

Halbjahresbericht

Ampega Unternehmensanleihenfonds

1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020

OGAW-Sondervermögen



Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.06.2020

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	85.406.625,96	97,02
Australien	1.485.291,50	1,69
Belgien	1.087.418,00	1,24
Deutschland	14.609.011,75	16,59
Dänemark	302.872,50	0,34
Finnland	1.510.192,00	1,72
Frankreich	11.385.873,50	12,93
Großbritannien	7.137.284,00	8,11
Irland	1.589.491,50	1,81
Italien	3.875.605,50	4,40
Japan	1.719.976,71	1,95
Jersey	311.886,00	0,35
Kanada	800.260,00	0,91
Luxemburg	2.270.981,50	2,58
Niederlande	9.331.241,00	10,60
Norwegen	2.254.961,00	2,56
Polen	933.307,50	1,06
Schweden	1.286.463,50	1,46
Singapur	818.318,00	0,93
Spanien	3.031.121,50	3,44
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	17.095.455,50	19,42
Österreich	2.569.613,50	2,92
Asset Backed Securities	930.141,00	1,06
Niederlande	930.141,00	1,06
Derivate	383.475,50	0,44
Swaps	383.475,50	0,44
Bankguthaben	890.575,67	1,01
Sonstige Vermögensgegenstände	487.756,34	0,55
Verbindlichkeiten	-65.240,40	-0,07
Fondsvermögen	88.033.334,07	100,00¹⁾

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere								81.471.320,96	92,55
Verzinsliche Wertpapiere								81.471.320,96	92,55
0,0000 % Intesa Sanpaolo 1997/2027	IT0000966017		EUR	500	0	0 %	89,0325	445.162,50	0,51
0,0000 % Berkshire Hathaway MC 2020/2025	XS2133056114		EUR	500	500	0 %	99,0670	495.335,00	0,56
0,1250 % Dt. Pfandbrief- bank MTN 2019/2024	DE000A2NBKK3		EUR	500	0	0 %	97,1410	485.705,00	0,55
0,1250 % LVMH Moët- Hennessy MC 2020/2028	FR0013482833		EUR	400	1.500	1.100 %	98,3550	393.420,00	0,45

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
0,1250 % Philip Morris Int. MC 2019/2026	XS2035473748		EUR	1.000	0	0 %	95,7380	957.380,00	1,09
0,1250 % SAP MC 2020/2026	XS2176715584		EUR	500	500	0 %	100,2285	501.142,50	0,57
0,1250 % Santander Consumer Bank MTN 2019/2024	XS2050945984		EUR	100	0	0 %	97,1270	97.127,00	0,11
0,1250 % Stadshypotek (covered) 2016/2026	XS1499574991		EUR	400	0	0 %	102,3665	409.466,00	0,47
0,1390 % SNAM MTN FRN 2017/2024	XS1657785538		EUR	500	0	0 %	97,3920	486.960,00	0,55
0,2000 % General Motors Financial MTN 2019/2022	XS2049548444		EUR	200	200	0 %	96,1880	192.376,00	0,22
0,2500 % BASF MTN MC 2020/2027	DE000A289DC9		EUR	200	200	0 %	100,6300	201.260,00	0,23
0,2500 % DnB Boligkredit (covered) 2016/2026	XS1485596511		EUR	500	0	0 %	102,9245	514.622,50	0,58
0,2500 % Siemens Finanzierungsmat. MTN 2020/2024	XS2182055181		EUR	200	200	0 %	100,6265	201.253,00	0,23
0,2500 % Skand. Enskilda MTN S.GMTN 2020/2023	XS2176534282		EUR	300	300	0 %	100,6770	302.031,00	0,34
0,2500 % Sparebanken 1 Boligkredit (covered) 2016/2026	XS1482554075		EUR	500	0	0 %	102,7735	513.867,50	0,58
0,2500 % Telenor MTN MC 2019/2027	XS2056396919		EUR	500	0	0 %	100,0185	500.092,50	0,57
0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria MTN 2019/2024	XS2058729653		EUR	400	0	0 %	97,2650	389.060,00	0,44
0,3750 % Canadian Imperial Bank MTN 2019/2024	XS1991125896		EUR	300	0	700 %	99,4675	298.402,50	0,34
0,3750 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2029	XS2193666042		EUR	200	200	0 %	100,1425	200.285,00	0,23
0,3750 % Enel Finance Int. MTN MC 2019/2027	XS2066706909		EUR	200	0	200 %	99,0135	198.027,00	0,22
0,3750 % Engie MTN MC 2019/2027	FR0013428489		EUR	600	0	0 %	99,6110	597.666,00	0,68
0,3750 % LB Hessen-Thüringen MTN S.H344 2020/2025	XS2171210862		EUR	1.000	1.000	0 %	101,0190	1.010.190,00	1,15
0,3750 % Merck Financial Services MTN MC 2019/2027	XS2023644201		EUR	300	0	0 %	100,6825	302.047,50	0,34
0,3750 % Metrop. Life Global Fdg. I 2019/2024	XS1979259220		EUR	500	0	0 %	100,5835	502.917,50	0,57
0,3750 % Siemens Finanzierungsmat. MTN 2020/2026	XS2182054887		EUR	500	500	0 %	100,8245	504.122,50	0,57
0,3750 % Toronto Dominion Bank MTN 2019/2024	XS1985806600		EUR	500	0	0 %	100,3715	501.857,50	0,57
0,4500 % DH Europe Finance II MC 2019/2028	XS2050404800		EUR	500	0	0 %	97,9310	489.655,00	0,56
0,5000 % Apple MC 2019/2031	XS2079716937		EUR	300	0	0 %	102,2785	306.835,50	0,35
0,5000 % BPCE MTN 2019/2027	FR0013455540		EUR	300	0	0 %	98,1875	294.562,50	0,33
0,5000 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria MTN 2020/2027	XS2101349723		EUR	500	500	0 %	95,8000	479.000,00	0,54
0,5000 % Banco Santander MTN 2020/2027	XS2113889351		EUR	200	400	200 %	96,0335	192.067,00	0,22
0,5000 % British Telecom MTN MC 2019/2025	XS2051494222		EUR	700	0	0 %	99,3450	695.415,00	0,79
0,5000 % Bundesanleihe 2015/2025	DE0001102374		EUR	2.000	0	0 %	105,7825	2.115.650,00	2,40
0,5000 % Bundesanleihe 2017/2027	DE0001102424		EUR	1.500	0	0 %	108,4430	1.626.645,00	1,85
0,5000 % Essilor International MTN MC 2020/2028	FR0013516077		EUR	400	400	0 %	99,8550	399.420,00	0,45
0,5000 % FCA Bank MTN MC 2019/2024	XS2051914963		EUR	400	400	0 %	94,2575	377.030,00	0,43
0,5000 % KBC Groep MTN fix-to-float (sub.) 2019/2029	BE0002664457		EUR	200	0	0 %	96,8080	193.616,00	0,22
0,5000 % Lloyds Banking Group MTN fix-to-float 2019/2025	XS2078918781		EUR	200	0	0 %	97,6625	195.325,00	0,22
0,5000 % OP Corporate Bank MTN 2020/2025	XS2171253912		EUR	200	400	200 %	101,3830	202.766,00	0,23
0,5000 % Santander UK (covered) 2018/2025	XS1748479919		EUR	600	0	0 %	103,0510	618.306,00	0,70

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
0,5000 % United Overseas Bank MTN (covered) 2018/2025	XS1750083229		EUR	500	0	500 %	102,7885	513.942,50	0,58
0,5000 % Westpac Banking MTN (covered) 2018/2025	XS1748436190		EUR	700	0	300 %	103,0980	721.686,00	0,82
0,5230 % Mizuho Financial Group MTN 2019/2024	XS2004880832		EUR	300	0	0 %	99,7800	299.340,00	0,34
0,5240 % Exxon Mobil MC 2020/2028	XS2196322312		EUR	300	300	0 %	99,8385	299.515,50	0,34
0,6250 % Daimler International Finance MTN 2019/2027	DE000A2R9ZU9		EUR	300	0	0 %	94,8410	284.523,00	0,32
0,6250 % Evonik Industries MC 2020/2025	DE000A289NX4		EUR	300	700	400 %	101,0525	303.157,50	0,34
0,6250 % Grenke Finance MTN 2019/2025	XS2078696866		EUR	200	0	0 %	95,0085	190.017,00	0,22
0,6250 % Koninklijke DSM MTN MC 2020/2032	XS2193979254		EUR	200	200	0 %	99,9265	199.853,00	0,23
0,6250 % Skand. Enskilda MTN 2019/2029	XS2078737215		EUR	100	0	400 %	99,7965	99.796,50	0,11
0,6250 % Vivendi MTN MC 2019/2025	FR0013424868		EUR	200	0	0 %	99,8400	199.680,00	0,23
0,7500 % AbbVie MC 2019/2027	XS2055646918		EUR	500	0	0 %	100,1920	500.960,00	0,57
0,7500 % OMV MTN 2020/2030	XS2189613982		EUR	300	300	0 %	98,8930	296.679,00	0,34
0,7500 % PKO Bank Hipoteczny covered 2017/2024	XS1690669574		EUR	500	0	0 %	102,8715	514.357,50	0,58
0,7500 % RCI Banque MTN MC 2019/2023	FR0013412699		EUR	200	0	0 %	97,2900	194.580,00	0,22
0,7500 % Rabobank Nederland 2018/2023	XS1871439342		EUR	500	0	0 %	101,3395	506.697,50	0,58
0,7500 % Telenor ASA MTN MC 2019/2026	XS2001737324		EUR	200	0	0 %	103,0550	206.110,00	0,23
0,8000 % Capital One Financial 2019/2024	XS2009011771		EUR	200	0	0 %	97,6950	195.390,00	0,22
0,8000 % Veolia Environnement MTN MC 2020/2032	FR0013517059		EUR	300	300	0 %	100,2740	300.822,00	0,34
0,8190 % Sumitomo Mitsui Financial Group MTN 2018/2023	XS1839105662		EUR	300	0	0 %	101,6045	304.813,50	0,35
0,8350 % Exxon Mobil MC 2020/2032	XS2196322403		EUR	200	200	0 %	98,7195	197.439,00	0,22
0,8500 % General Motors Financial MC 2020/2026	XS2125145867		EUR	400	400	0 %	87,8770	351.508,00	0,40
0,8750 % Covestro MC 2020/2026	XS2188805688		EUR	350	350	0 %	99,8905	349.616,75	0,40
0,8750 % DS Smith MC 2019/2026	XS2051777873		EUR	400	0	200 %	96,6030	386.412,00	0,44
0,8750 % Deutsche Telekom MTN 2019/2026	DE000A2TSDD4		EUR	400	0	0 %	103,0180	412.072,00	0,47
0,8750 % Goldman Sachs MTN 2020/2030	XS2107332640		EUR	600	800	200 %	97,6975	586.185,00	0,67
0,8750 % ING Bank MTN (covered) 2018/2028	XS1805257265		EUR	500	0	0 %	108,5880	542.940,00	0,62
0,8750 % Molnlycke Holding MTN MC 2019/2029	XS2049769297		EUR	500	0	0 %	95,0340	475.170,00	0,54
0,8750 % SES MTN MC 2019/2027	XS2075811781		EUR	800	600	0 %	93,0390	744.312,00	0,85
0,8750 % Tesco Corporate Treasury Services MTN MC 2019/2026	XS2086868010		EUR	250	0	0 %	99,2555	248.138,75	0,28
0,8750 % Verizon Communications 2016/2025	XS1405766897		EUR	200	0	0 %	102,1290	204.258,00	0,23
0,8750 % Verizon Communications MC 2019/2027	XS1979280853		EUR	500	0	0 %	101,4400	507.200,00	0,58
0,9000 % Standard Chartered Bank MTN MC 2019/2027	XS2021467753		EUR	400	0	0 %	99,3350	397.340,00	0,45
0,9560 % Mizuho Financial Group MTN 2017/2024	XS1691909920		EUR	314	0	0 %	101,5765	318.950,21	0,36
0,9780 % Mitsubishi UFJ Financial Group 2020/2024	XS2132337697		EUR	500	500	0 %	101,8100	509.050,00	0,58

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
1,0000 % Banco Bilbao Vizc. S.GMTN fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2104051433		EUR	200	200	0 %	94,0810	188.162,00	0,21
1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 2019/2026	XS2013745703		EUR	200	0	0 %	99,7010	199.402,00	0,23
1,0000 % Cellnex Telecom MC 2020/2027	XS2102934697		EUR	500	500	0 %	95,9690	479.845,00	0,55
1,0000 % Commerzbank MTN 2019/2026	DE000CZ40NS9		EUR	200	0	0 %	101,6150	203.230,00	0,23
1,0000 % Credit Agricole Italia (covered) 2019/2027	IT0005366288		EUR	400	0	0 %	107,9895	431.958,00	0,49
1,0000 % Credit Agricole MTN fix-to-float 2020/2026	FR0013508512		EUR	100	100	0 %	100,9810	100.981,00	0,11
1,0000 % Fresenius Medical Care MTN MC 2020/2026	XS2178769076		EUR	300	300	0 %	101,7505	305.251,50	0,35
1,0000 % Intesa Sanpaolo MTN 2019/2026	XS2081018629		EUR	400	0	0 %	97,8360	391.344,00	0,44
1,0000 % JT Intl. Fin. Services MC 2019/2029	XS2082472122		EUR	1.100	0	0 %	100,9345	1.110.279,50	1,26
1,0000 % Natwest Markets MTN 2019/2024	XS2002491517		EUR	300	500	200 %	99,6510	298.953,00	0,34
1,0000 % Nordea Bank MTN fix-to-float (sub-ordinated) 2016/2026	XS1486520403		EUR	500	0	0 %	99,7590	498.795,00	0,57
1,0000 % Telstra MC 2020/2030	XS2160857798		EUR	200	200	0 %	103,1710	206.342,00	0,23
1,0010 % JP Morgan Chase & Co. MTN fix-to-float 2019/2031	XS2033262622		EUR	100	0	0 %	99,8715	99.871,50	0,11
1,0230 % Total Capital International MTN MC 2018/2027	XS1874122770		EUR	400	0	0 %	104,2840	417.136,00	0,47
1,0730 % mBank Hipoteczny (covered) 2018/2025	XS1812878889		EUR	400	0	0 %	104,7375	418.950,00	0,48
1,0900 % JP Morgan Chase & Co. fix-to-float 2019/2027	XS1960248919		EUR	700	0	0 %	102,1580	715.106,00	0,81
1,1250 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2020/2029	FR0013508710		EUR	400	400	0 %	101,1135	404.454,00	0,46
1,1250 % BNP Paribas MTN fix-to-float (sub.) 2020/2032	FR0013476611		EUR	500	500	0 %	96,4990	482.495,00	0,55
1,1250 % Commerzbank MTN 2019/2026	DE000CZ40N46		EUR	500	0	0 %	98,2790	491.395,00	0,56
1,1250 % Grenke Finance MTN 2016/2022	XS1527138272		EUR	500	0	0 %	100,2090	501.045,00	0,57
1,1250 % Mediobanca MTN 2020/2025	XS2106861771		EUR	400	400	0 %	95,8865	383.546,00	0,44
1,1250 % Pernod Ricard MC 2020/2025	FR0013506524		EUR	600	600	0 %	103,3350	620.010,00	0,70
1,1250 % Vonovia Finance MTN 2017/2025	DE000A19NS93		EUR	200	0	0 %	103,0585	206.117,00	0,23
1,2010 % Telefonica Emisiones MTN MC 2020/2027	XS2177441990		EUR	300	600	300 %	103,3695	310.108,50	0,35
1,2500 % Bertelsmann MTN MC 2018/2025	XS1888229249		EUR	500	0	0 %	104,2995	521.497,50	0,59
1,2500 % CRH SMW Finance MTN MC 2020/2026	XS2168478068		EUR	100	300	200 %	103,5325	103.532,50	0,12
1,2500 % IBM 2019/2027	XS1945110606		EUR	700	0	0 %	104,6100	732.270,00	0,83
1,2500 % Shell Int. Finance MTN 2020/2032	XS2170386853		EUR	400	400	0 %	103,5010	414.004,00	0,47
1,2500 % Suez MC 2016/2028	FR0013173432		EUR	500	500	0 %	105,3490	526.745,00	0,60
1,2500 % UBS Group Funding MC 2016/2026	CH0336602930		EUR	300	0	0 %	103,9620	311.886,00	0,35
1,3010 % Allianz fix-to-float (sub.) 2019/2049	DE000A2YPFA1		EUR	700	0	0 %	96,8195	677.736,50	0,77
1,3420 % Morgan Stanley fix-to-float -single callable- 2017/2026	XS1706111793		EUR	100	0	300 %	103,1370	103.137,00	0,12
1,3750 % Banco Santander MTN 2020/2026	XS2168647357		EUR	200	200	0 %	101,5965	203.193,00	0,23
1,3750 % Covestro MC 2020/2030	XS2188805845		EUR	200	200	0 %	99,8060	199.612,00	0,23
1,3750 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2040	XS2156768546		EUR	400	400	0 %	106,8290	427.316,00	0,49

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
1,3750 % Deutsche Bank MTN fix-to-float 2020/2026	DE000DL19VD6		EUR	400	800	400 %	101,6510	406.604,00	0,46
1,3750 % Equinor MTN MC 2020/2032	XS2178833690		EUR	300	300	0 %	106,7550	320.265,00	0,36
1,3750 % La Poste MTN 2020/2032	FR0013508694		EUR	200	200	0 %	105,7520	211.504,00	0,24
1,4910 % Total Capital International MTN MC 2020/2027	XS2153406868		EUR	400	400	0 %	106,6330	426.532,00	0,48
1,5000 % Bertelsmann MTN MC 2020/2030	XS2176558620		EUR	300	300	0 %	103,2745	309.823,50	0,35
1,5000 % Citigroup MTN fix-to-float 2018/2026	XS1859010685		EUR	200	0	0 %	103,2465	206.493,00	0,23
1,5000 % DBS Group Holdings fix-to-float (subord.) 2018/2028	XS1802465846		EUR	300	0	0 %	101,4585	304.375,50	0,35
1,5000 % Fidelity National Information Services MC 2019/2027	XS1843436228		EUR	400	0	0 %	103,4660	413.864,00	0,47
1,5000 % Fresenius Medical Care MTN MC 2020/2030	XS2178769159		EUR	350	350	0 %	103,5160	362.306,00	0,41
1,5000 % Shell Int. Finance MTN 2020/2028	XS2154418730		EUR	300	300	0 %	108,1040	324.312,00	0,37
1,6000 % AT&T MC 2020/2028	XS2180007549		EUR	400	400	0 %	102,6300	410.520,00	0,47
1,6150 % FCE Bank MTN 2016/2023	XS1409362784		EUR	600	0	0 %	94,5075	567.045,00	0,64
1,6250 % Anglo American Capital MTN - single callable- 2019/2026	XS1962513674		EUR	300	0	0 %	99,4990	298.497,00	0,34
1,6250 % Cap Gemini MC 2020/2026	FR0013507852		EUR	300	400	100 %	105,0420	315.126,00	0,36
1,6250 % Dell Bank MC 2020/2024	XS2193734733		EUR	400	400	0 %	100,6975	402.790,00	0,46
1,6250 % FedEx Corporation MC 2016/2027	XS1319820541		EUR	150	0	0 %	102,1370	153.205,50	0,17
1,6250 % Grenke Finance MTN 2019/2024	XS1956014531		EUR	200	0	300 %	99,7965	199.593,00	0,23
1,6250 % ING Groep MTN fix-to-float (subordinated) 2017/2029	XS1689540935		EUR	200	0	300 %	100,6600	201.320,00	0,23
1,6250 % Mondi Finance MTN MC 2018/2026	XS1813593313		EUR	500	0	0 %	104,4970	522.485,00	0,59
1,6250 % OP Corporate Bank fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2185867673		EUR	500	2.500	2.000 %	99,8050	499.025,00	0,57
1,6250 % Vinci MTN MC 2019/2029	FR0013397452		EUR	200	0	0 %	109,7550	219.510,00	0,25
1,6500 % Capital One Financial 2019/2029	XS2010331440		EUR	500	0	0 %	100,6385	503.192,50	0,57
1,6940 % General Motors Financial MTN MC 2018/2025	XS1792505866		EUR	500	500	0 %	93,3955	466.977,50	0,53
1,7500 % A.P. Moller-Maersk MTN MC 2018/2026	XS1789699607		EUR	300	0	0 %	100,9575	302.872,50	0,34
1,7500 % Credit Agricole MTN 2019/2029	XS1958307461		EUR	300	0	0 %	107,6345	322.903,50	0,37
1,7500 % Thermo Fisher Scientific MC 2020/2027	XS2010032022		EUR	400	400	0 %	106,8470	427.388,00	0,49
1,7500 % ThyssenKrupp MTN MC 2015/2020	DE000A14J579		EUR	200	200	0 %	99,3915	198.783,00	0,23
1,7500 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	XS1974787480		EUR	200	0	0 %	98,6110	197.222,00	0,22
1,8000 % Vonovia Finance MC 2019/2025	DE000A2RWZZ6		EUR	300	0	0 %	106,1275	318.382,50	0,36
1,8500 % John Deere Cash Management 2020/2028	XS2150006307		EUR	300	500	200 %	108,4675	325.402,50	0,37
1,8750 % American Int. Group 2017/2027	XS1627602201		EUR	300	300	0 %	105,2670	315.801,00	0,36
1,8750 % Cellnex Telecom MC 2020/2029	XS2193658619		EUR	300	300	0 %	98,6890	296.067,00	0,34
2,0000 % Bertelsmann MTN MC 2020/2028	XS2149280948		EUR	300	700	400 %	108,2920	324.876,00	0,37

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
2,0000 % Credit Agricole MTN (subordinated) 2019/2029	XS1968706108		EUR	200	0	0 %	103,8935	207.787,00	0,24
2,0000 % SES S.GMTN MC 2020/2028	XS2196317742		EUR	200	200	0 %	99,6120	199.224,00	0,23
2,0000 % UniCredit MTN fix-to-float (sub.) 2019/2029	XS2055089457		EUR	400	0	300 %	90,8045	363.218,00	0,41
2,0040 % Toyota Finance Australia MTN 2020/2024	XS2156236296		EUR	200	1.000	800 %	106,8505	213.701,00	0,24
2,0500 % AT&T MC 2020/2032	XS2180008513		EUR	100	100	0 %	104,4245	104.424,50	0,12
2,1250 % Anheuser-Busch InBev MTN MC 2020/2027	BE6320934266		EUR	300	300	0 %	108,4415	325.324,50	0,37
2,1250 % Celanese US Holdings MC 2018/2027	XS1901137361		EUR	500	0	0 %	99,6795	498.397,50	0,57
2,1250 % Imperial Brands Finance MTN MC -rating sensitive- 2019/2027	XS1951313763		EUR	600	0	0 %	102,6435	615.861,00	0,70
2,1250 % NGG Finance fix-to-float (sub.) 2019/2082	XS2010045511		EUR	300	0	200 %	98,4970	295.491,00	0,34
2,1250 % Walgreens Boots Alliance -single callable- 2014/2026	XS1138360166		EUR	200	200	0 %	103,1125	206.225,00	0,23
2,1500 % Booking Holdings MC 2015/2022	XS1325825211		EUR	500	500	0 %	103,3330	516.665,00	0,59
2,2000 % Altria Group MC 2019/2027	XS1843443190		EUR	500	300	0 %	105,3600	526.800,00	0,60
2,2500 % Gazprom (via Gaz Capital) LPN 2017/2024	XS1721463500		EUR	200	0	0 %	101,8965	203.793,00	0,23
2,2500 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1195201931		EUR	100	0	0 %	100,0270	100.027,00	0,11
2,2800 % Toyota Finance Australia MTN 2020/2027	XS2156236452		EUR	100	100	0 %	111,5485	111.548,50	0,13
2,3300 % Ford Motor Credit 2019/2025	XS2052337503		EUR	600	0	0 %	88,5035	531.021,00	0,60
2,3750 % Airbus Group MTN MC 2020/2032	XS2152796426		EUR	100	400	300 %	110,0365	110.036,50	0,12
2,3750 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2015/2075	DE000A14J611		EUR	200	0	0 %	99,4810	198.962,00	0,23
2,3750 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2019/2079	XS2077670003		EUR	200	0	0 %	97,4930	194.986,00	0,22
2,3750 % Lloyds Bank Corporate Markets MTN 2020/2026	XS2151069775		EUR	400	400	0 %	107,5845	430.338,00	0,49
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH MTN MC 2020/2028	XS2151059206		EUR	700	700	0 %	108,0695	756.486,50	0,86
2,3750 % Saint Gobain MC 2020/2027	XS2150054372		EUR	400	400	0 %	110,5720	442.288,00	0,50
2,3750 % Thermo Fisher Scientific MC 2020/2032	XS2010032451		EUR	200	200	0 %	114,3955	228.791,00	0,26
2,3860 % Ford Motor Credit 2019/2026	XS2013574384		EUR	200	0	200 %	88,3645	176.729,00	0,20
2,5000 % CNP Assurances MTN fix-to-float (sub.) 2020/2051	FR0013521630		EUR	400	400	0 %	99,2265	396.906,00	0,45
2,5000 % Danaher MC 2020/2030	XS2147995372		EUR	300	300	0 %	114,8705	344.611,50	0,39
2,5000 % Exor 2014/2024	XS1119021357		EUR	300	0	0 %	106,4435	319.330,50	0,36
2,5000 % Stora Enso MTN MC 2018/2028	XS1794354628		EUR	300	0	0 %	103,2020	309.606,00	0,35
2,5000 % Telecom Italia MTN 2017/2023	XS1551678409		EUR	200	0	300 %	102,0605	204.121,00	0,23
2,5000 % ZF Europe Finance MC 2019/2027	XS2010039977		EUR	500	500	0 %	91,6490	458.245,00	0,52
2,6250 % Accor PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	FR0013457157		EUR	100	200	100 %	81,5525	81.552,50	0,09
2,6250 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1195202822		EUR	500	0	0 %	102,1090	510.545,00	0,58
2,7140 % Swiss Re Finance UK fix-to-float (sub.) 2020/2052	XS2181959110		EUR	300	300	0 %	104,0460	312.138,00	0,35

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
2,7500 % Arkema MTN PERP fix-to-float (subordinated) 2019/2099	FR0013425170		EUR	200	0	300 %	100,2550	200.510,00	0,23
2,7500 % BPCE fix-to-float (sub.) 2015/2027	FR0013063385		EUR	200	0	0 %	104,0775	208.155,00	0,24
2,7500 % NatWest Markets MTN 2020/2025	XS2150006646		EUR	100	550	450 %	107,1205	107.120,50	0,12
2,7500 % Wienerberger MC 2020/2025	AT0000A2GLA0		EUR	500	500	0 %	101,8210	509.105,00	0,58
2,8750 % Anheuser-Busch InBev MTN MC 2020/2032	BE6320935271		EUR	500	500	0 %	113,6955	568.477,50	0,65
2,8750 % Groupe Auchan MTN MC 2020/2026	FR0013510179		EUR	500	500	0 %	100,2345	501.172,50	0,57
2,8750 % LB Baden-Württ. fix-to-float (sub.) 2014/2026	XS1072249045		EUR	300	0	0 %	98,2730	294.819,00	0,33
2,8750 % OMV PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2099	XS1713462403		EUR	200	200	0 %	100,5360	201.072,00	0,23
2,8750 % Schaeffler AG MTN MC 2019/2027	DE000A2YB7B5		EUR	400	0	300 %	99,5290	398.116,00	0,45
2,9500 % Fidelity National Information Services MC 2019/2039	XS1843436145		EUR	300	300	0 %	115,2950	345.885,00	0,39
3,0000 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN (subordinated) 2014/2024	XS1069549761		EUR	200	0	0 %	107,2060	214.412,00	0,24
3,0000 % Centrica Multi Reset Notes (sub.) 2015/2076	XS1216020161		EUR	250	0	0 %	98,3195	245.798,75	0,28
3,0000 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	FR0013464922		EUR	400	0	0 %	95,0520	380.208,00	0,43
3,0000 % Italy 2019/2029	IT0005365165		EUR	400	0	0 %	115,4315	461.726,00	0,52
3,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2029	XS2010039894		EUR	200	0	300 %	90,0485	180.097,00	0,20
3,1250 % Altria Group MC 2019/2031	XS1843443786		EUR	500	500	0 %	109,3730	546.865,00	0,62
3,1250 % La Poste PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2099	FR0013331949		EUR	300	0	200 %	103,0260	309.078,00	0,35
3,1250 % PVH 2017/2027	XS1734066811		EUR	300	300	800 %	96,6615	289.984,50	0,33
3,1250 % Sappi Papier Holding MC 2019/2026	XS1961852750		EUR	300	0	0 %	85,9420	257.826,00	0,29
3,1250 % SoftBank Group MC 2017/2025	XS1684385161		EUR	300	0	0 %	95,9410	287.823,00	0,33
3,2500 % BP Capital Markets PERP fix-to-float 2020/2099	XS2193661324		EUR	500	500	0 %	100,2220	501.110,00	0,57
3,2500 % Schaeffler Finance MC 2015/2025	XS1212470972		EUR	700	0	0 %	99,4370	696.059,00	0,79
3,3750 % AXA MTN fix-to-float (subord.) 2016/2047	XS1346228577		EUR	250	0	0 %	109,9280	274.820,00	0,31
3,3750 % Goldman Sachs 2020/2025	XS2149207354		EUR	300	600	300 %	111,4765	334.429,50	0,38
3,6250 % BP Capital Markets PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2193662728		EUR	400	400	0 %	100,3775	401.510,00	0,46
3,6480 % Bank of America MTN fix-to-float 2020/2029	XS2148370211		EUR	300	700	400 %	119,5180	358.554,00	0,41
3,7500 % Repsol Int. Finance PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2185997884		EUR	300	300	0 %	99,7120	299.136,00	0,34
4,0000 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2018/2099	FR0013367612		EUR	200	0	0 %	102,0525	204.105,00	0,23
4,0000 % METRO MTN 2012/2022	XS0801202069		EUR	700	0	0 %	104,0110	728.077,00	0,83
4,0000 % Sappi Papier Holding MC 2016/2023	XS1383922876		EUR	600	100	0 %	91,4075	548.445,00	0,62
4,1250 % Gas Natural Fenosa Fin PERP Multi Reset Nts.(sub.) 2014/2099	XS1139494493		EUR	300	0	0 %	102,8335	308.500,50	0,35
4,2470 % Repsol Int. Finance PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2186001314		EUR	300	300	0 %	101,2555	303.766,50	0,35

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
4,2500 % Aareal Bank MTN fix-to-float (subord.) 2014/2026	DE000A1TNC94		EUR	500	0	0 %	93,4395	467.197,50	0,53
4,2500 % Ziggo Secured Finance MC 2016/2027	XS1493836461		EUR	1.000	0	0 %	93,0140	930.141,00	1,06
4,3750 % Accor PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	FR0013399177		EUR	200	0	0 %	91,1955	182.391,00	0,21
4,5000 % Credit Agricole Assurances fix-to-float (subord.) 2014/2099	FR0012222297		EUR	500	0	0 %	109,4295	547.147,50	0,62
5,6250 % BHP Billiton Finance Multi Reset Notes (sub.) 2015/2079	XS1309436910		EUR	200	0	0 %	116,0070	232.014,00	0,26
5,6250 % SES PERP Multi Reset Notes (sub.) 2016/2099	XS1405765659		EUR	300	0	0 %	102,8650	308.595,00	0,35
6,9500 % UniCredit MTN (subord.) 2012/2022	XS0849517650		EUR	300	0	0 %	110,1800	330.540,00	0,38
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	4.865.446,00	5,53
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	4.865.446,00	5,53
0,2500 % Comcast MC 2020/2027	XS2114852218		EUR	200	500	300 %	98,2995	196.599,00	0,22
0,7500 % Equinor MTN MC 2020/2026	XS2178833427		EUR	100	100	0 %	102,8765	102.876,50	0,12
0,8750 % LYB International Finance II MC 2019/2026	XS2052310054		EUR	500	0	0 %	96,1250	480.625,00	0,55
1,0000 % Blackstone Holdings Finance 2016/2026	XS1499602289		EUR	500	0	0 %	101,9930	509.965,00	0,58
1,5000 % ADLER Real Estate MC 2019/2022	XS1843441491		EUR	200	0	0 %	97,6995	195.399,00	0,22
1,6000 % Deutsche Bahn Finance PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	XS2010039548		EUR	200	0	0 %	97,6265	195.253,00	0,22
1,6250 % Grifols MC 2019/2025	XS2076836555		EUR	200	0	0 %	97,8105	195.621,00	0,22
1,7500 % Exor MC 2019/2034	XS2058888616		EUR	500	500	0 %	92,6110	463.055,00	0,53
2,1250 % Ardagh Packaging Fin/MP Holdings USA REGS MC 2020/2026	XS2189356996		EUR	200	400	200 %	96,2570	192.514,00	0,22
2,1250 % ING Groep MTN fix-to-float (sub.) 2020/2031	XS2176621170		EUR	400	400	0 %	102,5510	410.204,00	0,47
2,2500 % Grifols MC 2019/2027	XS2077646391		EUR	100	0	0 %	98,5960	98.596,00	0,11
2,8750 % Equinix MC 2017/2025	XS1679781424		EUR	1.000	0	0 %	101,9275	1.019.275,00	1,16
2,8750 % OI European Group MC 2019/2025	XS2077666316		EUR	300	0	0 %	96,7850	290.355,00	0,33
2,8750 % Quintiles IMS Health S.REGS MC 2020/2028	XS2189947505		EUR	200	400	200 %	99,5540	199.108,00	0,23
3,8750 % Netflix 2019/2029	XS1989380172		EUR	300	0	0 %	105,3335	316.000,50	0,36
Summe Wertpapiervermögen								86.336.766,96	98,07
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	383.475,50	0,44
Swaps							EUR	383.475,50	0,44
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Credit Default Swaps							EUR	383.475,50	0,44
Protection Seller									
AT&T Inc. / 100 BP (GS) 17.10.19-20.6.24		OTC	EUR	-1.000				-2.055,76	-0,00
Anheuser-Busch InBev MTN / 100 BP (BOA-SEC) 13.6.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.500				18.597,53	0,02
ArcelorMittal MTN / 500 BP (BOASEC) 21.5.19-20.6.24		OTC	EUR	-500				47.636,18	0,05
Berkshire Hathaway MC / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.12.22		OTC	EUR	-500				10.818,02	0,01
Credit Agricole / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.500				32.080,94	0,04
Equinor MTN / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.500				34.366,71	0,04
Innogy Finance MTN / 100 BP (CSSS) 24.10.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.500				37.446,93	0,04

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
Lanxess -single callable- / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.24		OTC	EUR	-1.000				19.232,67	0,02
Nat. Westminster Bank MTN (covered) / 100 BP (BNP) 28.9.18-20.12.21		OTC	EUR	-500				5.736,85	0,01
NatWest Markets MTN / 100 BP (BNP) 10.11.16-20.12.21		OTC	EUR	-500				5.722,97	0,01
Shell Int. Finance MTN FRN / 100 BP (BNP) 23.8.18-20.6.23		OTC	EUR	-1.500				24.282,64	0,03
Sky Ltd. / 100 BP (GS) 17.10.19-20.12.22		OTC	EUR	-1.000				23.493,50	0,03
Societe Generale MTN (subordinated) / 100 BP (BOASEC) 13.6.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.000				-3.944,50	-0,00
UBS (Stamford Branch) (subord.) / 100 BP (BOA-SEC) 13.6.19-20.6.22		OTC	EUR	-1.500				12.434,33	0,01
iTraxx Europe Crossover Index S.32 -5 Jahre- / 500 BP (CSSS) 25.2.20-20.12.24		OTC	EUR	-5.000				241.848,52	0,27
Protection Buyer									
METRO MTN / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.9.22		OTC	EUR	700				2.321,79	0,00
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.22		OTC	EUR	1.500				-126.543,82	-0,14
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	890.575,67	1,01
Bankguthaben							EUR	890.575,67	1,01
EUR - Guthaben bei							EUR	890.575,67	1,01
Verwahrstelle			EUR	890.575,67				890.575,67	1,01
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	487.756,34	0,55
Ansprüche aus Credit Default Swaps			EUR					10.500,00	0,01
Zinsansprüche			EUR					477.256,34	0,54
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾							EUR	-65.240,40	-0,07
Fondsvermögen							EUR	88.033.334,07	100,00²⁾
Anteilwert							EUR	24,78	
Umlaufende Anteile							STK	3.552.290,977	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									98,07
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,44

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung und Verbindlichkeiten aus Credit Default Swaps

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 98,51 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 1,49 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Marktschlüssel

OTC	Over-the-Counter
-----	------------------

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 Schulscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Allianz Finance II MC 2020/2025	DE000A28RSQ8	EUR	300	300
0,0000 % Henkel MTN -single callable- 2016/2021	XS1488418960	EUR	1.000	1.000
0,0000 % Orange MTN MC 2019/2026	FR0013444676	EUR	0	700
0,0000 % Siemens Finanzierungsmat. MTN 2020/2026	XS2118280218	EUR	200	200
0,0000 % Volvo Treasury MTN MC 2020/2023	XS2115085230	EUR	700	700
0,0500 % Caisse Centrale Desjardins du Quebec 2019/2027	XS2083301106	EUR	0	750
0,1000 % ING Groep MTN fix-to-float 2019/2025	XS2049154078	EUR	0	200
0,1250 % Bank of Nova Scotia MTN 2019/2026	XS2049707180	EUR	0	300
0,1250 % Essilor International MTN MC 2019/2025	FR0013463650	EUR	0	200
0,1250 % Merck Financial Services MTN MC 2020/2025	XS2102916793	EUR	500	500
0,2500 % Lloyds Bank Corporate Markets MTN 2019/2022	XS2059885058	EUR	0	500
0,2500 % Telenor MTN MC 2020/2028	XS2117452156	EUR	1.000	1.000
0,2500 % Toyota Finance Australia MTN 2019/2024	XS1978200639	EUR	0	300
0,2500 % Toyota Motor Credit MTN 2020/2026	XS2102948994	EUR	600	600
0,3000 % IBM 2020/2028	XS2115091717	EUR	900	900
0,3500 % E.ON MTN MC 2019/2030	XS2047500926	EUR	0	300
0,3750 % BMW Finance MTN 2020/2027	XS2102357014	EUR	500	500
0,4000 % Swedbank MTN 2018/2023	XS1870225338	EUR	0	500
0,4500 % General Mills MC 2020/2026	XS2100788780	EUR	400	400
0,5000 % Citigroup MTN MC 2019/2027	XS2063232727	EUR	0	500
0,5000 % Commonwealth Bank Austr. (covered) 2016/2026	XS1458458665	EUR	0	1.000
0,5000 % Deutsche Telekom MTN 2019/2027	XS2024715794	EUR	0	500
0,5000 % Dow Chemical MC 2020/2027	XS2122485845	EUR	500	500
0,5000 % Holcim Finance MTN MC 2019/2026	XS2081615473	EUR	0	400
0,5000 % Solvay MC 2019/2029	BE6315847804	EUR	0	200
0,5000 % Vattenfall MTN MC 2019/2026	XS2009891479	EUR	0	400
0,6000 % OP Corporate Bank MTN 2020/2027	XS2102924383	EUR	1.300	1.300
0,6250 % Air Liquide Finance MTN MC 2019/2030	FR0013428067	EUR	0	600
0,6250 % Carlsberg Breweries MTN MC 2020/2030	XS2133071774	EUR	300	300
0,6250 % Fresenius Medical Care MTN MC 2019/2026	XS2084497705	EUR	0	200
0,6250 % La Poste MTN 2020/2026	FR0013508686	EUR	300	300
0,6250 % Macquarie Group 2020/2027	XS2105735935	EUR	500	500
0,6250 % Royal Bank of Canada (covered) 2018/2025	XS1876471183	EUR	0	1.000
0,6320 % Sumitomo Mitsui Financial Group MTN 2019/2029	XS2066392452	EUR	0	300
0,6500 % Credit Suisse Group MTN fix-to-float 2020/2028	CH0517825276	EUR	200	200
0,7500 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN 2019/2026	FR0013412947	EUR	0	1.000
0,7500 % Fresenius MTN MC 2020/2028	XS2101357072	EUR	200	200
0,7500 % National Grid North America MTN 2018/2023	XS1864037541	EUR	0	300
0,7500 % PKO Bank Polski MTN 2017/2021	XS1650147660	EUR	0	200
0,7500 % PepsiCo MC 2019/2027	XS1963553919	EUR	0	500
0,7500 % Royal Bank of Scotland Group fix to float 2019/2025	XS2080205367	EUR	0	500
0,7500 % UBS London MTN -single callable- 2020/2023	XS2149270477	EUR	300	300
0,8500 % Standard Chartered Bank MTN fix-to-float 2020/2028	XS2102360315	EUR	500	500
0,8750 % Commerzbank MTN 2020/2027	DE000CZ45VM4	EUR	600	600
0,8750 % Erste Group Bank MTN 2020/2027	AT0000A2GH08	EUR	1.500	1.500
0,8750 % ISS Global MTN MC 2019/2026	XS2013618421	EUR	0	300
0,8750 % LEG Immobilien MTN MC 2019/2027	DE000A254P51	EUR	0	400

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

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schultdscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
0,8750 % NASDAQ MC 2020/2030	XS2010032881	EUR	500	500
0,8750 % Sanofi MTN MC 2019/2029	FR0013409844	EUR	0	600
0,8750 % Thermo Fisher Scientific MC 2019/2031	XS2058556619	EUR	0	400
0,9500 % Italy BTP 2018/2023	IT0005325946	EUR	0	500
1,0000 % Air Liquide Finance MTN MC 2020/2025	FR0013505559	EUR	200	200
1,0000 % Bank of Ireland Group MTN fix-to-float 2019/2025	XS2082969655	EUR	0	400
1,0000 % Credit Suisse Group MTN fix-to-float 2019/2027	CH0483180946	EUR	0	300
1,0000 % E.ON MTN MC 2020/2025	XS2152899584	EUR	200	200
1,0000 % Svenska Handelsbanken MTN 2020/2025	XS2156510021	EUR	500	500
1,1250 % Banco BPM (covered) 2018/2023	IT0005340374	EUR	0	700
1,1250 % Nestle Finance International MC 2020/2026	XS2148372696	EUR	200	200
1,2080 % Becton Dickinson Euro Finance MC 2019/2026	XS2002532724	EUR	0	500
1,2500 % FCA Bank MTN MC 2019/2022	XS1954697923	EUR	0	400
1,2500 % Fresenius Medical Care MTN MC 2019/2029	XS2084488209	EUR	0	200
1,2500 % Goldman Sachs Group -single callable- 2016/2025	XS1509006380	EUR	0	200
1,2500 % Orange MTN MC 2020/2027	FR0013506292	EUR	200	200
1,2500 % Renault MTN MC 2019/2025	FR0013428414	EUR	0	500
1,2500 % Suez MTN MC 2020/2027	FR0013505542	EUR	500	500
1,2500 % Suez MTN S.APRI MC 2019/2028	FR0013508348	EUR	500	500
1,2500 % Unilever MTN MC 2020/2025	XS2147133495	EUR	500	500
1,3750 % Air Liquide Finance MTN MC 2020/2030	FR0013505567	EUR	200	200
1,3750 % Bank of Ireland Group MTN 2018/2023	XS1872038218	EUR	0	700
1,3750 % Engie MC 2020/2025	FR0013504644	EUR	300	300
1,3750 % ITV MC 2019/2026	XS2050543839	EUR	0	300
1,3750 % Philips (Konin.) MC 2020/2025	XS2149368529	EUR	200	200
1,3750 % Skand. Enskilda MTN fix-to-float (subord.) 2016/2028	XS1511589605	EUR	0	200
1,3750 % Wendel MC 2019/2026	FR0013417128	EUR	0	300
1,4010 % Becton Dickinson MC 2018/2023	XS1822506272	EUR	0	300
1,4500 % Aroundtown MTN MC 2019/2028	XS2023873149	EUR	0	300
1,5000 % America Movil 2016/2024	XS1379122101	EUR	0	400
1,5000 % Bayer Cap. Corp. MTN MC 2018/2026	XS1840618059	EUR	0	300
1,5000 % Blackstone Holdings Finance MC 2019/2029	XS1979490239	EUR	0	600
1,5000 % Deutsche Bank MTN 2017/2022	DE000DL19TA6	EUR	0	300
1,5000 % McKesson MC 2017/2025	XS1567174286	EUR	0	300
1,5000 % Nestle Finance International MTN MC 2020/2030	XS2148390755	EUR	100	100
1,5000 % Sanofi MTN MC 2020/2030	FR0013505112	EUR	700	700
1,5000 % Swedbank MTN fix-to-float (subordinated) 2018/2028	XS1880928459	EUR	0	200
1,6250 % CRH Funding MC 2020/2030	XS2169281487	EUR	100	100
1,6250 % Deutsche Bank MTN 2020/2027	DE000DL19U23	EUR	300	300
1,6250 % Fresenius MTN MC 2020/2027	XS2152329053	EUR	400	400
1,6250 % Heineken MTN MC 2020/2025	XS2147977479	EUR	500	500
1,7000 % Altria Group MC 2019/2025	XS1843443513	EUR	0	500
1,7500 % Accor MC 2019/2026	FR0013399029	EUR	0	500
1,7500 % ArcelorMittal MTN MC 2019/2025	XS2082324018	EUR	0	500
1,7500 % Banco BPM MTN 2019/2025	XS2072815066	EUR	0	300
1,7500 % Coca-Cola European Partners MC 2020/2026	XS2134245138	EUR	300	300
1,7500 % Engie MTN MC 2020/2028	FR0013504677	EUR	500	500
1,7500 % NASDAQ MC 2019/2029	XS1843442622	EUR	0	300
1,7500 % Societe Generale MTN 2019/2029	FR0013410818	EUR	0	800
1,7500 % Unilever MC 2020/2030	XS2147133578	EUR	500	500
1,8740 % British Telecom fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2119468572	EUR	350	350
1,8750 % Diageo Finance MC 2020/2027	XS2147889427	EUR	400	400
1,8750 % Fresenius MTN MC 5.6Y 2019/2025	XS1936208252	EUR	0	200
1,9500 % American Tower MC 2018/2026	XS1823300949	EUR	0	200

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

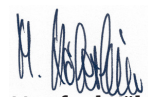
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schulscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
2,0000 % Airbus Group 2020/2028	XS2152796269	EUR	300	300
2,0000 % Koninklijke KPN PERP fix-to-float (subord.) 2019/2099	XS2069101868	EUR	0	700
2,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2026	XS2010039381	EUR	0	500
2,1000 % Danaher MC 2020/2026	XS2147995299	EUR	250	250
2,1250 % Ardagh Packaging Finance/A. MP Holdings USA MC 2019/2026	XS2036387525	EUR	0	100
2,1250 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2019/2027	FR0013398070	EUR	0	800
2,1250 % Ineos Finance MC 2017/2025	XS1577947440	EUR	0	200
2,2000 % John Deere Cash Management MTN 2020/2032	XS2150006562	EUR	300	300
2,2500 % AIB Group MTN 2018/2025	XS1849550592	EUR	0	400
2,2500 % Heineken MTN MC 2020/2030	XS2147977636	EUR	300	300
2,2500 % INEOS Styrolution Group MC 2020/2027	XS2108560306	EUR	1.000	1.000
2,2500 % IQVIA MC 2019/2028	XS2036798150	EUR	0	100
2,2500 % Vonovia Finance MC 2020/2030	DE000A28VQD2	EUR	200	200
2,3750 % Holcim Finance MTN MC 2020/2025	XS2156244043	EUR	300	300
2,5000 % Diageo Finance MTN MC 2020/2032	XS2147889690	EUR	300	300
2,5000 % Rabobank Nederland fix-to-float (sub.) 2014/2026	XS1069772082	EUR	0	200
2,5000 % Tesco Corporate Treasury Services MTN 2014/2024	XS1082971588	EUR	0	300
2,6250 % Carrefour MTN MC 2020/2027	FR0013505260	EUR	1.200	1.200
2,6250 % Daimler MTN 2020/2025	DE000A289RN6	EUR	400	400
2,6250 % Deutsche Bank MTN 2019/2026	DE000DL19US6	EUR	300	300
2,6250 % RCI Banque fix-to-float (sub.) 2019/2030	FR0013459765	EUR	0	400
2,6250 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2017/2099	XS1731823255	EUR	0	200
2,7310 % UniCredit fix-to-float (sub.) 2020/2032	XS2101558307	EUR	1.500	1.500
2,7500 % Banque Postale MTN fix-to-float (subordinated) 2014/2026	FR0011855865	EUR	0	200
3,1000 % Vodafone Group fix-to-float (sub.) 2018/2079	XS1888179477	EUR	0	400
3,2500 % Credit Suisse Group MTN MC 2020/2026	CH0537261858	EUR	400	400
3,2500 % IQVIA MC 2017/2025	XS1533922776	EUR	0	200
3,3250 % MPT Operating Partnership/MPT Finance MC 2017/2025	XS1523028436	EUR	300	400
3,3750 % Barclays Bank MTN fix-to-float 2020/2025	XS2150054026	EUR	700	700
3,5000 % Lloyds Banking Group MTN fix-to-float 2020/2026	XS2148623106	EUR	350	350
3,5000 % Unitymedia Hessen GmbH&Co.KG/U. NRW GmbH MC 2015/2020	XS1197205591	EUR	0	800
3,8750 % Belden MC (subordinated) 2018/2028	XS1789515134	EUR	0	200
4,2000 % Volvo Treasury Multi Reset Notes (sub.) 2014/2020	XS1150673892	EUR	0	300
6,6250 % Barclays Bank MTN (subordinated) 2011/2022	XS0611398008	EUR	0	350
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,2500 % Schneider Electric MTN MC 2020/2029	FR0013494168	EUR	500	500
0,3390 % Mitsubishi UFJ Financial Group 2019/2024	XS2028899727	EUR	0	400
0,7500 % America Movil MTN MC 2019/2027	XS2006277508	EUR	0	300
0,7500 % Crown European Holdings 2019/2023	XS2071622216	EUR	0	800
0,9000 % McDonald's MTN MC 2019/2026	XS1963744260	EUR	0	500
1,0000 % NatWest Markets MTN S.NOV 2019/2024	XS2082803417	EUR	0	500
1,3750 % Telia Company MTN Multi Reset Notes (subord.) 2020/2081	XS2082429890	EUR	700	700
1,5000 % Smurfit Kappa Acquisitions MC 2019/2027	XS2050968333	EUR	0	500
2,0000 % Dufry One MC 2019/2027	XS2079388828	EUR	200	500
2,0000 % Philips (Konin.) MC 2020/2030	XS2149379211	EUR	400	400
2,3750 % International Game Technology MC 2019/2028	XS2051904733	EUR	0	200
3,1250 % OI European Group MC 2016/2024	XS1405765907	EUR	0	200

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. 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 (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)		
Credit Default Swaps		
Protection Seller	EUR	5.000
(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Index S.32 -5 Jahre- / 500 BP (CSSS) 3.2.20-20.12.24)		
Protection Buyer	EUR	11.500
(Basiswert(e): Philips (Konin.) / 100 BP (JPM-AG) 2.4.20-20.12.24, iTraxx Europe Crossover Index S.32 -5 Jahre- / 500 BP (JPM-AG) 6.1.20-20.12.24)		

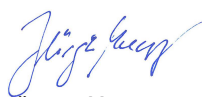
Köln, im August 2020

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

Joh. Berenberg, Gossler & Co. KG
Neuer Jungfernstieg 20
20354 Hamburg
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.

Besonderheiten für Anleger aus Österreich

Zahl- und Informationsstelle

Capital Bank – GRAWE Gruppe AG
Burgring 16
8010 Graz
Österreich

Steuerlicher Vertreter

Deloitte Tax Wirtschaftsprüfungs GmbH
Renngasse 1/Freyung
1010 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.com).

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 § 305 KAGB im Verkaufsprospekt (Widerrufsrechte bei „Haustürgeschäften“) gilt, dass für österreichische Anleger § 3KSchG 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@ampega.com
Web www.ampega.com