

Halbjahresbericht

AEI Multi Asset Defensive

17. April 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	3.288.604,03	32,60
Deutschland	854.951,00	8,47
Frankreich	621.534,50	6,16
Irland	273.046,80	2,71
Italien	75.432,00	0,75
Niederlande	186.222,00	1,85
Schweiz	861.541,89	8,54
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	415.875,84	4,12
Verzinsliche Wertpapiere	5.201.714,50	51,56
Belgien	665.849,00	6,60
Deutschland	1.403.942,00	13,92
Großbritannien	186.732,00	1,85
Niederlande	499.656,00	4,95
Portugal	330.949,50	3,28
Schweiz	179.462,00	1,78
Spanien	367.688,00	3,64
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	770.357,00	7,64
Österreich	797.079,00	7,90
Bankguthaben	1.569.185,97	15,55
Sonstige Vermögensgegenstände	36.637,89	0,36
Verbindlichkeiten	-7.871,28	-0,08
Fondsvermögen	10.088.271,11	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	8.129.688,53	80,59
Aktien						EUR	3.288.604,03	32,60
Deutschland						EUR	854.951,00	8,47
Allianz SE	DE0008404005	STK	800	800	0	EUR 211,0500	168.840,00	1,67
Beiersdorf AG	DE0005200000	STK	1.400	1.400	0	EUR 120,0500	168.070,00	1,67
Covestro AG	DE0006062144	STK	4.400	4.400	0	EUR 46,8400	206.096,00	2,04
Infineon Technologies AG	DE0006231004	STK	3.800	3.800	0	EUR 36,6350	139.213,00	1,38
SAP SE	DE0007164600	STK	1.400	1.400	0	EUR 123,3800	172.732,00	1,71
Frankreich						EUR	621.534,50	6,16
Air Liquide SA	FR0000120073	STK	1.000	1.000	0	EUR 163,2000	163.200,00	1,62
Essilor International SA	FR0000121667	STK	950	950	0	EUR 168,7000	160.265,00	1,59
Saint-Gobain (Cie. de) SA	FR0000125007	STK	2.750	3.500	750	EUR 55,0500	151.387,50	1,50
Schneider Electric SE	FR0000121972	STK	900	1.200	300	EUR 162,9800	146.682,00	1,45
Irland						EUR	273.046,80	2,71
Johnson Controls International plc	IE00BY7QL619	STK	1.600	4.400	2.800	USD 67,3200	98.922,72	0,98
Linde PLC	IE00059YS762	STK	500	500	0	USD 379,1900	174.124,08	1,73
Italien						EUR	75.432,00	0,75
Moncler SpA	IT0004965148	STK	1.200	3.600	2.400	EUR 62,8600	75.432,00	0,75
Niederlande						EUR	186.222,00	1,85
ASML Holding NV	NL0010273215	STK	170	300	130	EUR 668,4000	113.628,00	1,13
ASR Nederland NV	NL0011872643	STK	1.800	4.200	2.400	EUR 40,3300	72.594,00	0,72
Schweiz						EUR	861.541,89	8,54
ABB Ltd.	CH0012221716	STK	3.250	3.250	0	CHF 34,4700	114.681,22	1,14
Alcon Inc.	CH0432492467	STK	2.600	2.600	0	CHF 72,5800	193.178,14	1,91

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Wbg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Lindt&Spruengli AG PS	CH0010570767	STK	9	9	0	CHF 11.050,0000	101.805,79	1,01
STMicroelectronics NV	NL0000226223	STK	2.750	4.500	1.750	EUR 44,6050	122.663,75	1,22
Straumann Holdings	CH1175448666	STK	1.300	1.300	0	CHF 140,9000	187.508,96	1,86
dorma+kaba Holding AG	CH0011795959	STK	350	450	100	CHF 395,5000	141.704,03	1,40
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)						EUR	415.875,84	4,12
Microsoft Corp.	US5949181045	STK	720	720	0	USD 335,0500	221.551,18	2,20
NVIDIA Corp.	US67066G1040	STK	250	600	350	USD 408,2200	93.727,33	0,93
Oracle Corp.	US68389X1054	STK	930	930	0	USD 117,7800	100.597,33	1,00
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	4.841.084,50	47,99
0,0000 % Bundesobligation S.183 2021/2026	DE0001141836	EUR	400	400	0	% 92,3580	369.432,00	3,66
0,0000 % Ned. Waterschapsbank MTN 2021/2031	XS2382267750	EUR	400	400	0	% 77,8890	311.556,00	3,09
0,0000 % Zuercher Kantonalbank MTN 2021/2026	CH1111393000	EUR	200	200	0	% 89,7310	179.462,00	1,78
0,3750 % Metrop. Life Global Fdg. I 2019/2024	XS1979259220	EUR	300	300	0	% 97,3430	292.029,00	2,89
0,5000 % Procter & Gamble 2017/2024	XS1708192684	EUR	300	300	0	% 95,8100	287.430,00	2,85
0,9000 % Austria 2022/2032	AT0000A2WSC8	EUR	600	600	0	% 84,2420	505.452,00	5,01
0,9000 % Belgium 2019/2029	BE0000347568	EUR	300	300	0	% 89,3830	268.149,00	2,66
1,0000 % Bundesobligation 2022/2038	DE0001102598	EUR	600	600	0	% 81,4210	488.526,00	4,84
1,1250 % Infineon Technologies MTN MC 2020/2026	XS2194283672	EUR	200	400	200	% 92,6770	185.354,00	1,84
1,2500 % ISS Finance MTN MC 2020/2025	XS2199343513	EUR	200	200	0	% 94,0500	188.100,00	1,86
1,5000 % Verbund 2014/2024	XS1140300663	EUR	300	300	0	% 97,2090	291.627,00	2,89
1,6250 % Linde 2014/2025	XS1143916465	EUR	200	400	200	% 95,4490	190.898,00	1,89
1,6250 % Mondi Finance MTN MC 2018/2026	XS1813593313	EUR	200	200	0	% 93,3660	186.732,00	1,85
1,9500 % Portugal 2019/2029	PTOTEXOE0024	EUR	350	350	0	% 94,5570	330.949,50	3,28
1,9500 % Spain 2015/2030	ES00000127A2	EUR	400	400	0	% 91,9220	367.688,00	3,64
3,0000 % Belgium S.97 2023/2033	BE0000357666	EUR	400	400	0	% 99,4250	397.700,00	3,94
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	360.630,00	3,57
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	360.630,00	3,57
0,0000 % KfW MTN 2021/2031	DE000A3H2ZF6	EUR	450	450	0	% 80,1400	360.630,00	3,57
Summe Wertpapiervermögen							8.490.318,53	84,16
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	1.569.185,97	15,55
Bankguthaben						EUR	1.569.185,97	15,55
EUR - Guthaben bei						EUR	1.569.185,97	15,55
Verwahrstelle		EUR	969.185,97				969.185,97	9,61
Landesbank Baden-Württemberg		EUR	600.000,00				600.000,00	5,95
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	36.637,89	0,36
Dividendenansprüche		EUR					17.094,70	0,17
Zinsansprüche		EUR					19.543,19	0,19
Sonstige Verbindlichkeiten²⁾						EUR	-7.871,28	-0,08
Fondsvermögen						EUR	10.088.271,11	100,00²⁾
Anteilwert						EUR	5.044,14	
Umlaufende Anteile						STK	2.000	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								84,16
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

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. Juni 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 29.06.2023

Schweiz, Franken	(CHF)	0,97686	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08885	= 1 (EUR)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 29.06.2023 oder letztbekannte
---------------------	-----------------------------------

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen**Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzunordnung zum Berichtsstichtag)**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Deutschland				
Deutsche Telekom AG	DE0005557508	STK	5.000	5.000
Frankreich				
Kering SA	FR0000121485	STK	300	300
Schweiz				
Sonova Holding AG	CH0012549785	STK	600	600
Swisscom AG	CH0008742519	STK	280	280
Verzinsliche Wertpapiere				
0,5000 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2021/2028	FR0014006NI7	EUR	400	400
2,3750 % Saint Gobain MC 2020/2027	XS2150054372	EUR	400	400
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Bundesobligation 2022/2023	DE0001030856	EUR	2.200	2.200

Köln, im Juli 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 30.06.2023)
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).

Anlageberater

Arete Ethik Invest AG
Talstraße 58
8001 Zürich
Schweiz

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