ampega.
Talanx Investment Group

Halbjahresbericht

Ampega Rendite Rentenfonds

1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020

OGAW-Sondervermögen

Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.06.2020

	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	**343.056.965,70**	**90,99**
Australien	15.360.247,20	4,07
Belgien	5.091.131,00	1,35
Deutschland	39.230.167,50	10,40
Europäische Institutionen	7.657.885,00	2,03
Finnland	12.889.265,00	3,42
Frankreich	64.609.218,50	17,14
Großbritannien	15.727.887,50	4,17
Irland	7.485.018,00	1,99
Italien	38.579.773,50	10,23
Japan	959.410,00	0,25
Jersey	531.010,00	0,14
Kaimaninseln	1.075.910,00	0,29
Kanada	18.948.044,00	5,03
Litauen	3.725.890,00	0,99
Luxemburg	4.926.325,00	1,31
Mexiko	5.416.910,00	1,44
Niederlande	16.142.328,00	4,28
Norwegen	2.323.665,50	0,62
Polen	10.727.909,50	2,85
Portugal	2.003.350,00	0,53
Schweden	10.804.259,50	2,87
Schweiz	1.210.937,00	0,32
Singapur	8.718.687,50	2,31
Slowenien	1.504.305,00	0,40
Spanien	25.327.536,50	6,72
Tschechische Republik	502.412,50	0,13
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	18.120.125,25	4,81
Österreich	3.457.357,25	0,92
Asset Backed Securities	**25.851.859,71**	**6,86**
Irland	17.359.709,67	4,60
Niederlande	8.492.150,04	2,25
Schuldscheindarlehen	**4.338.652,03**	**1,15**
Polen	2.159.900,19	0,57
Österreich	2.178.751,84	0,58
Derivate	**203.987,98**	**0,05**
Swaps	203.987,98	0,05
Bankguthaben	**2.308.275,51**	**0,61**
Sonstige Vermögensgegenstände	**1.494.157,65**	**0,40**
Verbindlichkeiten	**-208.018,80**	**-0,06**
Fondsvermögen	**377.045.879,78**	**100,00**[1)]

[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 im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere							**EUR**		**355.187.495,44**	**94,20**
Verzinsliche Wertpapiere							**EUR**		**355.187.495,44**	**94,20**
0,0000 % Caisse Centrale Credit Immobiliere de France 2020/2024	XS2104031757		EUR	1.500	1.500	0	%	101,0375	1.515.562,50	0,40
0,0000 % European Financial Stability Facility (EFSF) 2019/2024	EU000A1G0EC4		EUR	3.500	0	0	%	101,9830	3.569.405,00	0,95
0,0000 % KfW MTN 2019/2024	DE000A2LQSP7		EUR	1.800	0	0	%	102,0455	1.836.819,00	0,49
0,0000 % Orange MTN MC 2019/2026	FR0013444676		EUR	400	0	600	%	97,5915	390.366,00	0,10
0,0000 % Berkshire Hathaway MC 2020/2025	XS2133056114		EUR	1.000	1.000	0	%	99,0670	990.670,00	0,26
0,0100 % Bank of Nova Scotia MTN (covered) 2020/2027	XS2101325111		EUR	1.000	3.000	2.000	%	101,4085	1.014.085,00	0,27
0,0500 % Bpifrance Financement 2019/2029	FR0013448776		EUR	3.500	0	0	%	100,1375	3.504.812,50	0,93
0,0500 % Royal Bank of Canada (covered) 2019/2026	XS2014288315		EUR	2.000	0	0	%	101,7045	2.034.090,00	0,54
0,1000 % Bank of Montreal (covered) 2016/2023	XS1506604161		EUR	2.000	0	0	%	101,2390	2.024.780,00	0,54
0,1250 % CADES MTN 2018/2023	FR0013344181		EUR	5.500	0	0	%	101,8270	5.600.485,00	1,49
0,1250 % Dt. Pfandbriefbank MTN 2019/2024	DE000A2NBKK3		EUR	1.000	0	0	%	97,1410	971.410,00	0,26
0,1250 % European Financial Stability Facility (EFSF) MTN 2017/2023	EU000A1G0D39		EUR	4.000	0	0	%	102,2120	4.088.480,00	1,08
0,1250 % Niedersachsen LSA S.887 2019/2027	DE000A2TSB40		EUR	3.000	0	0	%	103,0120	3.090.360,00	0,82
0,1250 % Nordea Bank Finland MTN 2019/2027	XS2013525410		EUR	3.000	0	0	%	102,5875	3.077.625,00	0,82
0,1250 % Philip Morris Int. MC 2019/2026	XS2035473748		EUR	1.000	0	0	%	95,7380	957.380,00	0,25
0,1250 % Stadshypotek (covered) 2016/2026	XS1499574991		EUR	3.300	0	0	%	102,3665	3.378.094,50	0,90
0,1390 % SNAM MTN FRN 2017/2024	XS1657785538		EUR	1.500	0	0	%	97,3920	1.460.880,00	0,39
0,2000 % DH Europe Finance II MC 2019/2026	XS2050404636		EUR	1.500	0	0	%	98,5390	1.478.085,00	0,39
0,2000 % Ireland Treasury 2020/2027	IE00BKFVC568		EUR	3.000	3.000	0	%	103,0225	3.090.675,00	0,82
0,2450 % Santander Consumer Fin. MTN FRN 2019/2021	XS2093769383		EUR	1.000	0	0	%	99,7720	997.720,00	0,26
0,2500 % AT&T MC 2019/2026	XS2051361264		EUR	600	0	0	%	96,5410	579.246,00	0,15
0,2500 % BASF MTN MC 2020/2027	DE000A289DC9		EUR	500	500	0	%	100,6300	503.150,00	0,13
0,2500 % Bank of Montreal (covered) 2019/2024	XS1933874387		EUR	1.000	0	1.500	%	101,8475	1.018.475,00	0,27
0,2500 % Bundesobligation S.172 2015/2020	DE0001141729		EUR	5.000	0	0	%	100,2520	5.012.600,00	1,33
0,2500 % Credit Agricole Cariparma 2020/2028	IT0005397028		EUR	1.000	2.500	1.500	%	102,9235	1.029.235,00	0,27
0,2500 % Telenor MTN MC 2019/2027	XS2056396919		EUR	800	0	0	%	100,0185	800.148,00	0,21
0,2500 % Telenor MTN MC 2020/2028	XS2117452156		EUR	500	1.000	500	%	99,3075	496.537,50	0,13
0,2500 % Toyota Finance Australia MTN 2019/2024	XS1978200639		EUR	700	0	0	%	99,9395	699.576,50	0,19
0,2750 % Slovenia (Republic of) 2020/2030	SI0002103966		EUR	1.500	1.500	0	%	100,2870	1.504.305,00	0,40
0,3750 % Agence Francaise Develop MTN 2016/2024	FR0013220902		EUR	4.800	0	0	%	102,6275	4.926.120,00	1,31
0,3750 % Canadian Imperial Bank MTN 2019/2024	XS1991125896		EUR	3.000	0	0	%	99,4675	2.984.025,00	0,79
0,3750 % Cie Fin. Foncier Obl. Fon. 2019/2027	FR0013413382		EUR	2.000	0	0	%	104,1070	2.082.140,00	0,55
0,3750 % DBS Bank (covered) 2017/2024	XS1720526737		EUR	3.000	0	0	%	102,3990	3.071.970,00	0,81

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
0,3750 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2029	XS2193666042		EUR	500	500	0	%	100,1425	500.712,50	0,13
0,3750 % LB Baden-Württ. MTN 2019/2024	DE000LB2CHW4		EUR	900	0	0	%	99,7385	897.646,50	0,24
0,3750 % LB Hessen-Thüringen MTN S.H344 2020/2025	XS2171210862		EUR	5.000	5.000	0	%	101,0190	5.050.950,00	1,34
0,3750 % Metrop. Life Global Fdg. I 2019/2024	XS1979259220		EUR	700	0	0	%	100,5835	704.084,50	0,19
0,3750 % Ontario (Province) 2017/2024	XS1629737625		EUR	2.000	0	0	%	101,9720	2.039.440,00	0,54
0,3750 % SAP MC 2020/2029	XS2176715667		EUR	1.000	1.000	0	%	100,3415	1.003.415,00	0,27
0,3750 % Siemens Financieringsmat. MTN 2020/2026	XS2182054887		EUR	1.200	1.200	0	%	100,8245	1.209.894,00	0,32
0,3750 % Sparebanken 1 Boligkreditt (covered) 2017/2024	XS1637099026		EUR	1.000	0	0	%	102,6980	1.026.980,00	0,27
0,3750 % Westpac Banking MTN (covered) 2019/2026	XS1978200472		EUR	4.000	0	0	%	102,9380	4.117.520,00	1,09
0,4000 % Swedbank MTN 2018/2023	XS1870225338		EUR	750	0	0	%	100,7670	755.752,50	0,20
0,4190 % Madrid (Comunidad de) 2020/2030	ES0000101933		EUR	1.000	1.000	0	%	98,7225	987.225,00	0,26
0,4500 % Aust & NZ Banking Group (covered) 2016/2023	XS1523136247		EUR	1.000	0	0	%	102,2895	1.022.895,00	0,27
0,4750 % Portugal 2020/2030	PTOTELOE0028		EUR	2.000	2.000	0	%	100,1675	2.003.350,00	0,53
0,5000 % ABN AMRO Bank MTN 2018/2023	XS1856791873		EUR	500	0	0	%	101,5685	507.842,50	0,13
0,5000 % Apple MC 2019/2031	XS2079716937		EUR	400	0	0	%	102,2785	409.114,00	0,11
0,5000 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria MTN 2020/2027	XS2101349723		EUR	1.800	1.800	0	%	95,8000	1.724.400,00	0,46
0,5000 % Banco Santander MTN 2020/2027	XS2113889351		EUR	800	800	0	%	96,0335	768.268,00	0,20
0,5000 % Bundesanleihe 2016/2026	DE0001102390		EUR	5.000	0	0	%	106,9460	5.347.300,00	1,42
0,5000 % Caisse Fran. de Fin. Local Obl. Fon. 2018/2026	FR0013310026		EUR	2.500	0	1.000	%	104,3970	2.609.925,00	0,69
0,5000 % Cie Fin. Foncier Obl. Fon. 2016/2024	FR0013162302		EUR	1.500	0	500	%	103,3985	1.550.977,50	0,41
0,5000 % Citigroup MTN MC 2019/2027	XS2063232727		EUR	1.000	0	0	%	97,2795	972.795,00	0,26
0,5000 % Commonwealth Bank Austr. (covered) 2016/2026	XS1458458665		EUR	3.000	0	0	%	103,7950	3.113.850,00	0,83
0,5000 % Essilor International MTN MC 2020/2028	FR0013516077		EUR	1.000	1.000	0	%	99,8550	998.550,00	0,26
0,5000 % Finnish Government 2019/2029	FI4000369467		EUR	4.000	0	0	%	107,1435	4.285.740,00	1,14
0,5000 % Holcim Finance MTN MC 2019/2026	XS2081615473		EUR	800	0	0	%	98,6200	788.960,00	0,21
0,5000 % KBC Groep MTN fix-to-float (sub.) 2019/2029	BE0002664457		EUR	500	0	0	%	96,8080	484.040,00	0,13
0,5000 % Lloyds Banking Group MTN fix-to-float 2019/2025	XS2078918781		EUR	500	0	0	%	97,6625	488.312,50	0,13
0,5000 % Nat. Westminster Bank MTN (covered) 2017/2024	XS1612958253		EUR	1.000	0	1.000	%	102,6430	1.026.430,00	0,27
0,5000 % Nationwide Building Society (covered) 2017/2024	XS1569896498		EUR	2.000	0	0	%	102,6800	2.053.600,00	0,54
0,5000 % OP Corporate Bank MTN 2020/2025	XS2171253912		EUR	2.500	4.000	1.500	%	101,3830	2.534.575,00	0,67
0,5000 % Pernod Ricard 2019/2027	FR0013456431		EUR	500	0	0	%	99,9860	499.930,00	0,13
0,5000 % Thermo Fisher Scientific MC 2019/2028	XS2058556536		EUR	900	0	0	%	98,3100	884.790,00	0,23
0,5000 % Toronto Dominion Bank (covered) 2017/2024	XS1588284056		EUR	2.200	0	0	%	102,9080	2.263.976,00	0,60
0,5000 % UNEDIC MTN 2019/2029	FR0013410008		EUR	2.000	0	0	%	104,6445	2.092.890,00	0,56
0,5000 % United Overseas Bank MTN (covered) 2018/2025	XS1750083229		EUR	5.000	0	0	%	102,7885	5.139.425,00	1,36
0,5000 % Westpac Banking MTN (covered) 2017/2024	XS1615085781		EUR	1.000	0	0	%	102,7340	1.027.340,00	0,27

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
0,5000 % Westpac Banking MTN (covered) 2018/2025	XS1748436190		EUR	3.000	0	0	%	103,0980	3.092.940,00	0,82
0,5240 % Exxon Mobil MC 2020/2028	XS2196322312		EUR	2.000	2.000	0	%	99,8385	1.996.770,00	0,53
0,6000 % OP Corporate Bank MTN 2020/2027	XS2102924383		EUR	1.000	2.000	1.000	%	99,5685	995.685,00	0,26
0,6000 % Spain MTN 2019/2029	ES0000012F43		EUR	3.100	0	1.000	%	102,4635	3.176.368,50	0,84
0,6250 % Alberta (Province) MTN 2018/2025	XS1808478710		EUR	2.400	0	1.000	%	102,7295	2.465.508,00	0,65
0,6250 % Banco BPM (covered) 2016/2023	IT0005199465		EUR	1.400	0	0	%	101,9675	1.427.545,00	0,38
0,6250 % Bundesländer LSA 2019/2029	DE000A2NBJ54		EUR	1.000	0	2.000	%	107,1680	1.071.680,00	0,28
0,6250 % Credit Agricole Public Sector SCF MTN (covered) 2019/2029	FR0013411600		EUR	2.500	0	0	%	106,7325	2.668.312,50	0,71
0,6250 % Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH (covered) 2018/2026	FR0013313020		EUR	3.800	0	200	%	105,1125	3.994.275,00	1,06
0,6250 % Daimler International Finance MTN 2019/2027	DE000A2R9ZU9		EUR	1.200	0	0	%	94,8410	1.138.092,00	0,30
0,6250 % Evonik Industries MC 2020/2025	DE000A289NX4		EUR	1.200	1.200	0	%	101,0525	1.212.630,00	0,32
0,6250 % Grenke Finance MTN 2019/2025	XS2078696866		EUR	800	0	0	%	95,0085	760.068,00	0,20
0,6250 % Illinois Tool Works MC 2019/2027	XS1843435170		EUR	1.000	0	0	%	100,8050	1.008.050,00	0,27
0,6250 % Koninklijke DSM MTN MC 2020/2032	XS2193979254		EUR	500	500	0	%	99,9265	499.632,50	0,13
0,6250 % Lansforsakringar Hypothek (covered) 2018/2025	XS1799048704		EUR	3.000	0	0	%	104,1760	3.125.280,00	0,83
0,6250 % Macquarie Group 2020/2027	XS2105735935		EUR	1.000	1.000	0	%	97,4850	974.850,00	0,26
0,6250 % Ontario (Province) MTN 2018/2025	XS1807430811		EUR	3.000	0	0	%	103,4555	3.103.665,00	0,82
0,6250 % PKO Bank Hipoteczny covered 2017/2023	XS1588411188		EUR	2.000	0	0	%	101,7890	2.035.780,00	0,54
0,6250 % SNCF MTN 2020/2030	FR0013507647		EUR	1.000	6.000	5.000	%	102,2925	1.022.925,00	0,27
0,6250 % Skand. Enskilda MTN 2019/2029	XS2078737215		EUR	500	0	1.500	%	99,7965	498.982,50	0,13
0,6250 % Swedish Covered Bond (covered) 2018/2025	XS1900804045		EUR	2.000	0	0	%	104,7905	2.095.810,00	0,56
0,7500 % BMW Finance MTN 2019/2026	XS2010447238		EUR	500	0	0	%	101,5545	507.772,50	0,13
0,7500 % BPCE SFH (covered) 2018/2025	FR0013320611		EUR	3.200	0	0	%	105,5475	3.377.520,00	0,90
0,7500 % Banque Fed. Credit Mutuel MTN 2019/2026	FR0013412947		EUR	500	0	0	%	102,5735	512.867,50	0,14
0,7500 % Instituto de Credito Oficial MTN 2018/2023	XS1915152000		EUR	2.000	0	0	%	103,1975	2.063.950,00	0,55
0,7500 % Lithuania (Republic of) MTN 2020/2030	XS2168038847		EUR	3.500	3.500	0	%	106,4540	3.725.890,00	0,99
0,7500 % OMV MTN 2020/2030	XS2189613982		EUR	500	500	0	%	98,8930	494.465,00	0,13
0,7500 % PKO Bank Hipoteczny covered 2017/2024	XS1690669574		EUR	3.800	0	0	%	102,8715	3.909.117,00	1,04
0,7500 % RCI Banque MTN MC 2019/2023	FR0013412699		EUR	700	0	0	%	97,2900	681.030,00	0,18
0,7500 % Royal Bank of Scotland Group fix to float 2019/2025	XS2080205367		EUR	1.000	0	0	%	98,0085	980.085,00	0,26
0,7500 % SNCF Reseau MTN 2019/2036	XS2022425024		EUR	2.000	0	0	%	104,8985	2.097.970,00	0,56
0,7500 % Standard Chart. Bk fix-to-float 2017/2023	XS1693281534		EUR	500	0	0	%	99,8620	499.310,00	0,13
0,7500 % Wolters Kluwer MC 2020/2030	XS2198580271		EUR	800	800	0	%	99,0825	792.660,00	0,21
0,8000 % Belgium 2017/2027	BE0000341504		EUR	3.000	0	0	%	108,0915	3.242.745,00	0,86
0,8000 % Veolia Environnement MTN MC 2020/2032	FR0013517059		EUR	500	500	0	%	100,2740	501.370,00	0,13

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
0,8500 % General Motors Financial MC 2020/2026	XS2125145867		EUR	700	700	0	%	87,8770	615.139,00	0,16
0,8750 % DS Smith MC 2019/2026	XS2051777873		EUR	1.000	0	0	%	96,6030	966.030,00	0,26
0,8750 % Goldman Sachs MTN 2020/2030	XS2107332640		EUR	1.000	1.000	0	%	97,6975	976.975,00	0,26
0,8750 % Molnlycke Holding MTN MC 2019/2029	XS2049769297		EUR	1.000	0	0	%	95,0340	950.340,00	0,25
0,8750 % SES MTN MC 2019/2027	XS2075811781		EUR	500	0	0	%	93,0390	465.195,00	0,12
0,8750 % SNCF Reseau MTN 2019/2029	XS1938381628		EUR	3.000	0	0	%	107,1325	3.213.975,00	0,85
0,8750 % Sanofi MTN MC 2019/2029	FR0013409844		EUR	1.000	0	0	%	105,5265	1.055.265,00	0,28
0,8750 % Verizon Communications MC 2019/2027	XS1979280853		EUR	1.000	0	0	%	101,4400	1.014.400,00	0,27
0,9500 % Italy BTP 2018/2023	IT0005325946		EUR	2.000	0	0	%	101,9370	2.038.740,00	0,54
1,0000 % Cellnex Telecom MC 2020/2027	XS2102934697		EUR	1.500	1.500	0	%	95,9690	1.439.535,00	0,38
1,0000 % Credit Agricole Italia (covered) 2019/2027	IT0005366288		EUR	3.000	0	0	%	107,9895	3.239.685,00	0,86
1,0000 % Credit Agricole MTN fix-to-float 2020/2026	FR0013508512		EUR	1.000	1.000	0	%	100,9810	1.009.810,00	0,27
1,0000 % Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH (covered) 2018/2028	FR0013332012		EUR	3.000	0	0	%	109,3210	3.279.630,00	0,87
1,0000 % Credit Suisse Group MTN fix-to-float 2019/2027	CH0483180946		EUR	700	0	300	%	100,0760	700.532,00	0,19
1,0000 % Fresenius Medical Care MTN MC 2020/2026	XS2178769076		EUR	500	500	0	%	101,7505	508.752,50	0,13
1,0000 % Intesa Sanpaolo MTN 2019/2026	XS2081018629		EUR	700	0	0	%	97,8360	684.852,00	0,18
1,0000 % JT Intl. Fin. Services MC 2019/2029	XS2082472122		EUR	600	0	0	%	100,9345	605.607,00	0,16
1,0000 % Nordea Bank MTN fix-to-float (subordinated) 2016/2026	XS1486520403		EUR	1.000	0	0	%	99,7590	997.590,00	0,26
1,0000 % Poland Gov. Bond MTN 2019/2029	XS1958534528		EUR	2.500	0	0	%	107,5305	2.688.262,50	0,71
1,0000 % Santander Consumer Fin. MTN 2019/2024	XS1956025651		EUR	600	0	0	%	101,3840	608.304,00	0,16
1,0000 % UBI Banca (covered) 2015/2023	IT0005140030		EUR	800	0	1.200	%	103,0430	824.344,00	0,22
1,0010 % JP Morgan Chase & Co. MTN fix-to-float 2019/2031	XS2033262622		EUR	500	0	0	%	99,8715	499.357,50	0,13
1,0230 % Total Capital International MTN MC 2018/2027	XS1874122770		EUR	1.000	0	0	%	104,2840	1.042.840,00	0,28
1,0730 % mBank Hipoteczny (covered) 2018/2025	XS1812878889		EUR	2.000	0	0	%	104,7375	2.094.750,00	0,56
1,0900 % JP Morgan Chase & Co. fix-to-float 2019/2027	XS1960248919		EUR	500	0	0	%	102,1580	510.790,00	0,14
1,1000 % Ireland Treasury 2019/2029	IE00BH3SQ895		EUR	1.000	0	1.500	%	110,6630	1.106.630,00	0,29
1,1250 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2020/2029	FR0013508710		EUR	700	700	0	%	101,1135	707.794,50	0,19
1,1250 % Basque Government 2019/2029	ES0000106635		EUR	2.000	0	0	%	106,1090	2.122.180,00	0,56
1,1250 % Commerzbank MTN 2019/2026	DE000CZ40N46		EUR	500	0	0	%	98,2790	491.395,00	0,13
1,1250 % Deutsche Bahn Finance MTN 2019/2028	XS1936139770		EUR	1.000	0	0	%	107,5465	1.075.465,00	0,29
1,1250 % JT Int. Fin. Services MTN -single callable- 2018/2025	XS1883352095		EUR	1.000	0	0	%	103,8785	1.038.785,00	0,28
1,1250 % Mediobanca MTN 2020/2025	XS2106861771		EUR	500	500	0	%	95,8865	479.432,50	0,13
1,1250 % Mexico MC 2020/2030	XS2104886341		EUR	2.500	2.500	0	%	87,9935	2.199.837,50	0,58
1,1250 % Pernod Ricard MC 2020/2025	FR0013506524		EUR	1.200	1.200	0	%	103,3350	1.240.020,00	0,33

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
1,1250 % Renault MC 2019/2027	FR0013451416		EUR	700	0	0	%	86,2440	603.708,00	0,16
1,2500 % Credit Suisse Group fix-to-float 2017/2025	CH0343366842		EUR	500	0	0	%	102,0810	510.405,00	0,14
1,2500 % FCA Bank MTN MC 2019/2022	XS1954697923		EUR	400	0	0	%	99,6050	398.420,00	0,11
1,2500 % Suez MC 2016/2028	FR0013173432		EUR	1.000	1.000	0	%	105,3490	1.053.490,00	0,28
1,2500 % Suez MTN MC 2020/2027	FR0013505542		EUR	1.000	1.000	0	%	105,0800	1.050.800,00	0,28
1,3000 % Spain 2016/2026	ES00000128H5		EUR	8.000	0	2.000	%	108,0940	8.647.520,00	2,29
1,3010 % Allianz fix-to-float (sub.) 2019/2049	DE000A2YPFA1		EUR	1.000	0	0	%	96,8195	968.195,00	0,26
1,3750 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2040	XS2156768546		EUR	800	800	0	%	106,8290	854.632,00	0,23
1,3750 % ITV MC 2019/2026	XS2050543839		EUR	700	0	0	%	96,6665	676.665,50	0,18
1,3750 % Mediobanca (covered) 2015/2025	IT0005142952		EUR	1.000	0	0	%	107,5685	1.075.685,00	0,29
1,4000 % Arbour CLO S. 2018-3X Cl. CR FRN 2018/2029	XS1781683393		EUR	1.500	0	0	%	94,8510	1.422.764,55	0,38
1,4010 % Becton Dickinson MC 2018/2023	XS1822506272		EUR	700	0	0	%	101,6485	711.539,50	0,19
1,4500 % Spain 2019/2029	ES0000012E51		EUR	2.000	0	0	%	110,0245	2.200.490,00	0,58
1,4910 % Total Capital International MTN MC 2020/2027	XS2153406868		EUR	700	700	0	%	106,6330	746.431,00	0,20
1,5000 % America Movil 2016/2024	XS1379122101		EUR	750	0	0	%	102,5970	769.477,50	0,20
1,5000 % Bertelsmann MTN MC 2020/2030	XS2176558620		EUR	1.000	1.000	0	%	103,2745	1.032.745,00	0,27
1,5000 % Ceske Drahy 2019/2026	XS1991190361		EUR	500	0	0	%	100,4825	502.412,50	0,13
1,5000 % DBS Group Holdings fix-to-float (subord.) 2018/2028	XS1802465846		EUR	500	0	0	%	101,4585	507.292,50	0,13
1,5000 % Deutsche Bank MTN 2017/2022	DE000DL19TA6		EUR	500	0	0	%	100,4615	502.307,50	0,13
1,5000 % Fidelity National Information Services MC 2019/2027	XS1843436228		EUR	800	0	0	%	103,4660	827.728,00	0,22
1,5000 % Fresenius Medical Care MTN MC 2020/2030	XS2178769159		EUR	900	900	0	%	103,5160	931.644,00	0,25
1,5000 % Italy 2015/2025	IT0005090318		EUR	14.000	0	0	%	103,9680	14.555.520,00	3,86
1,5000 % Sanofi MTN MC 2020/2030	FR0013505112		EUR	1.500	1.500	0	%	111,3365	1.670.047,50	0,44
1,5000 % Shell Int. Finance MTN 2020/2028	XS2154418730		EUR	1.000	1.000	0	%	108,1040	1.081.040,00	0,29
1,6000 % Newhaven CLO 2017-1X Cl.BR FRN 2017/2030	XS1560856343		EUR	1.000	0	0	%	99,1934	991.933,84	0,26
1,6000 % Palmerston Park CLO S.1X Cl. A2A FRN 2017/2030	XS1566961618		EUR	1.000	0	0	%	99,1832	991.832,27	0,26
1,6000 % Rye Harbour CLO S.1X Cl. B1R FRN 2017/2031	XS1596796836		EUR	2.000	0	0	%	99,0155	1.980.310,99	0,53
1,6250 % Dell Bank MC 2020/2024	XS2193734733		EUR	500	500	0	%	100,6975	503.487,50	0,13
1,6250 % Deutsche Bank MTN 2019/2021	DE000DL19UQ0		EUR	1.000	0	0	%	100,4560	1.004.560,00	0,27
1,6250 % Elis MTN MC 2019/2028	FR0013449998		EUR	1.000	0	0	%	91,5825	915.825,00	0,24
1,6250 % Grenke Finance MTN 2019/2024	XS1956014531		EUR	1.000	0	0	%	99,7965	997.965,00	0,26
1,6250 % Mondi Finance MTN MC 2018/2026	XS1813593313		EUR	1.000	0	0	%	104,4970	1.044.970,00	0,28
1,6250 % NGG Finance fix-to-float (sub.) 2019/2079	XS2010044977		EUR	800	0	0	%	98,4730	787.784,00	0,21
1,6250 % OP Corporate Bank fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2185867673		EUR	1.000	3.000	2.000	%	99,8050	998.050,00	0,26
1,6250 % Vinci MTN MC 2019/2029	FR0013397452		EUR	400	0	0	%	109,7550	439.020,00	0,12
1,6500 % Aqueduct European CLO 2017-2X Cl. C FRN 2017/2030	XS1716911091		EUR	1.500	0	0	%	95,4057	1.431.084,76	0,38

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
1,7000 % Altria Group MC 2019/2025	XS1843443513		EUR	500	0	0	%	102,9565	514.782,50	0,14
1,7500 % ArcelorMittal MTN MC 2019/2025	XS2082324018		EUR	1.000	0	0	%	95,5180	955.180,00	0,25
1,7500 % Coca-Cola European Partners MC 2020/2026	XS2134245138		EUR	400	400	0	%	106,2975	425.190,00	0,11
1,7500 % Credit Agricole MTN 2019/2029	XS1958307461		EUR	500	0	0	%	107,6345	538.172,50	0,14
1,7500 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	XS1974787480		EUR	1.000	0	0	%	98,6110	986.110,00	0,26
1,8000 % Vonovia Finance MC 2019/2025	DE000A2RWZZ6		EUR	600	0	0	%	106,1275	636.765,00	0,17
1,8740 % British Telecom fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2119468572		EUR	500	500	0	%	92,2290	461.145,00	0,12
1,8750 % Cassa Depositi e Prestiti MTN 2018/2026	IT0005323438		EUR	4.000	0	0	%	104,3980	4.175.920,00	1,11
1,9500 % Madison Park Euro Funding CLO S.10X Cl.B2 2018/2030	XS1725824947		EUR	1.600	0	0	%	99,9950	1.599.919,50	0,42
2,0000 % Ares Europ. CLO VII S. 2014-7X Cl.BR FRN 2017/2030	XS1650058560		EUR	2.000	0	0	%	97,5520	1.951.040,88	0,52
2,0000 % Bertelsmann MTN MC 2020/2028	XS2149280948		EUR	700	700	0	%	108,2920	758.044,00	0,20
2,0000 % Koninklijke KPN PERP fix-to-float (subord.) 2019/2099	XS2069101868		EUR	300	0	1.000	%	94,5370	283.611,00	0,08
2,0000 % Penta CLO 2 S. 2015-2X Cl. CR FRN 2017/2028	XS1645091254		EUR	1.000	0	0	%	98,1366	981.366,37	0,26
2,0000 % UniCredit MTN fix-to-float (sub.) 2019/2029	XS2055089457		EUR	1.000	0	400	%	90,8045	908.045,00	0,24
2,0500 % Euro Galaxy CLO S. 2015-4X Class CR 2017/2030	XS1577958306		EUR	1.000	0	0	%	97,8295	978.295,48	0,26
2,1250 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2019/2027	FR0013398070		EUR	500	0	0	%	107,0560	535.280,00	0,14
2,1250 % Imperial Brands Finance MTN MC -rating sensitive- 2019/2027	XS1951313763		EUR	1.000	0	0	%	102,6435	1.026.435,00	0,27
2,1250 % UBS Group Funding 2016/2024	CH0314209351		EUR	500	0	0	%	106,2020	531.010,00	0,14
2,2410 % Allianz fix-to-float (sub.) 2015/2045	DE000A14J9N8		EUR	400	0	0	%	104,3475	417.390,00	0,11
2,2500 % INEOS Styrolution Group MC 2020/2027	XS2108560306		EUR	700	700	0	%	92,1395	644.976,50	0,17
2,2500 % IQVIA MC 2019/2028	XS2036798150		EUR	450	0	0	%	96,2835	433.275,75	0,11
2,2500 % St. Paul's CLO S. 2X Cl.CRRR FRN 2019/2030	XS2052177115		EUR	1.000	0	0	%	98,9278	989.277,66	0,26
2,2500 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1195201931		EUR	100	0	0	%	100,0270	100.027,00	0,03
2,2800 % Toyota Finance Australia MTN 2020/2027	XS2156236452		EUR	300	300	0	%	111,5485	334.645,50	0,09
2,3300 % Ford Motor Credit 2019/2025	XS2052337503		EUR	600	0	0	%	88,5035	531.021,00	0,14
2,3500 % Ares Europ. CLO VIII S. 2019-8X Cl.CR FRN 2019/2032	XS2060909798		EUR	1.500	0	0	%	98,9561	1.484.341,38	0,39
2,3750 % Airbus Group MTN MC 2020/2032	XS2152796426		EUR	500	500	0	%	110,0365	550.182,50	0,15
2,3750 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2019/2079	XS2077670003		EUR	300	0	0	%	97,4930	292.479,00	0,08
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH MTN MC 2020/2028	XS2151059206		EUR	1.000	1.000	0	%	108,0695	1.080.695,00	0,29
2,3750 % Saint Gobain MC 2020/2027	XS2150054372		EUR	700	700	0	%	110,5720	774.004,00	0,21
2,3750 % Thermo Fisher Scientific MC 2020/2032	XS2010032451		EUR	300	300	0	%	114,3955	343.186,50	0,09
2,4500 % ALME Loan Funding CLO S.2015-4X Cl.DR FRN 2018/2032	XS1724886335		EUR	1.300	0	0	%	90,7490	1.179.736,98	0,31
2,5000 % Diageo Finance MTN MC 2020/2032	XS2147889690		EUR	1.300	1.300	0	%	120,2570	1.563.341,00	0,41

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
2,5000 % Exor 2014/2024	XS1119021357		EUR	500	0	0	%	106,4435	532.217,50	0,14
2,5000 % Madison Park Euro Funding VIII Cl.CR FRN 2019/2032	XS2079889445		EUR	1.300	0	0	%	99,8385	1.297.900,18	0,34
2,5000 % Sky MTN 2014/2026	XS1109741329		EUR	600	0	0	%	112,7570	676.542,00	0,18
2,5000 % ZF Europe Finance MC 2019/2027	XS2010039977		EUR	1.000	0	0	%	91,6490	916.490,00	0,24
2,6000 % ELM BV (Swiss Re) PERP fix-to-float (sub.) 2015/2099	XS1209031019		EUR	500	0	0	%	104,2080	521.040,00	0,14
2,6250 % Accor PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	FR0013457157		EUR	700	700	0	%	81,5525	570.867,50	0,15
2,6250 % RCI Banque fix-to-float (sub.) 2019/2030	FR0013459765		EUR	500	0	0	%	91,6880	458.440,00	0,12
2,6250 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2017/2099	XS1731823255		EUR	500	0	0	%	97,4210	487.105,00	0,13
2,6500 % Black Diamond CLO S. 2015-1X Cl.DR FRN 2018/2029	XS1739834684		EUR	1.000	0	0	%	93,2063	932.062,82	0,25
2,7500 % Wienerberger MC 2020/2025	AT0000A2GLA0		EUR	500	500	0	%	101,8210	509.105,00	0,14
2,7500 % ZF North America Capital 2015/2023	DE000A14J7G6		EUR	600	0	0	%	99,5625	597.375,00	0,16
2,8550 % Intesa SanPaolo MTN (subordinated) 2015/2025	XS1222597905		EUR	500	0	0	%	101,9790	509.895,00	0,14
2,8750 % Anheuser-Busch InBev MTN MC 2020/2032	BE6320935271		EUR	1.200	1.200	0	%	113,6955	1.364.346,00	0,36
2,8750 % Ineos Finance MC 2019/2026	XS1843437549		EUR	600	0	0	%	95,8035	574.821,00	0,15
2,9500 % Fidelity National Information Services MC 2019/2039	XS1843436145		EUR	500	500	0	%	115,2950	576.475,00	0,15
3,0000 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	FR0013464922		EUR	400	0	0	%	95,0520	380.208,00	0,10
3,0000 % Italy 2019/2029	IT0005365165		EUR	5.000	0	0	%	115,4315	5.771.575,00	1,53
3,1250 % Gazprom (via Gaz Capital) LPN 2016/2023	XS1521039054		EUR	700	0	0	%	104,6250	732.375,00	0,19
3,1250 % La Poste PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2099	FR0013331949		EUR	500	0	0	%	103,0260	515.130,00	0,14
3,1250 % Sappi Papier Holding MC 2019/2026	XS1961852750		EUR	800	0	0	%	85,9420	687.536,00	0,18
3,1250 % SoftBank Group MC 2017/2025	XS1684385161		EUR	1.000	0	0	%	95,9410	959.410,00	0,25
3,2500 % BP Capital Markets PERP fix-to-float 2020/2099	XS2193661324		EUR	700	700	0	%	100,2220	701.554,00	0,19
3,2500 % Schaeffler Finance MC 2015/2025	XS1212470972		EUR	3.000	0	0	%	99,4370	2.983.110,00	0,79
3,3000 % Cordatus Loan Fund VIII CLO S.2017-8X Cl.D FRN 2017/2030	XS1565265334		EUR	750	0	0	%	95,8383	718.787,28	0,19
3,3750 % Barclays Bank MTN fix-to-float 2020/2025	XS2150054026		EUR	1.000	1.400	400	%	107,3030	1.073.030,00	0,28
3,3750 % Goldman Sachs 2020/2025	XS2149207354		EUR	400	600	200	%	111,4765	445.906,00	0,12
3,6250 % BP Capital Markets PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2193662728		EUR	700	700	0	%	100,3775	702.642,50	0,19
3,6250 % UPCB Finance VII MC 2017/2029	XS1634252628		EUR	1.100	0	0	%	97,8100	1.075.910,00	0,29
4,0000 % METRO MTN 2012/2022	XS0801202069		EUR	1.300	0	0	%	104,0110	1.352.143,00	0,36
4,0000 % Sappi Papier Holding MC 2016/2023	XS1383922876		EUR	750	0	0	%	91,4075	685.556,25	0,18
4,1250 % Gas Natural Fenosa Fin PERP Multi Reset Nts.(sub.) 2014/2099	XS1139494493		EUR	500	0	0	%	102,8335	514.167,50	0,14
4,2500 % Aareal Bank MTN fix-to-float (subord.) 2014/2026	DE000A1TNC94		EUR	500	0	0	%	93,4395	467.197,50	0,12

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 im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
4,2500 % Aquarius & Investment fix-to-float (subordinated) 2013/2043	XS0897406814		EUR	500	0	0	%	109,2640	546.320,00	0,14
4,2500 % Ziggo Secured Finance MC 2016/2027	XS1493836461		EUR	1.000	0	0	%	93,0140	930.141,00	0,25
4,5000 % Credit Agricole Assurances fix-to-float (subord.) 2014/2099	FR0012222297		EUR	1.000	0	0	%	109,4295	1.094.295,00	0,29
4,6250 % SES PERP Multi Reset Notes (sub.) 2016/2099	XS1405777746		EUR	500	0	0	%	101,3060	506.530,00	0,13
4,7500 % Allianz MTN PERP fix-to-float (sub.) 2013/2099	DE000A1YCQ29		EUR	500	0	0	%	110,1130	550.565,00	0,15
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**EUR**		**13.721.329,97**	**3,64**
Verzinsliche Wertpapiere							**EUR**		**13.721.329,97**	**3,64**
0,7500 % America Movil MTN MC 2019/2027	XS2006277508		EUR	500	0	0	%	98,3590	491.795,00	0,13
1,3750 % Telstra MTN MC 2019/2029	XS1966038249		EUR	910	0	0	%	107,3220	976.630,20	0,26
1,5000 % ADLER Real Estate MC 2019/2022	XS1843441491		EUR	500	0	0	%	97,6995	488.497,50	0,13
1,5000 % Smurfit Kappa Acquisitions MC 2019/2027	XS2050968333		EUR	500	0	0	%	95,9745	479.872,50	0,13
1,6000 % Deutsche Bahn Finance PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	XS2010039548		EUR	400	0	0	%	97,6265	390.506,00	0,10
1,6250 % Mexico 2019/2026	XS1974394675		EUR	2.000	0	0	%	97,7900	1.955.800,00	0,52
1,7500 % Exor MC 2019/2034	XS2058888616		EUR	1.000	1.000	0	%	92,6110	926.110,00	0,25
1,9930 % Armada Euro CLO 7X Cl.C FRN 2019/2033	XS2066870887		EUR	1.000	0	0	%	99,2876	992.876,21	0,26
2,1250 % ING Groep MTN fix-to-float (sub.) 2020/2031	XS2176621170		EUR	400	400	0	%	102,5510	410.204,00	0,11
2,2000 % Cairn CLO S.2016-7X Cl.CR FRN 2019/2030	XS2066882973		EUR	1.000	0	0	%	98,7228	987.227,95	0,26
2,2000 % Cordatus Loan Fund VIII CLO S.2017-8X Cl.C R FRN 2019/2030	XS2055753169		EUR	1.000	0	0	%	98,8344	988.344,37	0,26
2,2500 % Grifols MC 2019/2027	XS2077646391		EUR	600	0	0	%	98,5960	591.576,00	0,16
2,4500 % GoldenTree CLO S.2019-3X Cl.B2 2019/2032	XS2027909170		EUR	3.000	0	0	%	100,7538	3.022.615,24	0,80
2,8750 % Equinix MC 2017/2025	XS1679781424		EUR	1.000	0	0	%	101,9275	1.019.275,00	0,27
Summe Wertpapiervermögen									**368.908.825,41**	**97,84**
Schuldscheindarlehen							**EUR**		**4.338.652,03**	**1,15**
4,0500 % Erste Group Bank SSD (Nachrang) 2014/2024			EUR	2.000	0	0	%	108,9376	2.178.751,84	0,58
4,8140 % Poland NSV 2012/2022			EUR	2.000	0	0	%	107,9950	2.159.900,19	0,57
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							**EUR**		**203.987,98**	**0,05**
Swaps							**EUR**		**203.987,98**	**0,05**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Credit Default Swaps							**EUR**		**203.987,98**	**0,05**
Protection Seller										
AT&T Inc. / 100 BP (GS) 17.10.19-20.6.24		OTC	EUR	-1.500					-3.083,65	-0,00
BNP Paribas MTN / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.23		OTC	EUR	-3.000					56.757,99	0,02
BP Capital Markets America / 100 BP (BNP) 11.5.17-20.6.22		OTC	EUR	-2.000					22.674,13	0,01
Berkshire Hathaway MC / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.12.22		OTC	EUR	-5.000					108.180,15	0,03
Equinor MTN / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.23		OTC	EUR	-1.500					34.366,71	0,01
Innogy Finance MTN / 100 BP (CSSS) 24.10.19-20.6.23		OTC	EUR	-5.000					124.823,07	0,03
Lanxess -single callable- / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.24		OTC	EUR	-2.000					38.465,36	0,01

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 im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Nat. Westminster Bank MTN (covered) / 100 BP (BOASEC) 13.6.19-20.12.21		OTC	EUR	-2.500				28.684,26	0,01
NatWest Markets MTN / 100 BP (BOASEC) 13.6.19-20.12.21		OTC	EUR	-2.500				20.746,39	0,01
Rabobank Nederland MTN (subord.) / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.23		OTC	EUR	-2.500				16.626,36	0,00
Shell Int. Finance MTN FRN / 100 BP (BNP) 23.8.18-20.6.23		OTC	EUR	-1.000				16.188,42	0,00
Unicredit MTN FRN / 100 BP (CSSS) 24.10.19-20.6.21		OTC	EUR	-1.500				5.207,04	0,00
Protection Buyer									
METRO MTN / 100 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.9.22		OTC	EUR	1.300				4.311,89	0,00
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.22		OTC	EUR	1.500				-126.543,82	-0,03
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.22		OTC	EUR	1.000				-84.362,54	-0,02
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (JPM-AG) 15.5.19-20.6.22		OTC	EUR	700				-59.053,78	-0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							**EUR**	**2.308.275,51**	**0,61**
Bankguthaben							**EUR**	**2.308.275,51**	**0,61**
EUR - Guthaben bei							**EUR**	**2.308.275,51**	**0,61**
Verwahrstelle			EUR	2.308.275,51				2.308.275,51	0,61
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**	**1.494.157,65**	**0,40**
Ansprüche aus Credit Default Swaps			EUR					7.500,00	0,00
Cash Collateral			EUR					30.000,00	0,01
Zinsansprüche			EUR					1.456.657,65	0,39
Sonstige Verbindlichkeiten[1]							**EUR**	**-208.018,80**	**-0,06**
Fondsvermögen							**EUR**	**377.045.879,78**	**100,00**[2]
Anteilwert							**EUR**	**21,41**	
Umlaufende Anteile							**STK**	**17.608.872,396**	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									**97,84**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									**0,05**

[1] *Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Veröffentlichungskosten 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 91,94 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 8,06 % 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 Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Belfius Bank MTN 2019/2026	BE6315719490	EUR	0	800
0,0000 % Siemens Financieringsmat. MTN 2020/2026	XS2118280218	EUR	1.000	1.000
0,0000 % Caisse Centrale Credit Immobiliere de France MTN 2019/2023	XS1936850137	EUR	0	2.000
0,0500 % Caisse Centrale Desjardins du Quebec 2019/2027	XS2083301106	EUR	0	3.500
0,1250 % ANZ New Zealand International (covered) 2016/2023	XS1492834806	EUR	0	3.500
0,1250 % Essilor International MTN MC 2019/2025	FR0013463650	EUR	0	500
0,1250 % Lloyds Bank MTN 2019/2026	XS2013525501	EUR	0	1.500
0,2500 % Canadian Imperial Bank (covered) 2018/2023	XS1756725831	EUR	0	1.000
0,2500 % Lloyds Bank Corporate Markets MTN 2019/2022	XS2059885058	EUR	0	1.000
0,2500 % Toronto Dominion Bank (covered) 2020/2024	XS2146198739	EUR	3.000	3.000
0,3750 % Enel Finance Int. MTN MC 2019/2027	XS2066706909	EUR	0	400
0,3750 % La Poste MTN 2019/2027	FR0013447604	EUR	0	1.000
0,3750 % Oversea-Chinese Banking MTN (covered) 2018/2023	XS1784059930	EUR	0	5.000
0,3750 % Stadshypotek MTN (covered) 2017/2024	XS1568860685	EUR	0	2.000
0,3750 % Toronto Dominion Bank MTN 2019/2024	XS1985806600	EUR	0	750
0,4500 % General Mills MC 2020/2026	XS2100788780	EUR	600	600
0,5000 % Bank of Nova Scotia (covered) 2018/2025	XS1755086607	EUR	0	2.000
0,5000 % British Telecom MTN MC 2019/2025	XS2051494222	EUR	0	1.400
0,5000 % Credit Agricole Home Loan SFH (covered) 2018/2026	FR0013310059	EUR	0	4.000
0,5000 % Deutsche Telekom MTN 2019/2027	XS2024715794	EUR	0	1.000
0,5000 % Santander UK (covered) 2018/2025	XS1748479919	EUR	0	3.000
0,6250 % Bank of Ireland Mortgage Bank (covered) 2018/2025	XS1791443440	EUR	0	3.000
0,6500 % Credit Suisse Group MTN fix-to-float 2020/2028	CH0517825276	EUR	500	500
0,7500 % BNG Bank MTN 2019/2029	XS1940071597	EUR	0	3.000
0,7500 % PKO Bank Polski MTN 2017/2021	XS1650147660	EUR	0	1.000
0,7500 % PepsiCo MC 2019/2027	XS1963553919	EUR	0	1.000
0,7500 % Societe Generale SFH (covered) 2018/2028	FR0013310240	EUR	0	2.000
0,8750 % Commerzbank MTN 2020/2027	DE000CZ45VM4	EUR	1.000	1.000
0,8750 % Erste Group Bank MTN 2020/2027	AT0000A2GH08	EUR	1.000	1.000
0,8750 % IBM 2019/2025	XS1944456109	EUR	0	1.000
0,8750 % ING Bank MTN (covered) 2018/2028	XS1805257265	EUR	0	3.000
0,8750 % ISS Global MTN MC 2019/2026	XS2013618421	EUR	0	200
0,8750 % LEG Immobilien MTN MC 2019/2027	DE000A254P51	EUR	0	700
0,8750 % NASDAQ MC 2020/2030	XS2010032881	EUR	1.000	1.000
0,8750 % Tesco Corporate Treasury Services MTN MC 2019/2026	XS2086868010	EUR	0	450
1,0000 % Air Liquide Finance MTN MC 2020/2025	FR0013505559	EUR	100	100
1,0000 % Banco BPM (covered) 2018/2025	IT0005321663	EUR	0	3.000
1,0000 % Bank of Ireland Group MTN fix-to-float 2019/2025	XS2082969655	EUR	0	800
1,0000 % E.ON MTN MC 2020/2025	XS2152899584	EUR	600	600
1,0000 % Natwest Markets MTN 2019/2024	XS2002491517	EUR	1.500	1.500
1,0000 % Schneider Electric MTN MC 2020/2027	FR0013506862	EUR	200	200
1,0000 % Svenska Handelsbanken MTN 2020/2025	XS2156510021	EUR	1.000	1.000
1,0000 % Telstra MC 2020/2030	XS2160857798	EUR	300	300
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 % Orange MTN MC 2020/2027	FR0013506292	EUR	300	300

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
1,2500 % Suez MTN S.APRI MC 2019/2028	FR0013508348	EUR	1.000	1.000
1,3750 % Air Liquide Finance MTN MC 2020/2030	FR0013505567	EUR	200	200
1,3750 % La Poste MTN 2020/2032	FR0013508694	EUR	500	500
1,3750 % Philips (Konin.) MC 2020/2025	XS2149368529	EUR	200	200
1,5000 % Blackstone Holdings Finance MC 2019/2029	XS1979490239	EUR	0	1.000
1,5000 % McKesson MC 2017/2025	XS1567174286	EUR	0	1.000
1,5000 % Nestle Finance International MTN MC 2020/2030	XS2148390755	EUR	200	200
1,5000 % Sanofi MTN S.APR MC 2020/2030	FR0013507456	EUR	700	700
1,6250 % CRH Funding MC 2020/2030	XS2169281487	EUR	500	500
1,6250 % Cap Gemini MC 2020/2026	FR0013507852	EUR	800	800
1,6250 % Fresenius MTN MC 2020/2027	XS2152329053	EUR	500	500
1,7500 % Banco BPM MTN 2019/2025	XS2072815066	EUR	0	1.000
1,7500 % Unilever MC 2020/2030	XS2147133578	EUR	600	600
2,0000 % Airbus Group 2020/2028	XS2152796269	EUR	500	500
2,2000 % John Deere Cash Management MTN 2020/2032	XS2150006562	EUR	400	400
2,2500 % Heineken MTN MC 2020/2030	XS2147977636	EUR	300	300
2,2500 % Vonovia Finance MC 2020/2030	DE000A28VQD2	EUR	400	400
2,3750 % Holcim Finance MTN MC 2020/2025	XS2156244043	EUR	300	300
2,3860 % Ford Motor Credit 2019/2026	XS2013574384	EUR	400	400
2,5000 % Danaher MC 2020/2030	XS2147995372	EUR	300	300
2,5000 % Orlen Capital 2016/2023	XS1429673327	EUR	0	500
2,5000 % Stora Enso MTN MC 2018/2028	XS1794354628	EUR	0	500
2,6250 % Carrefour MTN MC 2020/2027	FR0013505260	EUR	600	600
2,6250 % Daimler MTN 2020/2025	DE000A289RN6	EUR	600	600
2,7500 % NatWest Markets MTN 2020/2025	XS2150006646	EUR	1.100	1.100
3,1250 % PVH 2017/2027	XS1734066811	EUR	0	1.000
3,2500 % Credit Suisse Group MTN MC 2020/2026	CH0537261858	EUR	850	850
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	3.350
3,6480 % Bank of America MTN fix-to-float 2020/2029	XS2148370211	EUR	700	700
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,2500 % Comcast MC 2020/2027	XS2114852218	EUR	500	500
0,2500 % Schneider Electric MTN MC 2020/2029	FR0013494168	EUR	700	700
1,0000 % NatWest Markets MTN S.NOV 2019/2024	XS2082803417	EUR	0	1.500
2,0000 % Dufry One MC 2019/2027	XS2079388828	EUR	400	1.000
2,0000 % Philips (Konin.) MC 2020/2030	XS2149379211	EUR	200	200
3,0210 % Ford Motor Credit MTN 2019/2024	XS1959498160	EUR	0	300

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		
Zinsterminkontrakte		
Verkaufte Kontrakte	**EUR**	**55.900**
(Basiswert(e): BUND)		

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