündung eines Kaufprogramms für Unternehmensanleihen den Markt. Seitdem engten sich die Spreads bis Ende Juni deutlich ein und die Bonds, die von der EZB gekauft werden, erreichten neue Spread-Tiefstände. Für das erste Halbjahr 2016 konnte der Fonds daher einen Gewinn verzeichnen.

[1] *Die Duration ist ein Maß für die mittlere Laufzeit der Zahlungen eines Zinstitels/ Zinsportfolios und gleichzeitig ein Maß für die Reagibilität des Portfoliowertes auf Marktzinsänderungen. Je höher die Duration, umso stärker reagiert der Portfoliowert auf Änderungen der Marktzinssätze.*

Für das kommende Berichtsjahr erwartet das Fondsmanagement vorerst ein weiter niedriges Zinsumfeld und eine erhöhte Marktvolatilität. Aufgrund der breiten Diversifikation in Spreadprodukten sowie der aktiv gesteuerten Zinsbindungsdauer des Ampega CrossoverPlus Rentenfonds rechnet das Fondsmanagement mit einer positiven und stabilen Wertentwicklung des Fonds.

Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

Die wesentlichen Risiken des Renten-Sondervermögens sind Adressenausfall-, Zinsänderungs- und Spreadrisiken. In Abhängigkeit von der Marktsituation kann das Sondervermögen zusätzlich Liquiditätsrisiken ausgesetzt sein.

1. Marktpreisrisiken

Währungsrisiken

Der **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** investiert derzeit ausschließlich in Euro-Anleihen. Daher ist das Sondervermögen keinen nennenswerten Währungsrisiken ausgesetzt.

Zinsänderungsrisiken

Über die Anlage in Anleihen und Credit-Default-Swaps ist das Sondervermögen Kursschwankungen durch Veränderungen der Kapitalmarktzinsen sowie Schwankungen der Risikoaufschläge einzelner Anleihen ausgesetzt. Veränderungen der Risikoaufschläge (Spreads) stellen bei Anleihen schwächerer Bonität in der Regel ein deutlich höheres Kursrisiko für den Fonds dar als die Veränderung der Kapitalmarktzinsen. Das Sondervermögen war im Berichtszeitraum, entsprechend seiner Anlagepolitik, in Anleihen von Emittenten aus unterschiedlichen Ländern und Sektoren diversifiziert. Diese Vorgehensweise dient der Steuerung und Reduzierung der Spreadrisiken. Das Marktzinsrisiko wird durch eine aktive Durationspositionierung anhand des Ampega-Durationsprozesses gesteuert. Das Zinsänderungsrisiko im **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** entspricht zum Berichtsstichtag einer mittleren Duration von circa 5 Jahren.

2. Adressenausfallrisiken

Adressenausfallrisiken resultieren aus dem möglichen Ausfall von Zins- und Tilgungszahlungen der Einzelinvestments in Renten. Um Konzentrationsrisiken zu verringern, werden diese so weit wie möglich diversifiziert. Dies betrifft nicht nur die Auswahl der Schuldner, sondern auch die Auswahl der Sektoren und Länder. Zum Berichtsjahresende am 30. Juni 2016 hatten die im Fonds enthaltenen Rententitel ein Durchschnittsrating von BB+. Weitere Risiken ergeben sich durch die Anlage liquider Mittel bei Banken, die jedoch einem staatlich oder privatwirtschaftlich organisierten Einlagensicherungsmechanismus unterliegen.

3. Liquiditätsrisiken

Aufgrund der Anlagepolitik ist das Sondervermögen den Rentenmärkten inhärenten Liquiditätsrisiken ausgesetzt. Um diese Liquiditätsrisiken zu begrenzen, achtet das Fondsmanagement auf ein ausreichendes Emissionsvolumen der einzelnen Anleihen sowie auf Ebene des Sondervermögens auf eine ausreichende Diversifikation. Zum Berichtszeitpunkt liegen keine Indikationen über eine begrenzte Liquidität vor. Dennoch kann aufgrund des Anlagefokus in Unternehmensanleihen, die nicht über ein Investment-Grade Rating verfügen, eine Verschlechterung der Liquiditätssituation des Sondervermögens in Marktkrisen nicht vollständig ausgeschlossen werden.

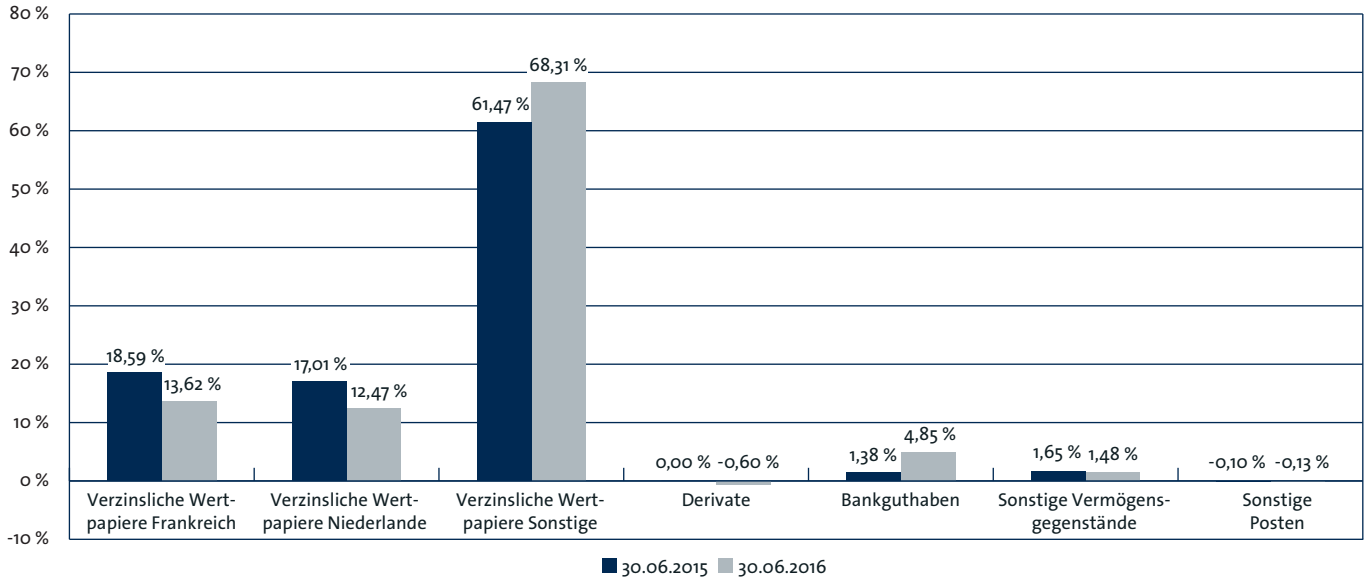
4. Operationelle Risiken

Für die Überwachung und Steuerung der operationellen Risiken des Sondervermögens sind entsprechende Maßnahmen getroffen worden.

Wesentliche Grundlagen des realisierten Ergebnisses

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren im Wesentlichen aus der Veräußerung von festverzinslichen Wertpapieren.

Struktur des Sondervermögens



Ampega Investment GmbH, Köln
Die Geschäftsführung

Jörg Burger

Manfred Köberlein

Jahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.06.2016

	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	**30.062.813,38**	**94,40**
Australien	261.937,50	0,82
Belgien	726.647,00	2,28
Brasilien	196.793,00	0,62
Deutschland	4.175.653,13	13,11
Dänemark	328.312,50	1,03
Finnland	299.250,00	0,94
Frankreich	4.338.747,00	13,62
Großbritannien	2.635.979,25	8,28
Guernsey	146.579,25	0,46
Indien	313.950,00	0,99
Irland	502.564,50	1,58
Italien	2.934.025,25	9,21
Japan	532.937,50	1,67
Jersey	569.811,25	1,79
Kaimaninseln	944.413,25	2,97
Luxemburg	2.783.343,75	8,74
Mexiko	336.652,50	1,06
Niederlande	3.971.249,75	12,47
Portugal	198.875,00	0,62
Schweden	808.562,75	2,54
Spanien	505.041,00	1,59
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	1.765.550,75	5,54
Österreich	785.937,50	2,47
Derivate	**-189.845,00**	**-0,60**
Kreditderivate	-189.845,00	-0,60
Bankguthaben	**1.546.021,70**	**4,85**
Sonstige Vermögensgegenstände	**469.817,59**	**1,48**
Verbindlichkeiten	**-41.170,87**	**-0,13**
Fondsvermögen	**31.847.636,80**	**100,00** [1]

[1] *Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.*

Vermögensaufstellung zum 30.06.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							**EUR**		**28.288.656,38**	**88,82**
Verzinsliche Wertpapiere										
0,2500 % Bundesobligation S.172 2015/2020	DE0001141729		EUR 700	700	0		%	103,7415	726.190,50	2,28
1,0000 % Distribuidora Internacional de Alimentacion MC 2016/2021	XS1400342587		EUR 200	200	0		%	100,9035	201.807,00	0,63
1,2500 % Credit Suisse Group Funding MTN 2015/2022	XS1218287230		EUR 150	0	0		%	97,7195	146.579,25	0,46
1,2500 % CK Hutchison Finance 16 2016/2023	XS1391085740		EUR 300	300	0		%	100,3715	301.114,50	0,95
1,2500 % FCA Capital Ireland MTN 2016/2021	XS1435295925		EUR 100	100	0		%	100,3655	100.365,50	0,32
1,3750 % Tesco Corporate Treasury Services MTN 2014/2019	XS1082970853		EUR 150	0	0		%	98,7500	148.125,00	0,47
1,3750 % FCA Capital Ireland MTN 2015/2020	XS1220057472		EUR 100	0	0		%	100,8865	100.886,50	0,32
1,5000 % Mondi Finance MTN MC 2016/2024	XS1395010397		EUR 200	200	0		%	102,8355	205.671,00	0,65
1,5000 % Kraft Heinz Foods MC 2016/2024	XS1405782407		EUR 100	200	100		%	103,4860	103.486,00	0,32
1,6250 % Solvay MC 2015/2022	BE6282459609		EUR 100	100	0		%	105,6470	105.647,00	0,33
1,7500 % UBS Group Funding Jersey 2015/2022	CH0302790123		EUR 200	200	0		%	104,3275	208.655,00	0,66
1,7500 % A2A SpA MTN MC 2015/2025	XS1195347478		EUR 100	200	200		%	106,4825	106.482,50	0,33
1,7500 % NASDAQ MC 2016/2023	XS1418630023		EUR 100	300	200		%	102,9495	102.949,50	0,32
1,8750 % LYB International Finance II MC 2016/2022	XS1373987707		EUR 150	300	150		%	104,7715	157.157,25	0,49
2,0000 % EDP Finance MTN 2015/2025	XS1222590488		EUR 100	0	0		%	98,6875	98.687,50	0,31
2,1250 % ITV MC -rating sensitive- 2015/2022	XS1292425664		EUR 150	300	150		%	103,1000	154.650,00	0,49
2,1250 % Exor MC 2015/2022	XS1329671132		EUR 100	100	0		%	105,5180	105.518,00	0,33
2,1250 % Buzzi Unicem MC 2016/2023	XS1401125346		EUR 150	150	0		%	99,6250	149.437,50	0,47
2,1250 % Trinity Acquisitions MC 2016/2022	XS1418774706		EUR 200	200	0		%	100,3645	200.729,00	0,63
2,1250 % Stora Enso MTN MC 2016/2023	XS1432392170		EUR 300	300	0		%	99,7500	299.250,00	0,94
2,1500 % Priceline Group MC 2015/2022	XS1325825211		EUR 150	150	0		%	105,5370	158.305,50	0,50
2,2410 % Allianz fix-to-float (sub.) 2015/2045	DE000A14J9N8		EUR 200	0	0		%	93,4880	186.976,00	0,59
2,2500 % Total MTN PERP Multi Reset Note (subord.) 2015/2099	XS1195201931		EUR 300	500	200		%	96,7515	290.254,50	0,91
2,2500 % DS Smith MTN MC 2015/2022	XS1291448824		EUR 300	600	300		%	103,7300	311.190,00	0,98
2,2500 % HeidelbergCement MTN MC 2016/2023	XS1387174375		EUR 100	200	100		%	102,0000	102.000,00	0,32
2,3750 % Barry Callebaut Services 2016/2024	BE6286963051		EUR 300	300	0		%	100,6875	302.062,50	0,95
2,3750 % Bayer PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2075	DE000A14J611		EUR 200	0	100		%	95,1085	190.217,00	0,60
2,3750 % Peugeot MTN 2016/2023	FR0013153707		EUR 300	300	0		%	102,0000	306.000,00	0,96
2,5000 % Suez PERP Multi Reset Note (subord.) 2015/2099	FR0012648590		EUR 200	0	100		%	100,6390	201.278,00	0,63
2,5000 % Orlen Capital 2014/2021	XS1082660744		EUR 200	0	200		%	102,5020	205.004,00	0,64
2,5000 % Expedia MC 2015/2022	XS1117297512		EUR 200	0	200		%	102,9245	205.849,00	0,65
2,5000 % Exor 2014/2024	XS1119021357		EUR 200	0	0		%	105,4240	210.848,00	0,66
2,5000 % Orlen Capital 2016/2023	XS1429673327		EUR 250	250	0		%	100,6610	251.652,50	0,79
2,6000 % ELM (Swiss Re) PERP fix-to-float (sub.) 2015/2099	XS1209031019		EUR 250	0	0		%	91,3590	228.397,50	0,72
2,6250 % Societe Generale MTN (subord.) 2015/2025	XS1195574881		EUR 200	0	0		%	99,6760	199.352,00	0,63

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
2,6250 % Barclays Bank MTN fix-to-float (subordinated) 2015/2025	XS1319647068	EUR	300	300	0	%	94,0000	282.000,00	0,89
2,7500 % ZF North America Capital 2015/2023	DE000A14J7G6	EUR	500	0	0	%	102,7500	513.750,00	1,61
2,7500 % BPCE fix-to-float (sub.) 2015/2027	FR0013063385	EUR	300	300	0	%	101,1750	303.525,00	0,95
2,7500 % ONGC Videsh 2014/2021	XS1084958989	EUR	300	0	0	%	104,6500	313.950,00	0,99
2,7500 % Smurfit Kappa Acquisitions 2015/2025	XS1117298759	EUR	300	0	0	%	100,4375	301.312,50	0,95
2,7500 % RWE PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2075	XS1219498141	EUR	300	200	100	%	86,1250	258.375,00	0,81
2,7500 % Banco Popolare MTN 2015/2020	XS1266866927	EUR	200	200	0	%	100,7500	201.500,00	0,63
2,7500 % BNP Paribas MTN (subord.) 2015/2026	XS1325645825	EUR	100	100	0	%	100,5185	100.518,50	0,32
2,7980 % Casino Guichard-Perrachon MTN -single callable- 2014/2026	FR0012074284	EUR	200	0	0	%	102,6250	205.250,00	0,64
2,8750 % CNH Industrial Finance Europe MTN 2016/2023	XS1412424662	EUR	250	250	0	%	99,8750	249.687,50	0,78
3,0000 % ArcelorMittal MTN 2015/2021	XS1214673722	EUR	100	0	0	%	97,5000	97.500,00	0,31
3,0000 % Bertelsmann PERP Multi Reset Notes (sub.) 2015/2075	XS1222591023	EUR	300	0	0	%	98,5090	295.527,00	0,93
3,2500 % Celanese US Holdings 2014/2019	XS1110862148	EUR	300	400	100	%	105,6875	317.062,50	1,00
3,3750 % Sappi Papier Holding MC 2015/2022	XS1117298676	EUR	400	0	150	%	100,8750	403.500,00	1,27
3,3750 % Gas Natural Fenosa Fin PERP Multi-reset (sub.) 2015/2049	XS1224710399	EUR	300	0	0	%	89,2500	267.750,00	0,84
3,5000 % BBVA Subord. Cap. fix-to-float (subordinated) 2014/2024	XS1055241373	EUR	100	0	0	%	101,9700	101.970,00	0,32
3,5000 % Schaeffler Finance MC 2014/2022	XS1067864022	EUR	300	0	0	%	102,2500	306.750,00	0,96
3,5000 % Gestamp Funding Luxembourg MC 2016/2023	XS1409497283	EUR	300	300	0	%	102,2500	306.750,00	0,96
3,6250 % EnBW MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2076	XS1044811591	EUR	350	0	0	%	96,5105	337.786,75	1,06
3,6250 % Royal Bank of Scotland fix-to-float (subordinated) 2014/2024	XS1049037200	EUR	300	0	0	%	97,5625	292.687,50	0,92
3,6250 % Phoenix PIB Dutch Finance MTN 2014/2021	XS1091770161	EUR	300	300	100	%	109,5625	328.687,50	1,03
3,6250 % TA Manufacturing MC 2015/2023	XS1212668062	EUR	250	250	0	%	94,3125	235.781,25	0,74
3,6250 % LB Baden-Württ. MTN (subordinated) 2015/2025	XS1246732249	EUR	250	0	0	%	105,8855	264.713,75	0,83
3,7500 % Hutchison Whampoa Europ.Fin.13 Multi-R. Nts.(sub.) 2013/2099	XS0930010524	EUR	250	0	0	%	102,5195	256.298,75	0,80
3,7500 % Ziggo Secured Finance MC 2015/2025	XS1175813655	EUR	300	300	450	%	97,7500	293.250,00	0,92
3,8750 % AXA PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2099	XS1069439740	EUR	100	0	0	%	98,3485	98.348,50	0,31
3,8750 % LKQ Italia Bondco MC 2016/2024	XS1395004408	EUR	300	300	0	%	103,3125	309.937,50	0,97
3,9280 % Intesa Sanpaolo MTN (subordinated) 2014/2026	XS1109765005	EUR	200	0	0	%	101,0625	202.125,00	0,63
3,9410 % AXA PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2099	XS1134541306	EUR	250	0	0	%	98,7135	246.783,75	0,77
4,0000 % CNP Assurances PERP fix-to-float (subord.) 2014/2099	FR0012317758	EUR	300	0	0	%	93,0495	279.148,50	0,88
4,0000 % Societe Generale MTN (subordinated) 2013/2023	XS0867612466	EUR	200	0	0	%	111,1680	222.336,00	0,70

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
4,0000 % Standard Chart. Bk fix-to-float s. callable (sub.) 2013/2025	XS0983704718	EUR	100	0	0	%		97,9580	97.958,00	0,31
4,0000 % Aegon MTN fix-to-float (subord.) 2014/2044	XS1061711575	EUR	200	0	0	%		91,3755	182.751,00	0,57
4,0000 % Wind Aquisition Finance MC 2014/2020	XS1082636876	EUR	450	0	0	%		99,0625	445.781,25	1,40
4,0000 % Origin Energy Finance Multi Reset Notes (subord.) 2014/2074	XS1109795176	EUR	300	0	0	%		87,3125	261.937,50	0,82
4,0000 % Orange PERP Multi Reset Note (subord.) 2014/2099	XS1115490523	EUR	200	0	100	%		103,9345	207.869,00	0,65
4,0000 % Ineos Finance MC 2015/2023	XS1117296209	EUR	300	0	0	%		96,0625	288.187,50	0,90
4,0000 % UPCB Finance IV MC 2015/2027	XS1117297603	EUR	400	0	0	%		96,7500	387.000,00	1,22
4,0000 % Softbank Group MC 2015/2022	XS1266662763	EUR	350	350	0	%		106,0625	371.218,75	1,17
4,1250 % Electricite de France PERP Multi Reset Note (sub.) 2014/2099	FR0011697010	EUR	200	0	0	%		94,6065	189.213,00	0,59
4,1250 % International Game Technology MC 2015/2020	XS1204431867	EUR	400	0	0	%		104,7500	419.000,00	1,32
4,2000 % Volvo Treasury MTN PERP Multi Reset Notes (sub.) 2014/2075	XS1150673892	EUR	250	0	0	%		100,5625	251.406,25	0,79
4,2500 % Aareal Bank MTN fix-to-float (subord.) 2014/2026	DE000A1TNC94	EUR	350	0	0	%		102,4430	358.550,50	1,13
4,4500 % Veolia Environnement PERP Multi Reset N. (subord.) 2013/2099	FR0011391820	EUR	200	0	200	%		105,0000	210.000,00	0,66
4,5000 % Banco Bilbao Vizc. fix-to-float (subordinated) 2007/2022	ES0213211107	EUR	200	0	0	%		100,6320	201.264,00	0,63
4,5000 % Dufry Finance MTN MC 2014/2022	XS1087753353	EUR	100	0	300	%		104,6875	104.687,50	0,33
4,5000 % Repsol Int. Finance PERP Multi Reset Notes (sub.) 2015/2075	XS1207058733	EUR	350	0	0	%		84,7500	296.625,00	0,93
4,5000 % Dufry Finance MC 2015/2023	XS1266592457	EUR	300	300	0	%		104,5625	313.687,50	0,98
4,6250 % SES PERP Multi-reset Notes (sub.) 2016/2099	XS1405777746	EUR	300	300	0	%		99,3750	298.125,00	0,94
4,7500 % Allianz MTN PERP fix-to-float (sub.) 2013/2099	DE000A1YCQ29	EUR	100	0	0	%		106,9925	106.992,50	0,34
4,7500 % Arkema PERP Multi Reset Notes (subordinated) 2014/2099	FR0012278539	EUR	200	0	0	%		103,6250	207.250,00	0,65
4,7500 % Grupo Antolin Dutch MC 2014/2021	XS1046537665	EUR	400	0	100	%		103,5625	414.250,00	1,30
4,7500 % Fiat Finance & Trade MTN 2014/2022	XS1088515207	EUR	200	0	0	%		107,4375	214.875,00	0,67
4,7500 % Darling Global Finance MC 2015/2022	XS1240984754	EUR	300	100	0	%		101,3125	303.937,50	0,95
4,7500 % Softbank Group MC 2015/2025	XS1266662334	EUR	150	150	0	%		107,8125	161.718,75	0,51
4,8500 % Volvo Treasury MTN PERP Multi Reset Notes (sub.) 2014/2078	XS1150695192	EUR	100	0	0	%		100,5000	100.500,00	0,32
4,8700 % Casino Guichard-Perr. PERP Multi Reset Note (sub.) 2013/2099	FR0011606169	EUR	200	0	0	%		92,2500	184.500,00	0,58
5,0000 % Deutsche Bank MTN (subordinated) 2010/2020	DE000DB5DCW6	EUR	100	100	0	%		105,5000	105.500,00	0,33
5,1180 % Solvay Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2015/2099	XS1323897485	EUR	200	200	0	%		103,1875	206.375,00	0,65
5,1250 % Volkswagen Int. Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2013/2099	XS0968913342	EUR	300	0	0	%		107,2865	321.859,50	1,01
5,1500 % Intesa Sanpaolo (subordinated) 2010/2020	XS0526326334	EUR	250	0	0	%		109,8750	274.687,50	0,86
5,2500 % Telecom Italia 2010/2022	XS0486101024	EUR	250	200	0	%		116,6875	291.718,75	0,92

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
5,2500 % Cemex Finance MC 2014/2021	XS1028960174		EUR	150	150	0	%	102,6875	154.031,25	0,48
5,3750 % Electricite de France PERP Multi Reset Nts. (sub.) 2013/2099	FR0011401751		EUR	100	200	100	%	99,0890	99.089,00	0,31
5,3750 % Energias de Portugal PERP Multi Reset N. (subord.) 2015/2075	PTEDPUOM0024		EUR	200	200	0	%	99,4375	198.875,00	0,62
5,3750 % Voith AG 2007/2017	XS0306488627		EUR	300	300	0	%	104,6250	313.875,00	0,99
5,3750 % Numericable MC 2014/2022	XS1028956222		EUR	300	0	0	%	101,4375	304.312,50	0,96
5,5000 % Unitymedia Hessen GmbH&Co.KG/U. NRW GmbH MC 2012/2022	XS0827991760		EUR	100	100	0	%	85,5056	85.505,63	0,27
5,5000 % Assicurazioni Generali MC fix to float (sub.) 2015/2047	XS1311440082		EUR	300	300	0	%	103,4235	310.270,50	0,97
5,6250 % Telekom Austria PERP Multi Reset-Note (subord.) 2013/2099	XS0877720986		EUR	250	0	0	%	104,8750	262.187,50	0,82
5,6250 % Numericable MC 2014/2024	XS1028956149		EUR	100	0	0	%	100,8125	100.812,50	0,32
5,8750 % ArcelorMittal MTN 2010/2017	XS0559641146		EUR	200	100	0	%	106,4375	212.875,00	0,67
6,0000 % Avis Budget Finance MC 2013/2021	XS0898656037		EUR	350	0	100	%	103,1875	361.156,25	1,13
6,1250 % Koninklijke KPN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2013/2099	XS0903872355		EUR	200	0	0	%	106,5625	213.125,00	0,67
6,2500 % Münchener Rückvers. fix-to-float (Nachrang) 2012/2042	XS0764278528		EUR	200	0	0	%	120,5780	241.156,00	0,76
6,2500 % Telenet Finance V MC 2012/2022	XS0783935488		EUR	200	0	0	%	107,2500	214.500,00	0,67
6,2500 % DONG Energy PERP Multi Reset Notes (subord.) 2013/2099	XS0943370543		EUR	300	0	0	%	109,4375	328.312,50	1,03
6,3750 % America Movil PERP Multi Reset Notes (subord.) 2013/2073	XS0969341147		EUR	300	0	100	%	112,2175	336.652,50	1,06
6,5000 % Enel PERP Multi Reset Note (subord.) 2013/2074	XS0954675129		EUR	400	0	0	%	108,1250	432.500,00	1,36
6,6250 % Italcementi Finance MTN 2010/2020	XS0496716282		EUR	150	0	200	%	117,6875	176.531,25	0,55
6,6250 % Fiat Finance & Trade MTN 2013/2018	XS0906420574		EUR	200	0	0	%	107,3125	214.625,00	0,67
6,9500 % Unicredit MTN (subord.) 2012/2022	XS0849517650		EUR	300	0	0	%	113,0000	339.000,00	1,06
7,1250 % Erste Group Bank MTN (subord.) 2012/2022	XS0840062979		EUR	100	0	0	%	120,2500	120.250,00	0,38
7,6250 % Telefonica Europe PERP Multi-reset Notes (sub.) 2013/2099	XS0972588643		EUR	200	0	0	%	111,1250	222.250,00	0,70
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**EUR**		**1.774.157,00**	**5,57**
Verzinsliche Wertpapiere										
2,3750 % Priceline Group -single callable- 2014/2024	XS1112850125		EUR	200	200	0	%	105,0585	210.117,00	0,66
2,5000 % Rabobank Nederland fix-to-float (sub.) 2014/2026	XS1069772082		EUR	100	0	0	%	101,6470	101.647,00	0,32
2,7500 % BRF 2015/2022	XS1242327168		EUR	200	0	100	%	98,3965	196.793,00	0,62
3,7500 % WEPA Hygieneprodukte MC 2016/2024	DE000A2AA0W5		EUR	300	300	0	%	102,0625	306.187,50	0,96
4,7500 % Ontex Group MC 2014/2021	BE6272861657		EUR	300	100	300	%	106,3125	318.937,50	1,00
5,6250 % Unitymedia Hessen GmbH&Co.KG/U. NRW GmbH MC 2013/2023	XS0918739318		EUR	350	0	0	%	84,6000	296.100,00	0,93
6,7500 % OI European Group 2010/2020	XS0542593792		EUR	200	100	0	%	117,0625	234.125,00	0,74
6,7500 % Telenet Finance V MC 2012/2024	XS0783935306		EUR	100	0	0	%	110,2500	110.250,00	0,35
Summe Wertpapiervermögen									**30.062.813,38**	**94,40**

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							**EUR**			
Swaps							**EUR**		**-189.845,00**	**-0,60**
Credit Default Swaps										
Protection Seller										
Anglo American Capital / 100 BP (JPM) 6.8.15-20.9.20		OTC	EUR	-500					-60.964,00	-0,19
Glencore Finance Europe MTN / 100 BP (Credit Suisse) 5.8.15-20.9.20		OTC	EUR	-500					-49.099,00	-0,15
Protection Buyer										
iTraxx Europe Crossover Index S.25 -5 Jahre- / 500 BP (BACR) 23.6.16-20.6.21		OTC	EUR	1.500					-79.782,00	-0,25
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							**EUR**		**1.546.021,70**	**4,85**
Bankguthaben							**EUR**		**1.546.021,70**	**4,85**
EUR - Guthaben bei										
Verwahrstelle			EUR	1.546.021,70			EUR		1.546.021,70	4,85
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**		**469.817,59**	**1,48**
Zinsansprüche			EUR						461.843,88	1,45
Ansprüche aus Credit Default Swaps			EUR						305,56	0,00
Aktivierte Gründungskosten			EUR						7.668,15	0,02
Summe der Vermögenswerte							**EUR**		**31.888.807,67**	**100,13**
Sonstige Verbindlichkeiten [1]							**EUR**		**-41.170,87**	**-0,13**
Fondsvermögen							**EUR**		**31.847.636,80**	**100,00** [2]
Anteilwert Klasse P (a)							**EUR**		**105,14**	
Anteilwert Klasse I (a)							**EUR**		**105,95**	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)							**STK**		**146.006**	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)							**STK**		**155.713**	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)							**EUR**		**15.350.501,91**	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)							**EUR**		**16.497.134,89**	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)										**94,40**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										**-0,60**

[1] *Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Veröffentlichungskosten, Verbindlichkeiten aus Credit-Default-Swaps, Taxe d'Abo und Verwahrstellenvergütung*

[2] *Durch Rundung der Prozentanteile können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.*

Während des Berichtszeitraumes 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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,7500 % ENI MTN 2016/2022	XS1412593185	EUR	150	150
0,8750 % Terna MTN 2015/2022	XS1178105851	EUR	0	300
1,2500 % Bank of Ireland MTN 2015/2020	XS1198677897	EUR	0	300
1,3750 % Westpac Banking MTN (covered) 2013/2020	XS0918557124	EUR	1.000	1.000
1,5280 % FCE Bank MTN 2015/2020	XS1317725726	EUR	200	200
1,7500 % Glencore Finance Europe MTN MC 2015/2025	XS1202849086	EUR	0	300
1,7500 % Molnlycke Holding 2015/2024	XS1317732771	EUR	200	200
1,7500 % ThyssenKrupp MTN MC 2015/2020	DE000A14J579	EUR	0	100
1,8750 % Adif Alta Velocidad MTN 2015/2025	ES0200002006	EUR	0	200
1,8750 % CRH Funding MTN MC 2015/2024	XS1328173080	EUR	200	200
1,8750 % Manpowergroup MC 2015/2022	XS1289193176	EUR	300	300
1,8750 % Petroleos Mexicanos MTN 2015/2022	XS1172947902	EUR	0	300
2,0000 % FCA Capital Ireland MTN 2014/2019	XS1111858756	EUR	0	100
2,1250 % ISS Global MTN MC 2014/2024	XS1145526825	EUR	0	200
2,3750 % Accor 2015/2023	FR0012949949	EUR	100	100
2,5000 % Skand. Enskilda MTN fix-to-float (subord.) 2014/2026	XS1072796870	EUR	0	100
2,5000 % ThyssenKrupp MTN 2015/2025	DE000A14J587	EUR	0	100
2,6250 % EDP Finance MTN 2014/2022	XS1111324700	EUR	0	400
2,6250 % Merck PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2074	XS1152338072	EUR	0	200
2,6250 % Total MTN PERP Multi Reset Note (subord.) 2015/2099	XS1195202822	EUR	0	500
2,7500 % Danske Bank fix-to-float (subord.) 2014/2026	XS1068866950	EUR	0	100
2,7500 % Merlin Entertainments MC 2015/2022	XS1204272709	EUR	0	450
2,7500 % Petrobras Global Finance 2014/2018	XS0982711631	EUR	0	200
2,8750 % CNH Industrial Finance Europe MTN 2014/2021	XS1114452060	EUR	0	150
3,0000 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN (subordinated) 2014/2024	XS1069549761	EUR	0	100
3,0000 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN (subordinated) 2015/2025	XS1288858548	EUR	100	100
3,0000 % Centrica PERP Multi Reset Notes (sub.) 2015/2076	XS1216020161	EUR	0	500
3,0000 % DONG Energy PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1227607402	EUR	0	200
3,0000 % Engie PERP Multi Reset Note (subord.) 2014/2099	FR0011942226	EUR	0	200
3,1250 % ArcelorMittal MTN 2015/2022	XS1167308128	EUR	0	100
3,1250 % CRH Finance Ltd. MTN 2013/2023	XS0909369489	EUR	0	200
3,1250 % Phoenix PIB Finance MTN 2013/2020	XS0935786789	EUR	0	250
3,1250 % ThyssenKrupp MTN -single callable- 2014/2019	DE000A1R0410	EUR	0	100
3,3750 % Bharti Airtel International Netherlands 2014/2021	XS1028954953	EUR	0	200
3,5000 % Ball 2015/2020	XS1330978211	EUR	300	300
3,5000 % TDC PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1195581159	EUR	0	200
3,6250 % Bouygues 2012/2023	FR0011332196	EUR	0	100
3,7500 % Bayer PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2074	DE000A11QR73	EUR	0	100

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
3,7500 % Glencore Finance Europe MTN -single callable- 2014/2026	XS1050842423	EUR	0	100
3,7500 % Petroleos Mexicanos 2014/2026	XS1057659838	EUR	0	100
4,0000 % Unitymedia Hessen GmbH&Co.KG/U. NRW GmbH MC 2014/2025	XS1150437579	EUR	0	100
4,1250 % Accor PERP Multi Reset Note (subord.) 2014/2099	FR0012005924	EUR	0	200
4,1250 % Nationwide Build. fix-to-float s. callable (sub.) 2013/2023	XS0906394043	EUR	0	100
4,1250 % Smurfit Kappa Acquisitions 2013/2020	XS0880132989	EUR	0	100
4,1990 % Solvay Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2013/2099	XS0992293570	EUR	0	200
4,2000 % Telefonica Europe PERP Multi-reset Notes (sub.) 2014/2099	XS1148359356	EUR	0	300
4,2500 % Electricite de France PERP Multi Reset (sub.) 2013/2099	FR0011401736	EUR	100	200
4,2500 % Orange PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2099	XS1028600473	EUR	0	200
4,5000 % Finmeccanica MTN 2013/2021	XS0999654873	EUR	0	450
4,5000 % Novafives MC 2014/2021	XS1028950886	EUR	0	400
4,5960 % Generali Finance PERP fix-to-float (subordinated) 2014/2099	XS1140860534	EUR	0	200
4,6250 % Portugal Telecom International Finance MTN 2013/2020	XS0927581842	EUR	0	200
4,6250 % Softbank Group 2013/2020	XS0918548644	EUR	0	450
4,6250 % Volkswagen Int. Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2014/2099	XS1048428442	EUR	0	200
4,7300 % BNP Paribas PERP fix-to-float (subordinated) 2006/2016	FR0010306738	EUR	0	200
4,7500 % BHP Billiton Finance PERP Multi Reset Note (sub.) 2015/2076	XS1309436753	EUR	300	300
4,8750 % OI European Group 2013/2021	XS0908230781	EUR	0	300
5,1250 % Rexel MC 2013/2020	XS0908821639	EUR	0	200
5,2500 % FMC Finance VII 2011/2021	XS0576395478	EUR	0	480
5,3750 % Lafarge MTN 2010/2018	XS0562783034	EUR	0	100
5,4250 % Solvay Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2013/2099	XS0992293901	EUR	0	100
5,5000 % Lafarge MTN 2009/2019	XS0473114543	EUR	150	350
5,5000 % Stora Enso MTN 2012/2019	XS0754290459	EUR	0	100
5,6250 % Barry Callebaut Services 2011/2021	BE6222320614	EUR	0	200
5,6250 % Oi Brasil Holding Cooperatief 2015/2021	XS1245244402	EUR	300	300
5,6500 % Portugal 2013/2024	PTOTEQOE0015	EUR	0	140
5,8750 % Gestamp Funding Luxembourg MC 2013/2016	XS0925126491	EUR	0	550
5,8750 % Port.Telecom Int. Fin. MTN 2012/2018	XS0843939918	EUR	100	100
6,0000 % GIE PSA Tresorerie 2003/2033	FR0010014845	EUR	0	380
6,1250 % Bombardier MTN 2010/2021	XS0552915943	EUR	0	100
6,5000 % BG Energy Capital PERP Multi Reset Notes (sub.) 2012/2072	XS0796069283	EUR	0	300
6,6250 % Barclays Bank MTN (subordinated) 2011/2022	XS0611398008	EUR	0	200
6,7500 % Kion Finance MC 2013/2016	XS0889217716	EUR	0	300
6,7500 % Nationwide Building Society MTN (sub.) 2010/2020	XS0527239221	EUR	0	100
6,7500 % Rexam PERP fix-to-float (subordinated) 2007/2067	XS0307868744	EUR	0	150
7,5000 % HeidelbergCement Fin. 2010/2020	XS0478803355	EUR	0	350
7,7500 % Telecom Italia Fin. MTN 2003/2033	XS0161100515	EUR	0	330
7,8750 % Stena AB 2010/2020	XS0495219874	EUR	0	230
10,1250 % Assicurazioni Generali MC fix to float (sub.) 2012/2042	XS0802638642	EUR	0	100

>>

>> Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
3,2500 % Rexel MC 2015/2022	XS1238996018	EUR	0	100
4,7500 % Petrobras Global Finance 2014/2025	XS0982711714	EUR	0	100

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whrg. in 1.000	Volumen in 1.000
Derivate		
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)		
Swaps		
Credit Default Swaps		
Protection Buyer	**EUR**	**11.000**
(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Index S.23 -5 Jahre- / 500 BP (JPM) 24.8.15-20.6.20, iTraxx Europe Crossover Index S.24 -5 Jahre- / 500 BP (JPM) 10.3.16-20.12.20, iTraxx Europe Crossover Index S.24 -5 Jahre- / 500 BP (JPM) 1.10.15-20.12.20)		

Marktschlüssel

OTC	Over-the-Counter

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/ Marktsätze bewertet:	
In- und ausländische verzinsliche Wertpapiere	per 29.06.2016
Alle anderen Vermögenswerte	per 29.06.2016

Überblick über die Anteilklassen

Stand 30.06.2016

	Anteilklasse P (a)	Anteilklasse I (a)
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Zielgruppe	Privatanleger	Institutionelle
Ausgabeaufschlag (v.H.)	3,00	-
Verwaltungsvergütung (v.H. p.a.)	0,90	0,40
Mindestanlage (EUR)	-	250.000,00
Erfolgsabhängige Vergütung (v.H. p.a.)	-	-
Verwahrstellenvergütung (v.H. p.a.)	0,10	0,10
Taxe d'Abonnement (v.H. p.a.)	0,05	0,05

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertrags- und Aufwandsausgleich)

für den Zeitraum vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

	Anteilklasse P (a)	Anteilklasse I (a)	Gesamt
	EUR	EUR	EUR
I. Erträge			
1. Zinsen aus Wertpapieren	568.840,90	610.018,45	1.178.859,35
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen	-652,63	-700,53	-1.353,16
3. Abzug ausländischer Quellensteuer	-4.852,84	-5.196,74	-10.049,58
Summe der Erträge	**563.335,43**	**604.121,18**	**1.167.456,61**
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	-22,12	-23,77	-45,89
2. Verwaltungsvergütung	-137.188,06	-66.223,16	-203.411,22
3. Verwahrstellenvergütung	-17.712,04	-18.993,66	-36.705,70
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-21.210,77	-22.616,85	-43.827,62
5. Sonstige Aufwendungen	-6.274,56	-6.730,20	-13.004,76
davon Gründungskosten	*-3.390,53*	*-3.483,23*	*-6.873,76*
davon Depotgebühren	*-2.591,67*	*-2.933,56*	*-5.525,23*
6. Taxe d´Abonnement	-7.849,09	-8.519,71	-16.368,80
Summe der Aufwendungen	**-190.256,64**	**-123.107,35**	**-313.363,99**
III. Ordentlicher Nettoertrag	**373.078,79**	**481.013,83**	**854.092,62**
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	467.979,63	503.572,48	971.552,11
2. Realisierte Verluste	-867.623,83	-932.004,89	-1.799.628,72
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	**-399.644,20**	**-428.432,41**	**-828.076,61**
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**-26.565,41**	**52.581,42**	**26.016,01**
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	**267.675,50**	**106.327,48**	**374.002,98**
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	147.198,47	58.470,96	205.669,43
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	120.477,03	47.856,52	168.333,55
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	**241.110,09**	**158.908,90**	**400.018,99**

Entwicklung des Sondervermögens

für den Zeitraum vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		**38.018.111,68**
1. Ausschüttung für das Vorjahr		-1.118.953,84
2. Zwischenausschüttungen		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		-5.477.538,28
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinverkäufen	4.639.550,10	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	-10.117.088,38	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		25.998,25
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		400.018,99
davon nicht realisierte Gewinne	205.669,43	
davon nicht realisierte Verluste	168.333,55	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		**31.847.636,80**

Vergleichende Übersicht

über die letzten drei Geschäftsjahre

Anteilklasse P (a)	**Fondsvermögen**	**Anteilwert**
Geschäftsjahr	**EUR**	**EUR**
30.06.2016	15.350.501,91	105,14
30.06.2015	16.832.385,36	106,80
30.06.2014	9.833.035,12	105,54
13.01.2014 [1)]	1.499.972,92	100,00

[1)] *Auflagedatum: 13.01.2014*

Vergleichende Übersicht

über die letzten drei Geschäftsjahre

Anteilklasse I (a)	**Fondsvermögen**	**Anteilwert**
Geschäftsjahr	**EUR**	**EUR**
30.06.2016	16.497.134,89	105,95
30.06.2015	21.185.726,32	107,39
30.06.2014	7.895.081,39	105,76
13.01.2014 [1)]	3.499.936,81	100,00

[1)] *Auflagedatum: 13.01.2014*

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse P (a)	EUR	105,14
Anteilwert Klasse I (a)	EUR	105,95
Umlaufende Anteile Klasse P (a)	STK	146.006
Umlaufende Anteile Klasse I (a)	STK	155.713

Anhang

Angaben gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512 *)

Durch Derivate eingegangenes Exposure (Summe der Marktwerte)	EUR	-189.845,00
Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		Credit Suisse International; London
		JPMorgan Securities PLC, London
		Barclays Bank PLC, London

Gesamtbetrag der im Zusammenhang mit Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten

davon:		
Bankguthaben	EUR	0,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	94,40
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,60

Zusammensetzung des Referenzportfolios gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512

100 % ML BB Euro High Yield Index

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512

Kleinster potenzieller Risikobetrag	75,15 %
Größter potenzieller Risikobetrag	106,54 %
Durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	91,36 %

Die Risikokennzahlen sind als absolute Auslastung der 200%-Grenze des Value-at-Risk des Vergleichsvermögens dargestellt.
Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 01.07.2015 bis 30.06.2016 auf Basis der Monte-Carlo Simulation mit den Parametern 99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivatefreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Fondsvermögen ergibt. Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Gesellschaft den relativen Value-at-Risk Ansatz im Sinne des CSSF-Rundschreibens 11/512 an.

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Berichtszeitraum 5,71 %, wobei zur Berechnung die Summe der Nominalbeträge der Derivate in Relation zum Fondsvermögen gesetzt wurde (Nominalwertmethode).

**) Die Risikokennzahlen sind nicht prüfungspflichtig und somit nicht durch das Prüfungsurteil der KPMG Luxembourg, Société coopérative abgedeckt.*

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 30.06.2016 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 101 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu -1 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio [TER]) beträgt 1,25 % für die Anteilklasse P (a) und 0,74 % für die Anteilklasse I (a).

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Geschäftsjahr getragenen Kosten (ohne Transaktionskosten und ohne Performance Fee) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der veröffentlichten TER bzw. Verwaltungskosten) der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

Die Portfolio Turnover Rate (PTR) beträgt 79,69 %. Die Portfolio Turnover Rate drückt die Summe der Wertpapierkäufe und -verkäufe abzüglich des Netto-Mittelaufkommens als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettofondsvolumens innerhalb des Geschäftsjahres aus.

Der Anteil der erfolgsabhängigen Vergütung am durchschnittlichen Fondsvermögen beträgt 0,00 % für die Anteilklasse P (a) und 0,00 % für die Anteilklasse I (a) .

Die Ampega Investment GmbH gewährt sogenannte Vermittlungsprovision an Vermittler aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Im Geschäftsjahr vom 01.07.2015 bis 30.06.2016 erhielt die Kapitalverwaltungsgesellschaft Ampega Investment GmbH für das Sondervermögen Ampega CrossoverPlus Rentenfonds keine Rückvergütung der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die wesentlichen sonstigen Erträge und sonstigen Aufwendungen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung dargestellt.

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände) im Geschäftsjahr gesamt: 25.335,00 EUR.

Bei einigen Geschäftsarten (u.a. Renten- und Devisengeschäfte) sind die Transaktionskosten als Kursbestandteil nicht individuell ermittelbar und daher in obiger Angabe nicht enthalten.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen: Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR Transaktionen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung	TEUR	5.040
davon feste Vergütung	TEUR	3.923
davon variable Vergütung	TEUR	1.117

Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	n.a.
Zahl der Mitarbeiter der KVG	57
Höhe des gezahlten Carried Interest	n.a.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker	TEUR	2.422
davon Geschäftsleiter	TEUR	1.431
davon andere Führungskräfte		n.a.
davon andere Risktaker	TEUR	991
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen		n.a.
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe		n.a.

Die Angaben zu den Vergütungen sind dem zuletzt festgestellten Jahresabschluss der KVG entnommen und werden aus den Entgeltabrechnungsdaten des Jahres ermittelt. Zur Grundvergütung können Mitarbeiter und Geschäftsleiter eine leistungsorientierte Vergütung erhalten. Nähere Hinweise und Erläuterungen zum Vergütungssystem der Gesellschaft sind auf der Internetseite der Gesellschaft (www.ampega.de) erhältlich. Die Vergütung, die Risktaker im Jahr von anderen Gesellschaften des Talanx Konzerns erhielten, wurde bei der Ermittlung der Vergütungen einbezogen.

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik durch die Gesellschaft hat ergeben, dass Änderungen der Vergütungspolitik nicht erforderlich sind.

Wesentliche Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik gem. § 101 Abs. 4 Nr. 5 KAGB fanden daher im Berichtszeitraum nicht statt.

Köln, im Oktober 2016

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Jörg Burger Manfred Köberlein

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

An die Anteilinhaber des Ampega CrossoverPlus Rentenfonds

Entsprechend dem uns von der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft erteilten Auftrag vom 22. Juni 2016 haben wir den beigefügten Jahresabschluss des **Ampega CrossoverPlus Rentenfonds** geprüft, der aus der Aufstellung des Nettofondsvermögens, des Wertpapierbestands und der sonstigen Vermögenswerte zum 30. Juni 2016, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr sowie aus einer Zusammenfassung bedeutsamer Rechnungslegungsmethoden und anderen erläuternden Informationen besteht.

Verantwortung der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft für den Jahresabschluss
Die Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Aufstellung des Jahresabschlusses und für die internen Kontrollen, die er als notwendig erachtet, um die Aufstellung des Jahresabschlusses zu ermöglichen, der frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist, unabhängig davon, ob diese aus Unrichtigkeiten oder Verstössen resultieren.

Verantwortung des Réviseur d'Entreprises agréé
In unserer Verantwortung liegt es, auf der Grundlage unserer Abschlussprüfung über diesen Jahresabschluss ein Prüfungsurteil zu erteilen. Wir führten unsere Abschlussprüfung nach den für Luxemburg von der Commission de Surveillance du Secteur Financier angenommenen internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing) durch. Diese Standards verlangen, dass wir die beruflichen Verhaltensanforderungen einhalten und die Prüfung dahingehend planen und durchführen, dass mit hinreichender Sicherheit erkannt werden kann, ob der Jahresabschluss frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben ist.

Eine Abschlussprüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zum Erhalt von Prüfungsnachweisen für die im Jahresabschluss enthaltenen Wertansätze und Informationen. Die Auswahl der Prüfungshandlungen obliegt der Beurteilung des Réviseur d'Entreprises agréé ebenso wie die Bewertung des Risikos, dass der Jahresabschluss wesentliche unzutreffende Angaben aufgrund von Unrichtigkeiten oder Verstössen enthält.

Im Rahmen dieser Risikoeinschätzung berücksichtigt der Réviseur d'Entreprises agréé das für die Aufstellung und sachgerechte Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses eingerichtete interne Kontrollsystem, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um eine Beurteilung der Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben.

Eine Abschlussprüfung umfasst auch die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und -methoden und der Vertretbarkeit der von der Geschäftsführung der Kapitalverwaltungsgesellschaft ermittelten geschätzten Werte in der Rechnungslegung sowie die Beurteilung der Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Prüfungsurteil
Nach unserer Beurteilung vermittelt der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Aufstellung des Jahresabschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage des Ampega CrossoverPlus Rentenfonds zum 30. Juni 2016 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettofondsvermögens für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Sonstiges
Die im Jahresbericht enthaltenen ergänzenden Angaben wurden von uns im Rahmen unseres Auftrages durchgesehen, waren aber nicht Gegenstand besonderer Prüfungshandlungen nach den oben beschriebenen Standards. Unser Prüfungsurteil bezieht sich daher nicht auf diese Angaben. Im Rahmen der Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses haben uns diese Angaben keinen Anlass zu Anmerkungen gegeben.

Luxemburg, den 24. Oktober 2016

KPMG Luxembourg, Société coopérative
Cabinet de révision agréé

J. Klopp

Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 InvStG

Ampega CrossoverPlus Rentenfonds P (a), Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

WKN A1T6R4, ISIN LU0905727250, Tag der Ausschüttung: 05.09.2016, Datum des Ausschüttungsbeschlusses: 05.09.2016

	Ausschüttung (einschl. KeSt/SolZ)
Nr. 1 a)	Betrag der Ausschüttung
Nr. 1 a) aa)	in der Ausschüttung enthaltene ausschüttungsgleiche Erträge der Vorjahre
Nr. 1 a) bb)	in der Ausschüttung enthaltene Substanzbeträge
Nr. 1 b)	Betrag der ausgeschütteten Erträge
Nr. 1 b)	Betrag der ausschüttungsgleichen Erträge
Nr. 1 c)	In den ausgeschütteten und den ausschüttungsgleichen Erträgen sind enthalten:
Nr. 1 c) aa)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2 Satz 1 InvStG i.V.m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG
Nr. 1c) bb)	Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 2 Satz 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG
Nr. 1 c) cc)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a InvStG
Nr. 1 c) dd)	steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 1 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung
Nr. 1 c) ee)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 2 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung, soweit die Erträge nicht Kapitalerträge i.S.d. § 20 EStG sind
Nr. 1 c) ff)	steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 InvStG in der ab 01.01.2009 anzuwendenden Fassung
Nr. 1 c) gg)	Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 1 InvStG
Nr. 1 c) hh)	in gg) enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen
Nr. 1 c) ii)	Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG, für die kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 c) jj)	in ii) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 c) kk)	in ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG, die nach einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung zur Anrechnung einer als gezahlt geltenden Steuer auf die Einkommensteuer oder Körperschaftsteuer berechtigen
Nr. 1 c) ll)	in kk) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 c) mm)	Erträge i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG
Nr. 1 c) nn)	in ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.V.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1c) oo)	in kk) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.V.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 d)	den zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigenden Teil der Ausschüttung und ausschüttungsgleichen Erträge
Nr. 1 d) aa)	i.S.d. § 7 Abs. 1 und 2 InvStG
Nr. 1 d) bb)	i.S.d. § 7 Abs. 3 InvStG
	i.S.d. § 7 Abs. 3 Satz 1 Nr. 2 InvStG, soweit in bb) enthalten
Nr. 1 d) cc)	i.S.d. § 7 Abs. 1 Satz 4 InvStG, soweit in aa) enthalten
Nr. 1 f)	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den ausgeschütteten und ausschüttungsgleichen Erträgen enthaltenen Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG entfällt und
Nr. 1 f) aa)	der nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 f) bb)	in aa) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) cc)	der nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 f) dd)	in cc) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) ee)	der nach einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. diesem Abkommen anrechenbar ist
Nr. 1 f) ff)	in ee) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) gg)	in aa) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) hh)	in cc) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) ii)	in ee) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 g)	Betrag der Absetzungen für Abnutzung oder Substanzverringerung
Nr. 1 h)	die im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre

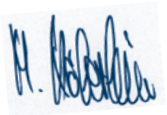
Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung

Köln, den 05.09.2016



Jörg Burger



Manfred Köberlein

Priv. Anleger EStG EURO Pro Anteil	Betr. Anleger EStG EURO Pro Anteil	Betr. Anleger KStG EURO Pro Anteil
3,2000000	3,2000000	3,2000000
3,2332372	3,2332372	3,2332372
0,2633234	0,2633234	0,2633234
0,0000000	0,0000000	0,0000000
2,9699137	2,9699137	2,9699137
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	0,0000000	0,0000000
-- -- --	2,9470682	2,9470682
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
2,9699137	2,9699137	2,9699137
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0228455	0,0228455	0,0228455
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0332372	0,0332372	0,0332372

Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 InvStG

Ampega CrossoverPlus Rentenfonds I (a), Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

WKN A1T6R5, ISIN LU0905728654, Tag der Ausschüttung: 05.09.2016, Datum des Ausschüttungsbeschlusses: 05.09.2016

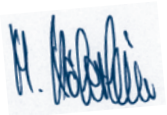
	Ausschüttung (einschl. KeSt/SolZ)
Nr. 1 a)	Betrag der Ausschüttung
Nr. 1 a) aa)	in der Ausschüttung enthaltene ausschüttungsgleiche Erträge der Vorjahre
Nr. 1 a) bb)	in der Ausschüttung enthaltene Substanzbeträge
Nr. 1 b)	Betrag der ausgeschütteten Erträge
Nr. 1 b)	Betrag der ausschüttungsgleichen Erträge
Nr. 1 c)	In den ausgeschütteten und den ausschüttungsgleichen Erträgen sind enthalten:
Nr. 1 c) aa)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2 Satz 1 InvStG i.V.m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG
Nr. 1c) bb)	Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 2 Satz 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG
Nr. 1 c) cc)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a InvStG
Nr. 1 c) dd)	steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 1 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung
Nr. 1 c) ee)	Erträge i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 Satz 2 InvStG in der am 31.12.2008 anzuwendenden Fassung, soweit die Erträge nicht Kapitalerträge i.S.d. § 20 EStG sind
Nr. 1 c) ff)	steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 InvStG in der ab 01.01.2009 anzuwendenden Fassung
Nr. 1 c) gg)	Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 1 InvStG
Nr. 1 c) hh)	in gg) enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen
Nr. 1 c) ii)	Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG, für die kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 c) jj)	in ii) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 c) kk)	in ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG, die nach einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung zur Anrechnung einer als gezahlt geltenden Steuer auf die Einkommensteuer oder Körperschaftsteuer berechtigen
Nr. 1 c) ll)	in kk) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 c) mm)	Erträge i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG
Nr. 1 c) nn)	in ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.V.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1c) oo)	in kk) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.V.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 d)	den zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigenden Teil der Ausschüttung und ausschüttungsgleichen Erträge
Nr. 1 d) aa)	i.S.d. § 7 Abs. 1 und 2 InvStG
Nr. 1 d) bb)	i.S.d. § 7 Abs. 3 InvStG
	i.S.d. § 7 Abs. 3 Satz 1 Nr. 2 InvStG, soweit in bb) enthalten
Nr. 1 d) cc)	i.S.d. § 7 Abs. 1 Satz 4 InvStG, soweit in aa) enthalten
Nr. 1 f)	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den ausgeschütteten und ausschüttungsgleichen Erträgen enthaltenen Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 InvStG entfällt und
Nr. 1 f) aa)	der nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 f) bb)	in aa) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) cc)	der nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 InvStG vorgenommen wurde
Nr. 1 f) dd)	in cc) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) ee)	der nach einem Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 InvStG i.V.m. diesem Abkommen anrechenbar ist
Nr. 1 f) ff)	in ee) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 InvStG i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) gg)	in aa) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) hh)	in cc) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 f) ii)	in ee) enthalten ist und auf Einkünfte i.S.d. § 21 Abs. 22 Satz 4 InvStG entfällt, auf die § 2 Abs. 2 InvStG in der am 20.03.2013 geltenden Fassung i.v.m. § 8b Abs. 1 des KStG anzuwenden ist
Nr. 1 g)	Betrag der Absetzungen für Abnutzung oder Substanzverringerung
Nr. 1 h)	die im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre

Ampega Investment GmbH Köln, den 05.09.2016

Die Geschäftsführung



Jörg Burger



Manfred Köberlein

Priv. Anleger EStG EURO Pro Anteil	Betr. Anleger EStG EURO Pro Anteil	Betr. Anleger KStG EURO Pro Anteil
3,0891050	3,0891050	3,0891050
3,1224789	3,1224789	3,1224789
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
3,1224789	3,1224789	3,1224789
0,2177106	0,2177106	0,2177106
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	0,0000000	0,0000000
-- -- --	3,3401895	3,3401895
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	-- -- --	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
3,3401895	3,3401895	3,3401895
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
0,0000000	0,0000000	0,0000000
-- -- --	0,0000000	-- -- --
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
-- -- --	-- -- --	0,0000000
0,0000000	0,0000000	0,0000000
0,0333738	0,0333738	0,0333738

Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) über die steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 Nr. 1 und 2 InvStG für den Investmentfonds Ampega CrossoverPlus Rentenfonds P (a) für den Zeitraum vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

An die Ampega Investment GmbH (nachfolgend die Gesellschaft):

Die Gesellschaft hat uns beauftragt, gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) zu prüfen, ob die von der Gesellschaft für den genannten Investmentfonds für den genannten Zeitraum zu veröffentlichenden Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Die Bescheinigung hat zudem eine Aussage darüber zu enthalten, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 der Abgabenordnung (AO) vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Die Verantwortung für die Ermittlung der steuerlichen Angaben gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG in Verbindung mit den Vorschriften des deutschen Steuerrechts liegt bei den gesetzlichen Vertretern der Gesellschaft. Die Ermittlung beruht auf der Buchführung/den Aufzeichnungen und dem Jahresbericht nach § 44 Abs. 1 Investmentgesetz (InvG) bzw. § 101 Abs. 1 Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) für den betreffenden Zeitraum. Sie besteht aus einer Überleitung aufgrund steuerlicher Vorschriften und der Zusammenstellung der zur Bekanntmachung bestimmten steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG. In den Jahresbericht sowie in die steuerlichen Angaben sind Werte aus einem Ertragsausgleich eingegangen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an anderen Investmentvermögen (Zielfonds) investiert hat, verwendet sie die ihr für diese Zielfonds vorliegenden steuerlichen Angaben.

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung abzugeben, ob die von der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG zu veröffentlichenden Angaben nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Unsere Prüfung erfolgt auf der Grundlage der von einem Abschlussprüfer nach § 44 Abs. 5 InvG bzw. § 102 KAGB geprüften Buchführung/Aufzeichnungen und des geprüften Jahresberichtes. Unserer Beurteilung unterliegen die darauf beruhende Überleitung und die zur Bekanntmachung bestimmten Angaben. Unsere Prüfung erstreckt sich insbesondere auf die steuerliche Qualifikation von Kapitalanlagen, von Erträgen und Aufwendungen einschließlich deren Zuordnung als Werbungskosten sowie sonstiger steuerlicher Aufzeichnungen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an Zielfonds investiert hat, beschränkt sich unsere Prüfung auf die korrekte Übernahme der für diese Zielfonds von anderen zur Verfügung gestellten steuerlichen Angaben durch die Gesellschaft nach Maßgabe vorliegender Bescheinigungen. Die entsprechenden steuerlichen Angaben wurden von uns nicht geprüft.

Wir haben unsere Prüfung unter sinngemäßer Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass mit hinreichender Sicherheit beurteilt werden kann, ob die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG frei von wesentlichen Fehlern sind. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentvermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung berücksichtigen wir das für die Ermittlung der Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG relevante interne Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen und durchzuführen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.

Die Prüfung umfasst auch eine Beurteilung der Auslegung der angewandten Steuergesetze durch die Gesellschaft. Die von der Gesellschaft gewählte Auslegung ist dann nicht zu beanstanden, wenn sie in vertretbarer Weise auf Gesetzesmaterialien, Rechtsprechung, einschlägige Fachliteratur und veröffentlichte Auffassungen der Finanzverwaltung gestützt werden konnte. Wir weisen darauf hin, dass eine künftige Rechtsentwicklung und insbesondere neue Erkenntnisse aus

der Rechtsprechung eine andere Beurteilung der von der Gesellschaft vertretenen Auslegung notwendig machen können.

Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Für unsere Aussage, ob die Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG auswirken kann, sind nach § 5 Abs. 1a Satz 3 InvStG keine über die Prüfung der Einhaltung der Regeln des deutschen Steuerrechts hinausgehenden Ermittlungen vorzunehmen.

Für unsere Aussage, ob die Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, haben wir besondere Ermittlungen nur im Hinblick auf die Vorgänge des laufenden Jahres vorgenommen. Unsere Aussage stützen wir auf analytische Prüfungshandlungen zu den veröffentlichten Aktiengewinnen und den veröffentlichten Rücknahmepreisen für den Berichtszeitraum.

Auf dieser Grundlage bescheinigen wir der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG, dass die Angaben gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

Es haben sich keine Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, auswirken kann.

Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich aus Sicht der Finanzverwaltung aus den von dem Investmentfonds durchgeführten Geschäften oder sonstigen Umständen, insbesondere dem Abschluss von derivativen Geschäften, dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren und anderen Vermögensgegenständen, dem Bezug von Leistungen, durch die Werbungskosten entstehen, der Vornahme eines Ertragsausgleichs, der Entscheidung über die Ausschüttung von Erträgen (weitere) Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben.

Düsseldorf, den 5. September 2016

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Dr. Hans-Peter Niedrig
Rechtsanwalt
Wirtschaftsprüfer
Steuerberater

Maximilian Hardt
Steuerberater

Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) über die steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 Nr. 1 und 2 InvStG für den Investmentfonds Ampega CrossoverPlus Rentenfonds I (a) für den Zeitraum vom 01.07.2015 bis 30.06.2016

An die Ampega Investment GmbH (nachfolgend die Gesellschaft):

Die Gesellschaft hat uns beauftragt, gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) zu prüfen, ob die von der Gesellschaft für den genannten Investmentfonds für den genannten Zeitraum zu veröffentlichenden Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Die Bescheinigung hat zudem eine Aussage darüber zu enthalten, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 der Abgabenordnung (AO) vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Die Verantwortung für die Ermittlung der steuerlichen Angaben gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG in Verbindung mit den Vorschriften des deutschen Steuerrechts liegt bei den gesetzlichen Vertretern der Gesellschaft. Die Ermittlung beruht auf der Buchführung/den Aufzeichnungen und dem Jahresbericht nach § 44 Abs. 1 Investmentgesetz (InvG) bzw. § 101 Abs. 1 Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) für den betreffenden Zeitraum. Sie besteht aus einer Überleitung aufgrund steuerlicher Vorschriften und der Zusammenstellung der zur Bekanntmachung bestimmten steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG. In den Jahresbericht sowie in die steuerlichen Angaben sind Werte aus einem Ertragsausgleich eingegangen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an anderen Investmentvermögen (Zielfonds) investiert hat, verwendet sie die ihr für diese Zielfonds vorliegenden steuerlichen Angaben.

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung abzugeben, ob die von der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG zu veröffentlichenden Angaben nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Unsere Prüfung erfolgt auf der Grundlage der von einem Abschlussprüfer nach § 44 Abs. 5 InvG bzw. § 102 KAGB geprüften Buchführung/Aufzeichnungen und des geprüften Jahresberichtes. Unserer Beurteilung unterliegen die darauf beruhende Überleitung und die zur Bekanntmachung bestimmten Angaben. Unsere Prüfung erstreckt sich insbesondere auf die steuerliche Qualifikation von Kapitalanlagen, von Erträgen und Aufwendungen einschließlich deren Zuordnung als Werbungskosten sowie sonstiger steuerlicher Aufzeichnungen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an Zielfonds investiert hat, beschränkt sich unsere Prüfung auf die korrekte Übernahme der für diese Zielfonds von anderen zur Verfügung gestellten steuerlichen Angaben durch die Gesellschaft nach Maßgabe vorliegender Bescheinigungen. Die entsprechenden steuerlichen Angaben wurden von uns nicht geprüft.

Wir haben unsere Prüfung unter sinngemäßer Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass mit hinreichender Sicherheit beurteilt werden kann, ob die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG frei von wesentlichen Fehlern sind. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentvermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung berücksichtigen wir das für die Ermittlung der Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG relevante interne Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen und durchzuführen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.

Die Prüfung umfasst auch eine Beurteilung der Auslegung der angewandten Steuergesetze durch die Gesellschaft. Die von der Gesellschaft gewählte Auslegung ist dann nicht zu beanstanden, wenn sie in vertretbarer Weise auf Gesetzesmaterialien, Rechtsprechung, einschlägige Fachliteratur und veröffentlichte Auffassungen der Finanzverwaltung gestützt werden konnte. Wir weisen darauf hin, dass eine künftige Rechtsentwicklung und insbesondere neue Erkenntnisse aus

der Rechtsprechung eine andere Beurteilung der von der Gesellschaft vertretenen Auslegung notwendig machen können.

Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Für unsere Aussage, ob die Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG auswirken kann, sind nach § 5 Abs. 1a Satz 3 InvStG keine über die Prüfung der Einhaltung der Regeln des deutschen Steuerrechts hinausgehenden Ermittlungen vorzunehmen.

Für unsere Aussage, ob die Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, haben wir besondere Ermittlungen nur im Hinblick auf die Vorgänge des laufenden Jahres vorgenommen. Unsere Aussage stützen wir auf analytische Prüfungshandlungen zu den veröffentlichten Aktiengewinnen und den veröffentlichten Rücknahmepreisen für den Berichtszeitraum.

Auf dieser Grundlage bescheinigen wir der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG, dass die Angaben gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

Es haben sich keine Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, auswirken kann.

Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich aus Sicht der Finanzverwaltung aus den von dem Investmentfonds durchgeführten Geschäften oder sonstigen Umständen, insbesondere dem Abschluss von derivativen Geschäften, dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren und anderen Vermögensgegenständen, dem Bezug von Leistungen, durch die Werbungskosten entstehen, der Vornahme eines Ertragsausgleichs, der Entscheidung über die Ausschüttung von Erträgen (weitere) Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben.

Düsseldorf, den 5. September 2016

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Dr. Hans-Peter Niedrig
Rechtsanwalt
Wirtschaftsprüfer
Steuerberater

Maximilian Hardt
Steuerberater

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@talanx.com
Web www.ampega.de

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 31.05.2016)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

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

Aufsichtsrat

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

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

Walter Drefahl
Mitglied des Vorstandes der HDI Vertriebs AG, Hannover

Prof. Dr. Juergen B. Donges
Direktor des Instituts für Wirtschaftspolitik, Köln

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

Dr. Dr. Günter Scheipermeier
Vorsitzender der Geschäftsführung der NOBILIA-WERKE GmbH & Co., Verl

Geschäftsführung

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

Jörg Burger

Manfred Köberlein

Ralf Pohl

Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Kaiserstraße 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Abschlussprüfer

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Auslagerung

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

Auslagerung Portfoliomanagement

inprimo invest GmbH
Clemensstr. 10
60487 Frankfurt am Main
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Str. 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.de) informiert.

Angaben zum Sondervermögen

Portfoliomanager

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Deutschland

Abschlussprüfer

KPMG Luxembourg, Société coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
1855 Luxemburg
Luxemburg

Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Commission de Surveillance du Secteur Financier
110, route d'Arlon
1150 Luxemburg
Luxemburg

Verwahrstellen-Dienstleister

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Niederlassung Luxemburg
1C, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg

Zahl- und Vertriebsstelle Großherzogtum Luxemburg

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Niederlassung Luxemburg
1C, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Luxemburg

Angaben für Anleger aus Deutschland

Zahl- und Informationsstelle Bundesrepublik Deutschland

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Vertriebsstelle

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Deutschland

Angaben für Anleger aus Österreich

Zahl- und Informationsstelle Österreich

Capital Bank – GRAWE Gruppe AG
Burgring 16
8010 Graz
Österreich

Steuerlicher Vertreter

PwC PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungs- und Steuerberatungsgesellschaft
Erdbergstraße 200
1030 Wien
Österreich

Das Sondervermögen wird in Österreich ausschließlich über konzessionierte Banken, konzessionierte Wertpapierfirmen und/oder konzessionierte Wertpapierdienstleistungsunternehmen vertrieben. Rücknahmeanträge können bei der österreichischen Zahlstelle eingereicht werden. Gültige Verkaufsprospekte nebst Fondsvertragsbedingungen, Jahres- und Halbjahresberichte sowie ggf. weitere Fondsunterlagen sind bei der Zahl- und Informationsstelle erhältlich. Diese Unterlagen sowie weitere Hinweise finden Sie auf der Homepage der Gesellschaft **(www.ampega.de).**

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden börsentäglich in der österreichischen Tageszeitung „DIE PRESSE“ veröffentlicht. Gerichtsstand für Klagen gegen die Investmentgesellschaft, die auf den Vertrieb der Investmentanteile in Österreich Bezug haben, ist Wien. In Ergänzung zum Hinweis nach § 126 InvG im Verkaufsprospekt (Widerrufsrechte bei „Haustürgeschäften“) gilt, dass für österreichische Anleger § 3 KSchG anzuwenden ist.



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

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

Ein Unternehmen der Talanx