

Halbjahresbericht

Ampega Faktor StrategiePlus

1. Oktober 2019 bis 31. März 2020

OGAW-Sondervermögen



Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 31.03.2020

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	94.569.574,55	95,06
Belgien	2.903.538,30	2,92
Deutschland	23.124.941,62	23,25
Finnland	1.903.989,50	1,91
Frankreich	35.983.679,37	36,17
Großbritannien	1.785.224,58	1,79
Irland	2.699.235,00	2,71
Italien	3.662.700,13	3,68
Niederlande	12.543.202,84	12,61
Spanien	9.963.063,21	10,01
Derivate	-11.297.409,98	-11,36
Aktienindex-Derivate	-11.297.409,98	-11,36
Bankguthaben	15.993.437,58	16,08
Sonstige Vermögensgegenstände	265.604,21	0,27
Verbindlichkeiten	-49.200,21	-0,05
Fondsvermögen	99.482.006,15	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	94.569.574,55	95,06
Aktien							EUR	94.569.574,55	95,06
Belgien							EUR	2.903.538,30	2,92
Ageas SA	BE0974264930		STK	14.975	0	7.300	EUR 35,0700	525.173,25	0,53
Groupe Bruxelles Lambert SA	BE0003797140		STK	10.752	7.300	7.000	EUR 70,2800	755.650,56	0,76
KBC Groep NV	BE0003565737		STK	15.877	0	0	EUR 40,3700	640.954,49	0,64
UCB SA	BE0003739530		STK	13.000	0	0	EUR 75,5200	981.760,00	0,99
Deutschland							EUR	23.124.941,62	23,25
Allianz SE	DE0008404005		STK	19.600	10.100	0	EUR 152,8400	2.995.664,00	3,01
BASF SE	DE000BASF111		STK	36.904	21.500	0	EUR 42,4550	1.566.759,32	1,57
Beiersdorf AG	DE0005200000		STK	10.230	0	0	EUR 93,6200	957.732,60	0,96
Deutsche Börse AG	DE0005810055		STK	13.979	5.500	0	EUR 125,5000	1.754.364,50	1,76
Deutsche Post AG	DE0005552004		STK	75.720	40.500	6.000	EUR 24,5600	1.859.683,20	1,87
Deutsche Telekom AG	DE0005557508		STK	199.000	89.000	0	EUR 11,9860	2.385.214,00	2,40
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	89.000	0	0	EUR 9,5470	849.683,00	0,85
Fresenius SE & Co KGaA St.	DE0005785604		STK	30.000	0	0	EUR 33,8850	1.016.550,00	1,02
HeidelbergCement AG	DE0006047004		STK	15.000	0	0	EUR 36,9300	553.950,00	0,56
Merck KGaA	DE0006599905		STK	9.300	2.000	3.700	EUR 89,5000	832.350,00	0,84
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026		STK	10.000	3.000	1.170	EUR 181,4000	1.814.000,00	1,82
SAP SE	DE0007164600		STK	29.900	11.929	0	EUR 102,1800	3.055.182,00	3,07
Siemens AG	DE0007236101		STK	35.400	17.515	0	EUR 75,2600	2.664.204,00	2,68
Siemens Healthineers AG	DE000SHL1006		STK	23.000	0	0	EUR 35,6350	819.605,00	0,82

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Finnland							EUR	1.903.989,50	1,91
Kone Oyj	FI0009013403		STK	17.815	0	0 EUR	50,6000	901.439,00	0,91
Sampo PLC	FI0009003305		STK	38.934	17.000	0 EUR	25,7500	1.002.550,50	1,01
Frankreich							EUR	35.983.679,37	36,17
AXA SA	FR0000120628		STK	102.000	44.000	0 EUR	15,3460	1.565.292,00	1,57
Air Liquide SA	FR0000120073		STK	25.806	12.892	1 EUR	112,6000	2.905.755,60	2,92
Bureau Veritas SA	FR0006174348		STK	43.594	0	0 EUR	17,0000	741.098,00	0,74
CNP Assurances SA	FR0000120222		STK	55.000	55.000	0 EUR	8,7200	479.600,00	0,48
Covivio SA REIT	FR0000064578		STK	10.275	0	0 EUR	52,4500	538.923,75	0,54
Danone SA	FR0000120644		STK	29.675	9.400	0 EUR	57,1200	1.695.036,00	1,70
Eiffage SA	FR0000130452		STK	8.121	0	2.000 EUR	66,0000	535.986,00	0,54
Engie SA	FR0010208488		STK	149.000	49.000	0 EUR	9,4500	1.408.050,00	1,42
Essilor International SA	FR0000121667		STK	10.163	0	0 EUR	99,4200	1.010.405,46	1,02
Gecina SA REIT	FR0010040865		STK	6.876	0	0 EUR	121,7000	836.809,20	0,84
ICADE EMGP SA REIT	FR0000035081		STK	9.767	0	0 EUR	72,8000	711.037,60	0,71
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014		STK	8.200	3.612	0 EUR	350,0000	2.870.000,00	2,88
Legrand SA	FR0010307819		STK	12.415	0	2.800 EUR	57,5800	714.855,70	0,72
Orange SA	FR0000133308		STK	148.983	51.000	0 EUR	11,2100	1.670.099,43	1,68
Oreal (L') SA	FR0000120321		STK	12.519	5.400	0 EUR	246,3000	3.083.429,70	3,10
Pernod Ricard SA	FR0000120693		STK	4.366	0	2.100 EUR	130,7500	570.854,50	0,57
Saint-Gobain (Cie. de) SA	FR0000125007		STK	32.000	26.500	26.500 EUR	21,4450	686.240,00	0,69
Sanofi SA	FR0000120578		STK	34.609	9.000	0 EUR	80,5100	2.786.370,59	2,80
Schneider Electric SE	FR0000121972		STK	32.384	14.200	0 EUR	79,2200	2.565.460,48	2,58
Scor SE	FR0010411983		STK	23.601	0	0 EUR	20,0600	473.436,06	0,48
Sodexo SA	FR0000121220		STK	10.000	0	0 EUR	59,4800	594.800,00	0,60
Total SA	FR0000120271		STK	96.000	53.905	0 EUR	33,5700	3.222.720,00	3,24
Veolia Environnement SA	FR0000124141		STK	35.348	30.500	39.000 EUR	19,7250	697.239,30	0,70
Vinci SA	FR0000125486		STK	34.400	17.400	2.600 EUR	73,0000	2.511.200,00	2,52
Vivendi SA	FR0000127771		STK	61.000	14.000	0 EUR	18,1800	1.108.980,00	1,11
Großbritannien							EUR	1.785.224,58	1,79
Coca-Cola Euro- pean Partners PLC	GB00BDCPN049		STK	25.500	7.000	0 EUR	32,3500	824.925,00	0,83
Relx PLC	GB00B2B0DG97		STK	49.449	35.000	30.000 EUR	19,4200	960.299,58	0,97
Irland							EUR	2.699.235,00	2,71
Linde PLC	IE00BZ12WP82		STK	17.100	6.100	0 EUR	157,8500	2.699.235,00	2,71
Italien							EUR	3.662.700,13	3,68
Assicurazioni Generali SpA	IT0000062072		STK	42.162	0	21.000 EUR	12,3650	521.333,13	0,52
Enel SpA	IT0003128367		STK	240.000	0	0 EUR	6,3860	1.532.640,00	1,54
Eni SpA	IT0003132476		STK	73.371	0	0 EUR	8,5930	630.477,00	0,63
Recordati SpA	IT0003828271		STK	25.000	0	0 EUR	39,1300	978.250,00	0,98
Niederlande							EUR	12.543.202,84	12,61
ASML Holding NV	NL0010273215		STK	5.000	5.000	0 EUR	244,7500	1.223.750,00	1,23
Akzo Nobel NV	NL0013267909		STK	16.000	5.354	0 EUR	61,8000	988.800,00	0,99
Heineken NV	NL0000009165		STK	11.000	0	0 EUR	73,0200	803.220,00	0,81
Koninklijke Ahold Delhaize NV	NL0011794037		STK	71.801	30.000	17.000 EUR	21,4850	1.542.644,49	1,55
Koninklijke DSM NV	NL0000009827		STK	8.902	6.200	6.000 EUR	103,8000	924.027,60	0,93
NN Group NV	NL0010773842		STK	26.999	0	0 EUR	24,4300	659.585,57	0,66
Philips NV (Konin.)	NL0000009538		STK	52.624	28.100	6.900 EUR	36,7000	1.931.300,80	1,94
Royal Dutch Shell PLC -Class A-	GB00B03MLX29		STK	74.500	40.072	0 EUR	15,1500	1.128.675,00	1,13
Unilever NV	NL0000388619		STK	60.074	24.300	0 EUR	43,7500	2.628.237,50	2,64
Wolters Kluwer NV	NL0000395903		STK	11.433	0	6.000 EUR	62,3600	712.961,88	0,72
Spanien							EUR	9.963.063,21	10,01
Aena SA	ES0105046009		STK	6.057	0	0 EUR	100,3000	607.517,10	0,61
Amadeus IT Group SA	ES0109067019		STK	26.000	6.023	0 EUR	43,6300	1.134.380,00	1,14
Endesa SA	ES0130670112		STK	40.000	0	0 EUR	19,3900	775.600,00	0,78

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Gas Natural SDG SA	ES0116870314		STK	40.091	0	0 EUR	15,7850	632.836,44	0,64
Iberdrola SA	ES0144580Y14		STK	303.662	100.757	0 EUR	8,7100	2.644.896,02	2,66
Inditex SA	ES0148396007		STK	79.400	50.000	17.000 EUR	22,7100	1.803.174,00	1,81
Red Electrica Corporacion SA	ES0173093024		STK	55.000	0	0 EUR	16,9250	930.875,00	0,94
Repsol SA	ES0173516115		STK	66.219	1.947	0 EUR	7,5920	502.734,65	0,51
Telefonica SA	ES0178430E18		STK	225.000	90.000	0 EUR	4,1380	931.050,00	0,94
Summe Wertpapiervermögen								94.569.574,55	95,06
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)						EUR		-11.297.409,98	-11,36
Aktienindex-Derivate						EUR		-11.297.409,98	-11,36
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte						EUR		-11.297.409,98	-11,36
Euro Stoxx 50 Future Juni 2020		EUREX	STK	-3.200				-11.297.409,98	-11,36
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR		15.993.437,58	16,08
Bankguthaben						EUR		15.993.437,58	16,08
EUR - Guthaben bei						EUR		15.993.437,58	16,08
Verwahrstelle			EUR	15.993.437,58				15.993.437,58	16,08
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR		265.604,21	0,27
Dividendenansprüche			EUR					65.280,00	0,07
Quellensteuerrück- stattungsansprüche			EUR					200.324,21	0,20
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR		-49.200,21	-0,05
Fondsvermögen						EUR		99.482.006,15	100,00²⁾
Anteilwert Klasse I (a)						EUR		96,60	
Anteilwert Klasse P (a)						EUR		95,04	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)						STK		736.461,988	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)						STK		298.227,376	
Fondsvermögen Anteilsklasse I (a)						EUR		71.139.830,27	
Fondsvermögen Anteilsklasse P (a)						EUR		28.342.175,88	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									95,06
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									-11,36

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren und Verwahrstellenvergütung

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

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

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

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

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

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis des Vortages.

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

Zum Stichtag 31. März 2020 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 100 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Marktschlüssel**Terminbörsen**

EUREX

European Exchange Deutschland

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

per 30.03.2020 oder letztbekannte

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

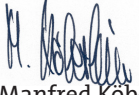
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schulscheindarlehen (Marktzusordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Belgien				
Anheuser-Busch InBev NV	BE0974293251	STK	8.000	22.715
Deutschland				
Bayer AG	DE000BAY0017	STK	10.500	10.500
Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft St.	DE0005190003	STK	0	13.593
Evonik Industries AG	DE000EVNK013	STK	0	31.358
Finnland				
Nordea Bank Holding ABP	FI4000297767	STK	0	2.193
UPM-Kymmene Corp.	FI0009005987	STK	26.000	26.000
Frankreich				
Accor SA	FR0000120404	STK	0	22.330
Michelin SA	FR0000121261	STK	5.800	5.800
Publicis Groupe SA	FR0000130577	STK	13.600	30.600
Rubis SCA	FR0013269123	STK	13.000	13.000
WFD Unibail-Rodamco NV REIT	FR0013326246	STK	0	6.072
Großbritannien				
AstraZeneca PLC	GB0009895292	STK	9.500	9.500
Niederlande				
ABN AMRO Group NV	NL0011540547	STK	0	39.562
Schweden				
Investor AB -Class B-	SE0000107419	STK	17.000	17.000
Schweiz				
Nestle SA	CH0038863350	STK	7.000	7.000
Swiss Re AG	CH0126881561	STK	8.000	8.000
Spanien				
Activ. de Construcción y Servicios SA	ES0167050915	STK	0	23.400
Iberdrola SA -BZR-	ES06445809J6	STK	202.905	202.905
Repsol S.A. Inh. -Anr-	ES06735169F2	STK	64.272	64.272
Repsol S.A. Inh. 12/19	ES0173516172	STK	1.947	1.947
Sonstige Beteiligungswertpapiere				
Roche Holding AG GS	CH0012032048	STK	2.700	2.700
Nicht notierte Wertpapiere				
Aktien				
Spanien				
Iberdrola SA (new shares)	ES0144583210	STK	3.758	3.758

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)		
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Verkaufte Kontrakte	EUR	114.498
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)		

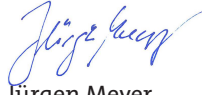
Köln, im Mai 2020

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 31.03.2020)
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

Kreissparkasse Köln
Neumarkt 18 - 24
50667 Köln
Deutschland

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Auslagerung

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

Aufsichtsbehörde

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

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



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

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