ampega.
Talanx Investment Group

Halbjahresbericht

Ampega Credit Opportunities Rentenfonds

1. April 2023 bis 30. September 2023

OGAW-Sondervermögen

Vermögensübersicht zum 30.09.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	**48.508.921,00**	**88,99**
Australien	457.335,00	0,84
Belgien	185.696,00	0,34
Deutschland	3.490.925,00	6,40
Dänemark	482.280,00	0,88
Finnland	1.468.335,00	2,69
Frankreich	6.498.948,50	11,92
Großbritannien	3.640.804,50	6,68
Italien	1.672.642,00	3,07
Japan	1.264.990,00	2,32
Kaimaninseln	519.564,00	0,95
Kanada	984.038,00	1,81
Luxemburg	2.733.328,00	5,01
Niederlande	12.677.536,00	23,26
Schweden	436.920,00	0,80
Spanien	1.381.816,00	2,54
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	8.658.503,00	15,88
Österreich	1.955.260,00	3,59
Asset Backed Securities	**5.575.863,69**	**10,23**
Irland	5.575.863,69	10,23
Derivate	**400.474,74**	**0,73**
Zins-Derivate	-5.050,00	-0,01
Swaps	405.524,74	0,74
Sonstige Vermögensgegenstände	**689.557,69**	**1,27**
Verbindlichkeiten	**-667.144,78**	**-1,22**
Fondsvermögen	**54.507.672,34**	**100,00**[1)]

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

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Vermögensgegenstände										
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR		**42.052.790,42**	**77,15**
Verzinsliche Wertpapiere							EUR		**42.052.790,42**	**77,15**
0,0100 % Bank of Nova Scotia 2021/2027	XS2421186268		EUR	600	0	0	%	85,1480	510.888,00	0,94
0,1250 % De Volksbank MTN 2020/2040	XS2259193998		EUR	1.000	0	0	%	52,2680	522.680,00	0,96
0,5000 % De Volksbank MTN (covered) 2019/2026	XS1943455185		EUR	900	0	0	%	92,6260	833.634,00	1,53
1,3750 % Evonik Industries fix-to-float (sub.) 2021/2081	DE000A3E5WW4		EUR	300	0	0	%	83,7180	251.154,00	0,46
1,4500 % Philip Morris Int. MC 2019/2039	XS2035474555		EUR	800	0	0	%	57,3430	458.744,00	0,84
1,5000 % Ball MC 2019/2027	XS2080318053		EUR	1.200	0	0	%	90,6370	1.087.644,00	2,00
1,5000 % Cellnex Finance MTN MC 2021/2028	XS2348237871		EUR	200	0	0	%	85,8030	171.606,00	0,31
1,6250 % Veolia Environnement PERP fix-to-float (sub.) 2019/2199	FR0013445335		EUR	400	0	0	%	87,6420	350.568,00	0,64
1,6500 % Capital One Financial 2019/2029	XS2010331440		EUR	1.500	1.500	0	%	81,0410	1.215.615,00	2,23
1,7500 % Cellnex Telecom MTN MC 2020/2030	XS2247549731		EUR	300	0	0	%	80,2410	240.723,00	0,44

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
1,7500 % Imperial Brands Finance MC 2021/2033	XS2320459063		EUR	800	0	0	%	70,8760	567.008,00	1,04
1,8750 % Cellnex Telecom MC 2020/2029	XS2193658619		EUR	700	0	0	%	84,2010	589.407,00	1,08
2,0000 % Caisse Centrale Desjardins du Quebec S.GMTN 2022/2026	XS2526825463		EUR	500	0	0	%	94,6300	473.150,00	0,87
2,0000 % Cellnex Finance MC 2021/2033	XS2300293003		EUR	500	0	0	%	76,0160	380.080,00	0,70
2,2500 % BAT Int. Finance MTN MC 2017/2030	XS1664644983		EUR	500	0	0	%	83,5580	417.790,00	0,77
2,3470 % Nat. Australia Bank (covered) 2022/2029	XS2526882001		EUR	500	0	0	%	91,4670	457.335,00	0,84
2,3750 % Bayer fix-to-float (subord.) 2019/2079	XS2077670003		EUR	400	0	0	%	94,5840	378.336,00	0,69
2,3750 % Terna PERP fix-to-float (sub.) 2022/2199	XS2437854487		EUR	800	0	0	%	86,1190	688.952,00	1,26
2,3760 % Telefonica Europe PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2293060658		EUR	600	0	0	%	78,5890	471.534,00	0,87
2,6250 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	FR0014003S56		EUR	600	0	0	%	82,3910	494.346,00	0,91
2,6250 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2294155739		EUR	200	0	0	%	44,1080	88.216,00	0,16
2,6250 % RCI Banque fix-to-float (sub.) 2019/2030	FR0013459765		EUR	1.500	1.000	0	%	94,0810	1.411.215,00	2,59
2,7500 % ZF Finance 2020/2027	XS2262961076		EUR	400	0	0	%	89,0960	356.384,00	0,65
2,8750 % SoftBank Group 2021/2027	XS2361254597		EUR	300	0	0	%	88,1200	264.360,00	0,48
2,9950 % TenneT Holding PERP fix-to-float (sub.) 2017/2199	XS1591694481		EUR	1.000	0	0	%	98,6950	986.950,00	1,81
3,0000 % BAT S.5.25 PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2391779134		EUR	600	0	0	%	85,7480	514.488,00	0,94
3,0000 % Vodafone Group S.NC10 fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2225204010		EUR	600	0	0	%	81,1280	486.768,00	0,89
3,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2029	XS2010039894		EUR	200	200	0	%	83,4700	166.940,00	0,31
3,1250 % Altria Group MC 2019/2031	XS1843443786		EUR	500	0	0	%	84,1280	420.640,00	0,77
3,1250 % Bayer fix-to-float (sub.) 2019/2079	XS2077670342		EUR	100	0	0	%	87,0190	87.019,00	0,16
3,1250 % La Poste PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2199	FR0013331949		EUR	1.100	0	0	%	92,7690	1.020.459,00	1,87
3,2500 % Ford Motor Credit MTN 2020/2025	XS2229875989		EUR	500	500	0	%	96,3420	481.710,00	0,88
3,2500 % Vmed O2 UK Financing I PLC MC 2020/2031	XS2231188876		EUR	1.000	200	300	%	82,0440	820.440,00	1,51
3,3750 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2020/2049	FR0013534336		EUR	400	0	0	%	77,1790	308.716,00	0,57
3,3750 % Naturgy Finance PERP fix-to-float (sub.) 2015/2199	XS1224710399		EUR	500	200	0	%	98,2730	491.365,00	0,90
3,3750 % Raiffeisen Bank Int. MTN 2023/2027	XS2626022656		EUR	600	600	0	%	97,6050	585.630,00	1,07
3,3750 % Schaeffler MTN MC 2020/2028	DE000A3H2TA0		EUR	500	0	0	%	90,4250	452.125,00	0,83
3,3750 % SoftBank Group 2021/2029	XS2361255057		EUR	300	0	0	%	81,5750	244.725,00	0,45
3,3750 % Syngenta Finance MTN MC 2020/2026	XS2154325489		EUR	1.200	0	0	%	96,3390	1.156.068,00	2,12
3,5000 % International Game Technology MC 2019/2026	XS2009038113		EUR	850	0	0	%	95,5810	812.438,50	1,49

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
3,5000 % SES MTN MC 2022/2029	XS2489775580		EUR	500	200	0	%	92,3820	461.910,00	0,85
3,5000 % Telenet Finance Luxembourg MC 2017/2028	BE6300371273		EUR	1.300	0	0	%	92,9260	1.208.038,00	2,22
3,6250 % Darling Global Finance MC 2018/2026	XS1813579593		EUR	1.400	0	0	%	97,0870	1.359.218,00	2,49
3,6250 % UPCB Finance VII MC 2017/2029	XS1634252628		EUR	600	0	0	%	86,5940	519.564,00	0,95
3,8750 % Belden MC (subordinated) 2018/2028	XS1789515134		EUR	800	350	0	%	93,2850	746.280,00	1,37
3,8750 % Volkswagen Int. Fin. S.. PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2187689380		EUR	400	0	0	%	82,4280	329.712,00	0,60
4,0000 % Aegon MTN fix-to-float (subord.) 2014/2044	XS1061711575		EUR	500	500	0	%	98,7290	493.645,00	0,91
4,0000 % SoftBank Group MC 2017/2029	XS1684385591		EUR	300	0	0	%	84,1010	252.303,00	0,46
4,1250 % Elis MTN MC 2022/2027	FR001400AK26		EUR	500	0	0	%	97,9330	489.665,00	0,90
4,2500 % Huhtamaki MC 2022/2027	FI4000523550		EUR	1.500	1.100	0	%	97,8890	1.468.335,00	2,69
4,2500 % Stellantis MTN MC 2023/2031	XS2634690114		EUR	500	1.000	500	%	94,8010	474.005,00	0,87
4,3000 % General Motors Financial MTN MC 2023/2029	XS2587352340		EUR	500	0	0	%	95,9020	479.510,00	0,88
4,7500 % Volkswagen Leasing MTN 2023/2031	XS2694874533		EUR	200	200	0	%	97,1650	194.330,00	0,36
4,8750 % RCI Banque MTN MC 2023/2029	FR001400KY69		EUR	200	200	0	%	98,4430	196.886,00	0,36
5,0000 % SoftBank Group MC 2018/2028	XS1793255941		EUR	550	0	0	%	91,5640	503.602,00	0,92
5,2500 % Imperial Brands Finance Netherlands MTN S.SEP MC 2023/2031	XS2680393761		EUR	500	500	0	%	95,9470	479.735,00	0,88
5,2500 % ORSTED fix-to-float (sub.) (1000Y) 2022/2199	XS2563353361		EUR	500	0	0	%	96,4560	482.280,00	0,88
5,3370 % Celanese US Holdings MC 2022/2029	XS2497520887		EUR	800	800	0	%	97,8910	783.128,00	1,44
5,3750 % BAT Netherlands Finance MTN 2023/2031	XS2589367528		EUR	100	0	0	%	98,8220	98.822,00	0,18
5,3750 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2013/2199	FR0011401751		EUR	300	0	0	%	97,5380	292.614,00	0,54
5,6250 % SES PERP fix-to-float (sub.) 2016/2199	XS1405765659		EUR	100	0	0	%	99,7030	99.703,00	0,18
6,1250 % ZF Europe Finance MTN MC 2023/2029	XS2681541327		EUR	700	700	0	%	99,6940	697.858,00	1,28
6,1350 % Telefonica Europe PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2582389156		EUR	400	400	0	%	96,0270	384.108,00	0,70
6,4630 % BCCE 2017-1X D 2017/2030	XS1663012380		EUR	500	0	0	%	92,0589	460.294,44	0,84
6,5000 % Vodafone Group MTN fix-to-float (sub.) 2023/2084	XS2630490717		EUR	100	400	300	%	100,7150	100.715,00	0,18
6,6250 % Bayer S.NC5 fix-to-float (sub.) 2023/2083	XS2684826014		EUR	700	700	0	%	98,6440	690.508,00	1,27
6,6250 % Ineos Finance S.REGS MC 2023/2028	XS2587558474		EUR	500	0	0	%	97,6330	488.165,00	0,90
6,7210 % HNLY 4X D 2021/2034	XS2291282486		EUR	750	0	0	%	90,9864	682.398,12	1,25
6,7500 % Telefonica Europe S.. PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2646608401		EUR	200	200	0	%	98,5030	197.006,00	0,36
6,9600 % PALMP 1X C 2017/2030	XS1566964125		EUR	750	0	0	%	95,0179	712.634,16	1,31
7,0000 % Bay. Landesbank fix-to-float (sub.) 2023/2034	XS2696902837		EUR	500	500	0	%	99,0050	495.025,00	0,91

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
7,0000 % Webuild MC 2023/2028	XS2681940297		EUR	1.000	1.000	0	%	98,3690	983.690,00	1,80
7,0630 % SCULE 6X DR 2021/2034	XS2369735225		EUR	1.000	0	0	%	91,8263	918.262,61	1,68
7,2500 % Forvia MC 2022/2026	XS2553825949		EUR	450	200	0	%	103,0850	463.882,50	0,85
7,3630 % DRYD 2016-46X DRR 2021/2034	XS2318620486		EUR	1.000	0	0	%	94,0325	940.325,09	1,73
7,8750 % Volkswagen Int. Fin. fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2675884733		EUR	700	700	0	%	100,9690	706.783,00	1,30
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**EUR**		**12.031.994,27**	**22,07**
Verzinsliche Wertpapiere							**EUR**		**12.031.994,27**	**22,07**
2,2500 % Quintiles IMS Health S.REGS MC 2021/2029	XS2305744059		EUR	600	600	0	%	83,4950	500.970,00	0,92
2,3750 % Forvia MC 2021/2029	XS2312733871		EUR	400	0	0	%	81,4430	325.772,00	0,60
2,3750 % Phoenix PIB Dutch Finance MC 2020/2025	XS2212959352		EUR	1.000	0	0	%	95,4790	954.790,00	1,75
2,5000 % Solvay PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	BE6324000858		EUR	200	0	0	%	92,8480	185.696,00	0,34
2,6250 % Graphic Packaging International MC 2021/2029	XS2407520936		EUR	600	0	0	%	87,4230	524.538,00	0,96
2,8750 % SES PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2010028343		EUR	1.100	0	0	%	87,6070	963.677,00	1,77
3,0000 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2357357768		EUR	800	0	0	%	43,5880	348.704,00	0,64
3,0210 % Ford Motor Credit MTN 2019/2024	XS1959498160		EUR	500	0	0	%	99,1790	495.895,00	0,91
3,6250 % Sappi Papier Holding S.REGS MC 2021/2028	XS2310951103		EUR	1.100	700	400	%	88,4180	972.598,00	1,78
3,8750 % Netflix 2019/2029	XS1989380172		EUR	900	200	0	%	96,0050	864.045,00	1,59
3,9710 % Amprion MC 2022/2032	DE000A30VPM1		EUR	200	0	0	%	96,0380	192.076,00	0,35
4,6250 % Netflix 2018/2029	XS2076099865		EUR	600	0	0	%	99,9640	599.784,00	1,10
4,8750 % REWE International Finance MC 2023/2030	XS2679898184		EUR	600	600	0	%	99,0360	594.216,00	1,09
5,0000 % Crown European Holdings MC 2023/2028	XS2623222978		EUR	1.150	1.150	0	%	99,5500	1.144.825,00	2,10
6,0000 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float 2023/2028	XS2682093526		EUR	400	400	0	%	99,2580	397.032,00	0,73
6,2500 % OI European Group S.REGS MC 2023/2028	XS2624554320		EUR	700	1.000	300	%	101,6370	711.459,00	1,31
6,6630 % AQUE 2019-4X DR 2021/2032	XS2387684033		EUR	1.000	0	0	%	91,9367	919.366,84	1,69
7,0000 % Bayer fix-to-float (sub.) 2023/2083	XS2684846806		EUR	400	400	0	%	98,4920	393.968,00	0,72
7,1050 % GLME 3X DR 2021/2032	XS2377775650		EUR	500	0	0	%	93,4278	467.138,76	0,86
7,5310 % BLACK 2019-1X DR 2021/2032	XS2390848427		EUR	500	0	0	%	95,0887	475.443,67	0,87
Summe Wertpapiervermögen									**54.084.784,69**	**99,22**
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							**EUR**		**400.474,74**	**0,73**
Zins-Derivate							**EUR**		**-5.050,00**	**-0,01**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte							**EUR**		**-5.050,00**	**-0,01**
Euro-BTP Future Dezember 2023		EUREX	STK	-40					210.400,00	0,39
Euro-Bund Future Dezember 2023		EUREX	STK	55					-215.450,00	-0,40

Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Swaps							**EUR**		**405.524,74**	**0,74**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Credit Default Swaps							**EUR**		**405.524,74**	**0,74**
Protection Seller										
Airbus Group MTN MC / 100 BP (CGME) 13.1.23-20.12.29	OTC		EUR	-1.000					2.408,99	0,00
ArcelorMittal MTN MC / 500 BP (JPM-AG) 28.9.21-20.6.28	OTC		EUR	-1.000					126.780,19	0,23
Barclays Bank MTN / 100 BP (JPM-AG) 12.6.23-20.6.28	OTC		EUR	-500					-1.589,73	-0,00
CNH Industrial Finan. Europe MTN / 500 BP (BACRSEC) 1.3.23-20.12.29	OTC		EUR	-1.000					179.218,22	0,33
Deutsche Bank MTN FRN / 100 BP (JPM-AG) 24.3.23-20.6.24	OTC		EUR	-1.000					2.517,94	0,00
Electricite de France MTN / 100 BP (JPM-AG) 26.1.22-20.12.28	OTC		EUR	-700					-1.410,11	-0,00
Gas Natural Capital Markets MTN MC / 100 BP (CGME) 26.1.22-20.12.28	OTC		EUR	-700					9.257,71	0,02
Iberdrola Int. MTN / 100 BP (BOASEC) 28.9.21-20.6.28	OTC		EUR	-500					10.402,53	0,02
Intesa Sanpaolo MTN / 100 BP (BACRSEC) 20.6.23-20.6.26	OTC		EUR	-500					2.923,69	0,01
Lanxess MTN -single callable- / 100 BP (JPM-AG) 17.4.23-20.6.28	OTC		EUR	-1.000					-44.030,38	-0,08
Solvay MC / 100 BP (JPM-AG) 10.5.23-20.6.30	OTC		EUR	-1.000					-2.804,94	-0,01
Stellantis MTN MC / 500 BP (MSE) 8.3.23-20.12.27	OTC		EUR	-1.000					143.052,09	0,26
Volkswagen Int. Fin. FRN / 100 BP (BACRSEC) 27.7.23-20.6.30	OTC		EUR	-500					-21.201,46	-0,04
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**		**689.557,69**	**1,27**
Ansprüche aus Credit Default Swaps			EUR						10.566,68	0,02
Zinsansprüche			EUR						678.991,01	1,25
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							**EUR**		**-639.906,61**	**-1,17**
EUR - Kredite							**EUR**		**-639.906,61**	**-1,17**
Verwahrstelle			EUR	-639.906,61					-639.906,61	-1,17
Sonstige Verbindlichkeiten[1]							**EUR**		**-27.238,17**	**-0,05**
Fondsvermögen							**EUR**		**54.507.672,34**	**100,00**[2]
Anteilwert Klasse P (a)							**EUR**		**88,47**	
Anteilwert Klasse I (a)							**EUR**		**88,19**	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)							**STK**		**227.262,348**	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)							**STK**		**390.088,236**	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)							**EUR**		**20.106.900,55**	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)							**EUR**		**34.400.771,79**	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)										**99,22**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										**0,73**

[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.

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 30. September 2023 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 89,03 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 10,97 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Marktschlüssel	
Terminbörsen	
EUREX	European Exchange Deutschland
OTC	**Over-the-Counter**

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 28.09.2023 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				
0,6250 % SNAM MTN MC 2021/2031	XS2358231798	EUR	0	500
0,8000 % Capital One Financial 2019/2024	XS2009011771	EUR	500	1.000
1,6250 % Elis MTN MC 2019/2028	FR0013449998	EUR	0	200
1,8750 % Verallia MC 2021/2031	FR0014006EG0	EUR	0	1.100
2,0000 % Nokia MTN MC 2019/2026	XS1960685383	EUR	0	1.000
2,0000 % Nokia Oyj MC 2017/2024	XS1577731604	EUR	0	400
2,3750 % Accor MC 2021/2028	FR0014006ND8	EUR	0	600
2,3750 % International Game Technology MC 2019/2028	XS2051904733	EUR	0	200
2,5000 % INEOS Quattro Finance 2 S.REGs MC 2021/2026	XS2291929573	EUR	500	500
2,5000 % ZF Europe Finance MC 2019/2027	XS2010039977	EUR	0	100
2,6250 % Crown European Holdings MC 2016/2024	XS1490137418	EUR	0	850
2,7500 % ZF North America Capital 2015/2023	DE000A14J7G6	EUR	0	200
3,0000 % ZF Finance MTN MC 2020/2025	XS2231715322	EUR	400	400
3,1250 % PVH 2017/2027	XS1734066811	EUR	0	800
3,3750 % Crown European Holdings MC 2015/2025	XS1227287221	EUR	0	650
3,7500 % British Telecom MTN MC 2023/2031	XS2582814039	EUR	0	500
3,7500 % ZF Finance GmbH 2028 2020/2028	XS2231331260	EUR	300	300
3,9070 % General Mills MC 2023/2029	XS2605914105	EUR	0	100
4,1250 % Booking Holdings MC 2023/2033	XS2621007660	EUR	500	500
4,2500 % Stora Enso MTN MC 2023/2029	XS2629064267	EUR	300	300
4,3750 % Nokia MTN MC 2023/2031	XS2488809612	EUR	0	300
4,5000 % A2A SpA MTN MC 2022/2030	XS2534976886	EUR	0	300
4,5000 % DS Smith MTN MC 2023/2030	XS2654098222	EUR	600	600

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**
4,7500 % Anglo American Capital MTN MC 2022/2032	XS2536431617	EUR	0	500
5,1250 % Volkswagen Int. Fin. PERP fix-to-float (sub.) 2013/2023	XS0968913342	EUR	0	200
5,3990 % Assicurazioni Generali MTN MC (sub.) 2023/2033	XS2609970848	EUR	500	500
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
1,6250 % Daimler Truck International Finance MTN 2022/2027	XS2466172363	EUR	0	1.000
1,6250 % Grifols MC 2019/2025	XS2076836555	EUR	0	400
3,1250 % OI European Group MC 2016/2024	XS1405765907	EUR	0	500
3,3750 % Ineos Finance S.REGS MC 2020/2026	XS2250349581	EUR	0	700
3,5000 % VZ Secured Financing S.REGS MC 2022/2032	XS2431015655	EUR	0	900
3,6250 % Netflix 2017/2027	XS1821883102	EUR	0	200
3,8750 % Bouygues MC 2023/2031	FR001400IBM5	EUR	1.000	1.000

Gattungsbezeichnung	**Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000**	**Käufe / Zugänge**	**Verkäufe / Abgänge**	**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.38 -5 Jahre- / 500 BP (CGME) 30.3.23-20.12.27)				
Terminkontrakte				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte	**EUR**			**11.944**
(Basiswert(e): BUND)				
Verkaufte Kontrakte	**EUR**			**5.771**
(Basiswert(e): 10YR Italian Govt. Bonds)				

Köln, im Oktober 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 30.09.2023)
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
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).

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

(Einrichtung gem. Artikel 92 der OGAW-Richtlinie in der Änderungsfassung auf Grund der Richtline (EU) 2019/116)

Schelhammer Capital Bank AG
Burgring 16
8010 Graz
Österreich

Steuerlicher Vertreter

Deloitte Tax Wirtschaftsprüfungs GmbH
Renngasse 1/Freyung
1010 Wien
Österreich

Der Fonds wird in Österreich ausschließlich über konzessionierte Banken, konzessionierte Wertpapierfirmen und/oder konzessionierte Wertpapierdienstleistungsunternehmen vertrieben. Rücknahmeanträge können bei der österreichischen Zahlstelle eingereicht werden. Die Rückkäufe können elektronisch (bei angebundenen Drittbanken) oder schriftlich erteilt werden. Die Rücknahmeerlöse werden vollautomatisiert den definierten Referenzkonten gutgeschrieben.

Gültige Verkaufsprospekte nebst Fondsanlagebedingungen, Jahres und Halbjahresberichte sowie ggf. weitere Fondsunterlagen sind bei der Zahl- und Informationsstelle erhältlich. Diese Unterlagen sowie weitere Hinweise finden Sie auch auf der Homepage der Gesellschaft (www.ampega.com). Änderungen der Fondsbestimmungen sowie weitere Informationen zu den Anlegerrechten werden von der Gesellschaft anlassbezogen per dauerhaftem Datenträger, unter Einbeziehung der depotführenden Stellen, unmittelbar an die Anleger versandt.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden börsentäglich auf der Homepage der Gesellschaft (www.ampega.com) veröffentlicht. Gerichtsstand für Klagen gegen die Gesellschaft, 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 § 3 KSchG anzuwenden ist.

Beschwerden im Zusammenhang mit dem Erwerb der Investmentanteile können direkt bei der Gesellschaft unter der E-Mail-Adresse **fonds@ampega.com** platziert werden. Die Gesellschaft fungiert auch als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der jeweils zuständigen Behörde.

Besonderheiten für Anleger aus Luxemburg

Dieser Anhang enthält zusätzliche Informationen für Anleger des Sondervermögens in Luxemburg. Dieser Anhang ist Bestandteil des Verkaufsprospekts und sollte im Zusammenhang mit dem jeweils gültigen Verkaufsprospekts des Sondervermögens (der „Verkaufsprospekt“) gelesen werden. Sofern nicht anders angegeben, haben alle definierten Begriffe in diesem Anhang dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft hat die Absicht, Anteile des Sondervermögens in Luxemburg öffentlich zu vertreiben; sie hat dies der Finanzmarktaufsicht angezeigt und ist hierzu seit Abschluss des Anzeigeverfahrens berechtigt.

Zahl- und Informationsstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG
Niederlassung Luxemburg
1c, rue Gabriel Lippmann
5365 Munsbach
Großherzogtum Luxemburg

Das Sondervermögen wird in Luxemburg über konzessionierte Banken, konzessionierte Wertpapierfirmen und/oder konzessionierte Wertpapierdienstleistungsunternehmen vertrieben. Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können bei der luxemburgischen Zahlstelle eingereicht werden. Gültige Verkaufsprospekte nebst Fondsanlagebedingungen, 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 Ampega Investment GmbH (www.ampega.com).

Der jeweils gültige Ausgabe- und Rücknahmepreis wird auf der Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft (www.ampega.com) veröffentlicht. Mitteilungen an die Anleger erfolgen ebenfalls über die Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft (www.ampega.com).

Gerichtsstand für Klagen gegen die Kapitalverwaltungsgesellschaft, die auf den Vertrieb der Investmentanteile in Luxemburg Bezug nehmen, ist Luxemburg (Stadt).

In Ergänzung zum Hinweis nach § 305 KAGB im Verkaufsprospekt (Widerrufsrechte bei „Haustürgeschäften“) gilt für luxemburgische Anleger Art. L. 221-3 des Verbrauchergesetzbuches (Code de la Consommation).

Besteuerung

Bitte beachten Sie, dass die Besteuerung nach Luxemburger Recht wesentlich von der im Verkaufsprospekt dargelegten steuerlichen Situation abweichen kann. Anteilinhaber und interessierte Personen sollten ihren Steuerberater bezüglich der auf ihre Anteilsbestände fälligen Steuern konsultieren.

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