

Halbjahresbericht

PRO change AMI

1. Oktober 2022 bis 31. März 2023

Alternativer Investmentfonds



Vermögensübersicht zum 31.03.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	4.359.423,00	10,46
Finnland	1.129.293,00	2,71
Frankreich	571.386,00	1,37
Großbritannien	578.628,00	1,39
Italien	511.760,00	1,23
Polen	462.816,00	1,11
Spanien	1.105.540,00	2,65
Investmentanteile	33.473.182,59	80,29
Aktienfonds	16.199.417,27	38,86
Rentenfonds	17.273.765,32	41,44
Derivate	6.600,00	0,02
Aktienindex-Derivate	6.600,00	0,02
Bankguthaben	3.787.551,05	9,09
Sonstige Vermögensgegenstände	87.742,47	0,21
Verbindlichkeiten	-26.211,21	-0,06
Fondsvermögen	41.688.287,90	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere								4.359.423,00	10,46
Verzinsliche Wertpapiere								4.359.423,00	10,46
2,2500 % WPP Finance MTN 2014/2026	XS1112013666		EUR	600	0	0 %	95,2310	571.386,00	1,37
2,5000 % Sky MTN 2014/2026	XS1109741329		EUR	600	0	0 %	96,4380	578.628,00	1,39
4,0000 % Finnish Government 2009/2025	FI4000006176		EUR	1.100	0	0 %	102,6630	1.129.293,00	2,71
5,1250 % Assicurazioni Generali 2009/2024	XS0452314536		EUR	500	0	0 %	102,3520	511.760,00	1,23
5,1500 % Spain 2013/2028	ES00000124C5		EUR	1.000	0	0 %	110,5540	1.105.540,00	2,65
5,2500 % Poland Gov. Bond 2010/2025	XS0479333311		EUR	450	0	0 %	102,8480	462.816,00	1,11
Investmentanteile								33.473.182,59	80,29
Gruppenfremde Investmentanteile								33.473.182,59	80,29
Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS	LU1737653987		ANT	78.520	78.520	0 EUR	43,2920	3.399.287,84	8,15
Amundi Index Euro Agg SRI UCITS ETF DR	LU2182388236		ANT	59.200	129.900	70.700 EUR	41,8650	2.478.408,00	5,95
Amundi Index MSCI Europe SRI UCITS ETF DR	LU1861137484		ANT	42.400	42.400	0 EUR	71,6710	3.038.850,40	7,29
Avesco Sustainable Hidden Champions Equity I	DE000A12BKF6		ANT	12.680	12.680	0 EUR	130,8600	1.659.304,80	3,98
Responsability UCITS Transittit Tone Ze IH-IV EUR	LU2443760025		ANT	21.900	0	0 EUR	98,9700	2.167.443,00	5,20
UBS ETF - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	LU0629460089		ANT	16.800	28.200	11.400 USD	166,4800	2.562.638,81	6,15
UBS Irl ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible U	IE00BDR55364		ANT	117.800	117.800	0 USD	15,4180	1.664.138,17	3,99
UBS-MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	LU0629460675		ANT	31.310	47.710	16.400 EUR	108,4200	3.394.630,20	8,14
Xtrackers II ESG EUR Corporate Bond UCITS ETF	LU0484968812		ANT	25.410	34.610	9.200 EUR	133,7300	3.398.079,30	8,15
iShares EUR Green Bond UCITS ETF	IE00BMDBMN04		ANT	845.000	1.704.100	859.100 EUR	3,9040	3.298.880,00	7,91

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
iShares Euro Corp. Bonds ETF	IE00BYZTVT56		ANT	558.300	1.694.000	1.135.700	EUR	4,5346	2.531.667,18	6,07
iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF	IE00BHZPJ346		ANT	170.000	170.000	0	USD	5,4110	842.834,89	2,02
iShares MSCI USA SRI UCITS ETF	IE00BZ173V67		ANT	2.100	5.730	3.630	EUR	1.446,2000	3.037.020,00	7,29
Summe Wertpapiervermögen								37.832.605,59	90,75	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	6.600,00	0,02	
Aktienindex-Derivate							EUR	6.600,00	0,02	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte							EUR	6.600,00	0,02	
Optionsrechte auf Aktienindizes										
Option Euro Stoxx 50 Put 3600 April 2023	EUREX		STK	3.000			EUR	2,2000	6.600,00	0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	3.787.551,05	9,09	
Bankguthaben							EUR	3.787.551,05	9,09	
EUR - Guthaben bei							EUR	3.787.551,05	9,09	
Verwahrstelle			EUR	3.787.551,05				3.787.551,05	9,09	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	87.742,47	0,21	
Zinsansprüche			EUR					87.742,47	0,21	
Sonstige Verbindlichkeiten ¹⁾							EUR	-26.211,21	-0,06	
Fondsvermögen							EUR	41.688.287,90	100,00 ²⁾	
Anteilwert							EUR	101,01		
Umlaufende Anteile							STK	412.706		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)										90,75
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										0,02

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

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.

Das bisherige Vorgehen bei der Bewertung der Assets des Sondervermögens findet auch vor dem Hintergrund der Auswirkungen durch Covid-19 Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen in diesem Zusammenhang waren bisher nicht notwendig.

Zum Stichtag 31. März 2023 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 100 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.03.2023

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,09140	= 1 (EUR)
----------------------------	-------	---------	-----------

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	European Exchange Deutschland
-------	-------------------------------

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte

per 30.03.2023 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				
3,9000 % Ireland Treasury 2013/2023	IE00B4S3JD47	EUR	0	1.200
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
Amundi Euro Liquidity-Rated Sri	FR0007038138	ANT	12	12
Aramea Rendite Plus Nachhaltig-I	DE000A2DTL86	ANT	40.380	60.650
BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainabi	LU2365458731	ANT	442.100	442.100
DWS Invest ESG Floating Rate Notes	LU1965928069	ANT	20.400	73.700
Invesco EQQQ Nasdaq-100 UCITS ETF	IE00BYVTM552	ANT	11.800	11.800
Lyxor ETF New Energy A	FR0010524777	ANT	66.300	66.300
Lyxor EUR 2-10Y Inflation Expectations UCITS ETF	LU1390062245	ANT	44.620	89.320
SPDR S&P US Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF	IE00BYTH5R14	ANT	0	67.100
UBS ETF - MSCI USA Socially Responsible ETF Adeoh	LU1280303014	ANT	567.020	567.020
Universal - Earth Sus. Resources - I	DE000A2PMW37	ANT	9.150	9.150
iShares DJ EURO STOXX Banks (DE) ETF	DE0006289309	ANT	81.500	81.500
iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	IE00BKLC5874	ANT	289.900	289.900
iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF	IE00BJP26D89	ANT	676.100	1.397.900
iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCI	IE00BKVL7778	ANT	227.300	227.300
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF	IE00BHZPJ676	ANT	146.000	146.000
iShares MSCI World SRI UCITS ETF	IE00BDZZTM54	ANT	521.600	521.600
iShares MSCI World SRI UCITS ETF	IE00BMZ17W23	ANT	748.700	1.400.700
Geldmarktfonds				
Gruppenfremde Geldmarktfonds				
DWS Institutional ESG Euro Money Market Fund	LU0787086031	ANT	920	1.320

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBVVerwaltungsvergütung der im PRO change AMI enthaltenen Investment- % p.a.
anteile:

Amundi Euro Liquidity-Rated Sri	0,24160
Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS	0,14000
Amundi Index Euro Agg Sri UCITS ETF DR	0,16000
Amundi Index MSCI Europe SRI UCITS ETF DR	0,18000
Aramea Rendite Plus Nachhaltig-I	0,95000
Avesco Sustainable Hidden Champions Equity I	1,10000
BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainabi	0,13000
DWS Institutional ESG Euro Money Market Fund	k.A.
DWS Invest ESG Floating Rate Notes	0,10500
Invesco EQQQ Nasdaq-100 UCITS ETF	0,35000
Lyxor ETF New Energy A	1,20000
Lyxor EUR 2-10Y Inflation Expectations UCITS ETF	0,25000
Responsability UCITS Transittit Tone Ze IH-IV EUR	k.A.
SPDR S&P US Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF	0,35000
UBS ETF - MSCI USA Socially Responsible ETF Adeoh	0,68000
UBS ETF - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	0,55000
UBS Irl ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible U	0,28000
UBS-MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	0,50000

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

Verwaltungsvergütung der im PRO change AMI enthaltenen Investment- % p.a.
anteile:

Universal - Earth Sus. Resources - I	2,50000
Xtrackers II ESG EUR Corporate Bond UCITS ETF	0,16000
iShares DJ EURO STOXX Banks (DE) ETF	0,50000
iShares EUR Green Bond UCITS ETF	0,20000
iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	0,25000
iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF	0,09000
iShares Edge MSCI World Minimum Volatility ESG UCI	0,30000
iShares Euro Corp. Bonds ETF	0,15000
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF	0,12000
iShares MSCI Japan ESG Enhanced UCITS ETF	0,15000
iShares MSCI USA SRI UCITS ETF	0,23000
iShares MSCI World SRI UCITS ETF (IE00BDZZTM54/EUR)	0,20000
iShares MSCI World SRI UCITS ETF (IE00BMZ17W23/EUR)	0,23000

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im April 2023

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

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 31.03.2023)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

Ampega Asset Management GmbH (94,9 %)
Talanx AG (5,1 %)

Aufsichtsrat

Dr. Jan Wicke, Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Clemens Jungsthöfel, Stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der Hannover Rück SE, Hannover

Jens Hagemann
Dipl.-Kaufmann, München

Dr. Christian Hermelingmeier
Mitglied des Vorstands der HDI Global SE, Hannover

Sven Lixenfeld
Mitglied des Vorstands der HDI Deutschland AG, Düsseldorf

Geschäftsführung

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

Dr. Dirk Erdmann
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Stefan Kampmeyer (ab dem 01.01.2023)
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Auslagerung

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

Auslagerung Portfoliomanagement

Feri Trust GmbH
Rathausplatz 8 - 10
61348 Bad Homburg v.d.H.
Deutschland

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