

# Halbjahresbericht

Ampega CrossoverPlus Rentenfonds

RCS-Nummer: K1386

1. Juli 2020 bis 31. Dezember 2020

Anlagefonds  
luxemburgischen Rechts





# Halbjahresbericht

## Vermögensübersicht zum 31.12.2020

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Vermögensgegenstände</b>		
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>	<b>66.315.091,35</b>	<b>91,42</b>
Australien	253.512,50	0,35
Belgien	1.062.698,00	1,46
Deutschland	3.728.535,00	5,14
Dänemark	847.350,00	1,17
Finnland	215.412,00	0,30
Frankreich	7.361.640,00	10,15
Großbritannien	7.959.020,00	10,97
Irland	2.852.158,70	3,93
Italien	4.026.888,00	5,55
Japan	1.995.839,00	2,75
Kaimaninseln	795.555,00	1,10
Luxemburg	3.756.651,00	5,18
Mexiko	575.200,00	0,79
Niederlande	12.577.268,35	17,34
Portugal	299.865,00	0,41
Spanien	1.839.204,00	2,54
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	14.005.257,00	19,31
Österreich	2.163.037,80	2,98
<b>Asset Backed Securities</b>	<b>5.258.365,26</b>	<b>7,25</b>
Irland	4.258.131,63	5,87
Niederlande	1.000.233,63	1,38
<b>Derivate</b>	<b>-55.440,19</b>	<b>-0,08</b>
Zins-Derivate	8.700,00	0,01
Swaps	-64.140,19	-0,09
<b>Bankguthaben</b>	<b>191.401,47</b>	<b>0,26</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>960.744,24</b>	<b>1,32</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>	<b>-128.639,02</b>	<b>-0,18</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>72.541.523,11</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>63.500.683,91</b>	<b>87,54</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,0000 % Aroundtown MTN MC 2020/2026	XS2273810510		EUR	300	300	0	% 98,1080	294.324,00	0,41
0,6250 % Stora Enso MTN MC 2020/2030	XS2265360359		EUR	100	100	0	% 101,8390	101.839,00	0,14
0,8500 % General Motors Financial MC 2020/2026	XS2125145867		EUR	2.000	600	0	% 100,8040	2.016.080,00	2,78
1,5000 % Kraft Heinz Foods MC 2016/2024	XS1405782407		EUR	500	0	300	% 102,8630	514.315,00	0,71
1,5000 % ISS Global MTN MC 2017/2027	XS1673102734		EUR	500	500	0	% 101,3280	506.640,00	0,70
1,5000 % Bertelsmann MTN MC 2020/2030	XS2176558620		EUR	500	0	0	% 110,0430	550.215,00	0,76
1,6150 % FCE Bank MTN 2016/2023	XS1409362784		EUR	500	0	0	% 100,4960	502.480,00	0,69
1,6250 % Elis MTN MC 2019/2028	FR0013449998		EUR	500	0	0	% 98,6220	493.110,00	0,68
1,6250 % Anglo American Capital MTN 2017/2025	XS1686846061		EUR	200	200	0	% 106,5750	213.150,00	0,29
1,6250 % Anglo American Capital MTN - single callable- 2019/2026	XS1962513674		EUR	500	0	0	% 106,4370	532.185,00	0,73
1,6250 % Dell Bank MC 2020/2024	XS2193734733		EUR	400	0	0	% 103,8300	415.320,00	0,57
1,7000 % Energias de Portugal -rating sen.- (sub.) 2020/2080	PTEDPLOM0017		EUR	300	0	0	% 99,9550	299.865,00	0,41
1,7500 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	XS1974787480		EUR	600	0	0	% 102,9070	617.442,00	0,85
1,7500 % ArcelorMittal MTN MC 2019/2025	XS2082324018		EUR	800	0	200	% 103,3080	826.464,00	1,14
1,7500 % Cellnex Telecom MTN MC 2020/2030	XS2247549731		EUR	500	500	0	% 101,1360	505.680,00	0,70
1,8740 % British Telecom fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2119468572		EUR	100	0	200	% 98,5130	98.513,00	0,14
1,8750 % Cellnex Telecom MC 2020/2029	XS2193658619		EUR	900	900	0	% 103,0000	927.000,00	1,28
2,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2026	XS2010039381		EUR	600	0	0	% 99,3510	596.106,00	0,82
2,0000 % Koninklijke KPN PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	XS2069101868		EUR	300	0	0	% 100,5030	301.509,00	0,42
2,0000 % SES S.GMTN MC 2020/2028	XS2196317742		EUR	500	500	0	% 107,8520	539.260,00	0,74
2,0000 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2020/2099	XS2224632971		EUR	500	500	0	% 103,7860	518.930,00	0,72
2,1250 % Walgreens Boots Alliance -single callable- 2014/2026	XS1138360166		EUR	300	0	0	% 107,8500	323.550,00	0,45
2,1250 % ADLER Real Estate MC 2017/2024	XS1731858715		EUR	100	0	400	% 101,4460	101.446,00	0,14
2,1250 % Celanese US Holdings MC 2018/2027	XS1901137361		EUR	1.000	600	0	% 107,3240	1.073.240,00	1,48
2,2000 % Altria Group MC 2019/2027	XS1843443190		EUR	700	0	0	% 109,2980	765.086,00	1,05
2,2500 % BAT Int. Finance MTN MC 2017/2030	XS1664644983		EUR	900	900	0	% 110,1450	991.305,00	1,37
2,2500 % IQVIA MC 2019/2028	XS2036798150		EUR	550	0	0	% 101,2120	556.666,00	0,77
2,2500 % INEOS Styrolution Group MC 2020/2027	XS2108560306		EUR	400	0	300	% 97,1420	388.568,00	0,54
2,3300 % Ford Motor Credit 2019/2025	XS2052337503		EUR	200	0	0	% 101,9620	203.924,00	0,28
2,3750 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2019/2079	XS2077670003		EUR	200	0	0	% 101,7850	203.570,00	0,28
2,3750 % Airbus Group MTN MC 2020/2040	XS2185868051		EUR	600	600	0	% 120,2440	721.464,00	0,99
2,3750 % JT Intl. Fin. Services fix-to-float (sub.) 2020/2081	XS2238783422		EUR	200	200	0	% 106,6990	213.398,00	0,29
2,3860 % Ford Motor Credit 2019/2026	XS2013574384		EUR	300	0	300	% 101,9580	305.874,00	0,42
2,5000 % Telecom Italia MTN 2017/2023	XS1551678409		EUR	200	0	400	% 104,8870	209.774,00	0,29
2,5000 % Stora Enso MTN MC 2017/2027	XS1624344542		EUR	100	100	300	% 113,5730	113.573,00	0,16
2,5000 % ZF Europe Finance MC 2019/2027	XS2010039977		EUR	100	0	0	% 101,1320	101.132,00	0,14
2,5000 % OMV S.. PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2224439385		EUR	100	100	0	% 104,2870	104.287,00	0,14
2,6000 % GLME 3X C 2019/2032	XS2027909766		EUR	500	0	0	% 100,3532	501.766,10	0,69

## &gt;&gt; Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
2,6250 % Accor PERP Multi Reset Notes (subord.) 2019/2099	FR0013457157		EUR	400	0	0	% 93,2450	372.980,00	0,51
2,6250 % RCI Banque fix-to-float (sub.) 2019/2030	FR0013459765		EUR	900	0	0	% 101,2210	910.989,00	1,26
2,6250 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2017/2099	XS1731823255		EUR	700	0	400	% 101,6060	711.242,00	0,98
2,6250 % Faurecia MC 2018/2025	XS1785467751		EUR	200	200	0	% 101,8630	203.726,00	0,28
2,7080 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2016/2099	XS1501167164		EUR	200	0	0	% 104,8850	209.770,00	0,29
2,7500 % Wienerberger MC 2020/2025	AT0000A2GLA0		EUR	300	0	300	% 106,8000	320.400,00	0,44
2,7500 % Arkema MTN PERP fix-to-float (subordinated) 2019/2099	FR0013425170		EUR	500	0	0	% 105,3950	526.975,00	0,73
2,7500 % ZF Finance 2020/2027	XS2262961076		EUR	400	600	200	% 101,9870	407.948,00	0,56
2,8000 % BCCE 2017-1X D 2017/2030	XS1663012380		EUR	500	0	0	% 98,8126	494.062,97	0,68
2,8750 % ThyssenKrupp MTN MC 2019/2024	DE000A2TEDB8		EUR	300	0	200	% 101,1420	303.426,00	0,42
2,8750 % Schaeffler AG MTN MC 2019/2027	DE000A2YB7B5		EUR	400	0	0	% 106,7930	427.172,00	0,59
2,8750 % OMV PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2099	XS1713462403		EUR	300	0	0	% 104,8940	314.682,00	0,43
2,8750 % Ineos Finance MC 2019/2026	XS1843437549		EUR	600	0	0	% 101,5230	609.138,00	0,84
2,8750 % Smurfit Kappa Acquisitions MC 2018/2026	XS1849518276		EUR	700	200	0	% 110,7320	775.124,00	1,07
2,8750 % OMV S.. PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2224439971		EUR	400	400	0	% 105,1930	420.772,00	0,58
2,8750 % JT Intl. Fin. Services PERP fix-to-float (sub.) 2020/2083	XS2238783778		EUR	200	200	0	% 110,8300	221.660,00	0,31
2,9500 % Fidelity National Information Services MC 2019/2039	XS1843436145		EUR	300	0	0	% 128,6790	386.037,00	0,53
2,9950 % TenneT Holding PERP Multi Reset Notes (subord.) 2017/2099	XS1591694481		EUR	200	0	0	% 105,8990	211.798,00	0,29
3,0000 % Centrica Multi Reset Notes (sub.) 2015/2076	XS1216020161		EUR	500	0	0	% 100,7320	503.660,00	0,69
3,0000 % Bertelsmann Multi Reset Notes (sub.) 2015/2075	XS1222591023		EUR	700	0	0	% 103,5430	724.801,00	1,00
3,0000 % Telecom Italia MTN 2016/2025	XS1497606365		EUR	350	0	0	% 106,9000	374.150,00	0,52
3,0000 % Holcim Finance (Luxembourg) fix-to-float (sub.) 2019/2099	XS1713466495		EUR	500	0	0	% 104,5030	522.515,00	0,72
3,0000 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2018/2099	XS1795406575		EUR	100	0	0	% 102,8050	102.805,00	0,14
3,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2029	XS2010039894		EUR	300	0	200	% 102,5450	307.635,00	0,42
3,0000 % Vodafone Group S.NC10 fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2225204010		EUR	600	600	0	% 104,5240	627.144,00	0,86
3,1000 % Vodafone Group fix-to-float (sub.) 2018/2079	XS1888179477		EUR	700	0	0	% 103,8430	726.901,00	1,00
3,1250 % La Poste PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2099	FR0013331949		EUR	600	0	0	% 107,6190	645.714,00	0,89
3,1250 % SoftBank Group MC 2017/2025	XS1684385161		EUR	1.123	0	0	% 102,9000	1.155.567,00	1,59
3,1250 % PVH 2017/2027	XS1734066811		EUR	800	400	300	% 111,1910	889.528,00	1,23
3,1250 % Sappi Papier Holding MC 2019/2026	XS1961852750		EUR	820	0	500	% 97,8640	802.484,80	1,11
3,1250 % Faurecia MC 2019/2026	XS1963830002		EUR	700	0	0	% 103,0310	721.217,00	0,99
3,1250 % Bayer Multi Reset Notes (subord.) 2019/2079	XS2077670342		EUR	100	0	0	% 105,2890	105.289,00	0,15
3,1250 % SSE PERP fix-to-float (sub.) 2020/2099	XS2195190520		EUR	500	500	0	% 106,6240	533.120,00	0,73
3,1500 % AT&T MC 2017/2036	XS1629866432		EUR	600	100	0	% 126,9530	761.718,00	1,05
3,2500 % Groupe Auchan MTN MC 2020/2027	FR0013524865		EUR	1.100	1.100	0	% 115,5240	1.270.764,00	1,75
3,2500 % BP Capital Markets PERP fix-to-float 2020/2099	XS2193661324		EUR	400	0	0	% 106,7290	426.916,00	0,59

## &gt;&gt; Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,2500 % Vmed O2 UK Financing I PLC MC 2020/2031	XS2231188876		EUR	1.600	1.600	0	% 102,9330	1.646.928,00	2,27
3,3000 % PALMP 1X C 2017/2030	XS1566964125		EUR	750	750	0	% 100,0266	750.199,39	1,03
3,3000 % DRYD 2016-46X DR 2019/2030	XS1999709170		EUR	1.000	0	0	% 100,0234	1.000.233,63	1,38
3,3250 % MPT Operating Partnership/MPT Finance MC 2017/2025	XS1523028436		EUR	300	0	400	% 106,7030	320.109,00	0,44
3,3750 % Syngenta Finance MTN MC 2020/2026	XS2154325489		EUR	1.200	1.200	0	% 108,2370	1.298.844,00	1,79
3,3750 % Eni S.NC9 PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2242931603		EUR	400	800	400	% 107,5070	430.028,00	0,59
3,5000 % Telenet Finance Luxembourg MC 2017/2028	BE6300371273		EUR	900	300	900	% 103,8280	934.452,00	1,29
3,5000 % Enel Multi Reset Notes (subordinated) 2019/2080	XS2000719992		EUR	1.000	0	0	% 109,4740	1.094.740,00	1,51
3,5500 % AQUE 2019-4X D 2019/2032	XS2004875329		EUR	1.000	0	0	% 100,3435	1.003.434,63	1,38
3,6250 % Phoenix PIB Dutch Finance MTN 2014/2021	XS1091770161		EUR	81	0	0	% 101,8550	82.502,55	0,11
3,6250 % Telecom Italia MTN 2016/2024	XS1347748607		EUR	600	0	0	% 107,3700	644.220,00	0,89
3,6250 % PVH MC 2016/2024	XS1435229460		EUR	200	200	0	% 109,5340	219.068,00	0,30
3,6250 % UPCB Finance VII MC 2017/2029	XS1634252628		EUR	500	0	0	% 103,9770	519.885,00	0,72
3,6250 % LKQ European Holdings MC 2018/2026	XS1799640666		EUR	800	0	0	% 102,3960	819.168,00	1,13
3,6250 % Darling Global Finance MC 2018/2026	XS1813579593		EUR	1.500	400	0	% 102,5850	1.538.775,00	2,12
3,6250 % BP Capital Markets PERP fix-to-float (sub.) 2020/2099	XS2193662728		EUR	500	100	0	% 109,5160	547.580,00	0,75
3,7500 % Goodyear Europe MC 2015/2023	XS1333193875		EUR	300	0	400	% 100,5150	301.545,00	0,42
3,7500 % Fiat Chrysler Automobiles 2016/2024	XS1388625425		EUR	600	0	0	% 109,9880	659.928,00	0,91
3,7500 % Repsol Int. Finance PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2185997884		EUR	300	0	0	% 107,5960	322.788,00	0,44
3,7500 % Faurecia MC 2020/2028	XS2209344543		EUR	300	300	0	% 105,2510	315.753,00	0,44
3,8000 % OZLME 6X D 2019/2032	XS1992148616		EUR	1.000	0	0	% 100,4875	1.004.874,61	1,39
3,8750 % Belden MC (subordinated) 2018/2028	XS1789515134		EUR	700	0	0	% 104,5540	731.878,00	1,01
3,8750 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2018/2099	XS1795406658		EUR	600	500	0	% 108,0530	648.318,00	0,89
3,8750 % Fiat Chrysler Automobiles MC 2020/2026	XS2178833773		EUR	500	500	0	% 113,8510	569.255,00	0,78
4,0000 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2018/2099	FR0013367612		EUR	300	0	0	% 108,3640	325.092,00	0,45
4,0000 % UPCB Finance IV MC 2015/2027	XS1117297603		EUR	300	0	0	% 91,8900	275.670,00	0,38
4,0000 % Sappi Papier Holding MC 2016/2023	XS1383922876		EUR	200	0	0	% 100,2060	200.412,00	0,28
4,0000 % SoftBank Group MC 2017/2029	XS1684385591		EUR	200	0	0	% 106,4770	212.954,00	0,29
4,0000 % SoftBank Group MC 2018/2023	XS1811213781		EUR	600	400	300	% 104,5530	627.318,00	0,86
4,1000 % BLACK 2019-1X D 2019/2032	XS2010633613		EUR	500	0	0	% 100,7588	503.793,93	0,69
4,2500 % Solvay PERP fix-to-float (sub.) 2018/2099	BE6309987400		EUR	600	0	0	% 108,4270	650.562,00	0,90
4,2500 % Ziggo Secured Finance MC 2016/2027	XS1493836461		EUR	800	300	0	% 83,8336	670.668,80	0,92
4,3750 % Ball 2015/2023	XS1330978567		EUR	400	0	400	% 110,3760	441.504,00	0,61
4,5000 % Credit Agricole Assurances fix-to-float (subord.) 2014/2099	FR0012222297		EUR	200	0	0	% 114,5890	229.178,00	0,32
4,5000 % Repsol Int. Finance Multi Reset Notes (sub.) 2015/2075	XS1207058733		EUR	300	0	0	% 110,0440	330.132,00	0,46
4,5000 % Sealed Air MC 2015/2023	XS1247796185		EUR	600	600	0	% 109,1220	654.732,00	0,90
4,5000 % Fiat Chrysler Automobiles MC 2020/2028	XS2199351375		EUR	500	500	0	% 122,4490	612.245,00	0,84
4,6250 % SES PERP Multi Reset Notes (sub.) 2016/2099	XS1405777746		EUR	300	0	0	% 102,9200	308.760,00	0,43

## &gt;&gt; Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,7500 % BHP Billiton Finance Multi Reset Notes (sub.) 2015/2076	XS1309436753		EUR	250	0	0	% 101,4050	253.512,50	0,35
5,5000 % Assicurazioni Generali MC fix-to-float (sub.) 2015/2047	XS1311440082		EUR	200	0	0	% 123,3130	246.626,00	0,34
5,6250 % SES PERP Multi Reset Notes (sub.) 2016/2099	XS1405765659		EUR	300	0	0	% 110,2920	330.876,00	0,46
5,8750 % Salini Impregilo MC 2020/2025	XS2271356201		EUR	1.000	1.000	0	% 102,7350	1.027.350,00	1,42
6,2500 % ORSTED Multi Reset Notes (subord.) 2013/2099	XS0943370543		EUR	300	0	0	% 113,5700	340.710,00	0,47
6,3750 % America Movil Multi Reset Notes (subord.) 2013/2073	XS0969341147		EUR	500	0	0	% 115,0400	575.200,00	0,79
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>8.072.772,70</b>	<b>11,13</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
1,5000 % Smurfit Kappa Acquisitions MC 2019/2027	XS2050968333		EUR	1.000	0	0	% 104,8500	1.048.500,00	1,45
1,6000 % Deutsche Bahn Finance PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	XS2100039548		EUR	300	300	0	% 104,9260	314.778,00	0,43
1,7500 % Exor MC 2019/2034	XS2058888616		EUR	500	300	0	% 104,3500	521.750,00	0,72
1,8750 % ADLER Real Estate MC 2018/2023	XS1713464441		EUR	200	0	0	% 100,6610	201.322,00	0,28
2,1250 % Ardagh Packaging Fin/MP Holdings USA REGS MC 2020/2026	XS2189356996		EUR	610	310	300	% 100,5270	613.214,70	0,85
2,2500 % Grifols MC 2019/2027	XS2077646391		EUR	400	0	500	% 101,6310	406.524,00	0,56
2,5000 % Solvay PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	BE6324000858		EUR	400	400	0	% 103,0340	412.136,00	0,57
2,8750 % Equinix MC 2017/2026	XS1734328799		EUR	700	0	0	% 50,8465	355.925,50	0,49
2,8750 % OI European Group MC 2019/2025	XS2077666316		EUR	700	0	0	% 101,8000	712.600,00	0,98
2,8750 % Quintiles IMS Health S.REGS MC 2020/2028	XS2189947505		EUR	1.400	900	0	% 103,5130	1.449.182,00	2,00
3,0000 % Netflix S.REGS MC 2020/2025	XS2166217278		EUR	150	0	0	% 107,3550	161.032,50	0,22
3,6250 % Netflix MC 2019/2030	XS2072829794		EUR	300	0	0	% 114,0500	342.150,00	0,47
3,8750 % Netflix 2019/2029	XS1989380172		EUR	800	0	0	% 115,8810	927.048,00	1,28
4,6250 % Netflix 2018/2029	XS2076099865		EUR	500	0	0	% 121,3220	606.610,00	0,84
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>71.573.456,61</b>	<b>98,67<sup>2)</sup></b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>							<b>EUR</b>		
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>8.700,00</b>	<b>0,01</b>
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
Euro-Bund Future März 2021		EUREX	EUR	-3.000				8.700,00	0,01
<b>Swaps</b>							<b>EUR</b>	<b>-64.140,19</b>	<b>-0,09</b>
<b>Forderungen/ Verbindlichkeiten</b>									
<b>Credit Default Swaps</b>									
<b>Protection Seller</b>									
Berkshire Hathaway MC / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.12.22		OTC	EUR	-500				8.623,73	0,01
iTraxx Europe Crossover Index S.34 -5 Jahre- / 500 BP (BOASEC) 23.10.20-20.12.25		OTC	EUR	-4.000				481.945,04	0,66
Renault MTN / 100 BP (BNP) 1.12.17-20.6.23		OTC	EUR	-500				-1.830,01	-0,00
<b>Protection Buyer</b>									
iTraxx Europe Index S.34 -5 Jahre- / 100 BP (BOASEC) 23.10.20-20.12.25		OTC	EUR	20.000				-520.900,52	-0,72
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.22		OTC	EUR	500				-31.978,43	-0,04

## &gt;&gt; Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2020	Käufe/ Zugänge/ im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							EUR	191.401,47	0,26
<b>Bankguthaben</b>							EUR	191.401,47	0,26
<b>EUR - Guthaben bei</b>									
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG (Frankfurt Branch)				EUR 191.401,47			EUR	191.401,47	0,26
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	960.744,24	1,32
Zinsansprüche				EUR				822.692,50	1,13
Einschüsse (Initial Margins)				EUR				82.218,40	0,11
Cash Collateral				EUR				50.000,00	0,07
Ansprüche aus Credit Default Swaps				EUR				5.833,34	0,01
<b>Summe der Vermögenswerte</b>							EUR	72.670.162,13	100,18
<b>Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup></b>							EUR	-128.639,02	-0,18
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	72.541.523,11	100,00 <sup>3)</sup>
<b>Anteilwert Klasse P (a)</b>							EUR	107,25	
<b>Anteilwert Klasse I (a)</b>							EUR	109,71	
<b>Umlaufende Anteile Klasse P (a)</b>							STK	158.112	
<b>Umlaufende Anteile Klasse I (a)</b>							STK	506.648	
<b>Fondsvermögen Anteilklasse P (a)</b>							EUR	16.956.974,90	
<b>Fondsvermögen Anteilklasse I (a)</b>							EUR	55.584.548,21	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									98,67
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									-0,08

<sup>1)</sup> Noch nicht abgeführte Taxe d'Abonnement, Verwaltungsvergütung, Verbindlichkeiten aus Credit Default Swaps, Verwahrstellenvergütung und Prüfungsgebühren

<sup>2)</sup> Die Wertpapiere des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

<sup>3)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Verpflichtungen aus den Derivaten	Whg. in 1.000
Euro-Bund Future März 2021	EUR 5.331
Berkshire Hathaway MC / 100 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.12.22	EUR 525
iTraxx Europe Crossover Index 5.34 -5 Jahre- / 500 BP (BOASEC) 23.10.20-20.12.25	EUR 4.000
Renault MTN / 100 BP (BNP) 1.12.17-20.6.23	EUR 503
iTraxx Europe Index 5.34 -5 Jahre- / 100 BP (BOASEC) 23.10.20-20.12.25	EUR 20.000
Ziggo Bond Finance MC / 500 BP (BACRSEC) 23.7.19-20.6.22	EUR 500



## Während des Berichtszeitraumes 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
0,2500 % Bundesobligation S.172 2015/2020	DE0001141729	EUR	0	200
0,3750 % Medtronic Global Holdings MC 2020/2028	XS2238789460	EUR	800	800
0,5000 % FCA Bank MTN MC 2019/2024	XS2051914963	EUR	0	500
0,7500 % Medtronic Global Holdings MC 2020/2032	XS2238792175	EUR	300	300
0,8750 % SES MTN MC 2019/2027	XS2075811781	EUR	0	500
1,0000 % Cellnex Telecom MC 2020/2027	XS2102934697	EUR	0	500
1,0000 % Elis MTN MC 2019/2025	FR0013449972	EUR	0	300
1,0000 % Fresenius Medical Care MTN MC 2020/2026	XS2178769076	EUR	0	200
1,2500 % BAT Int. Finance MTN MC 2015/2027	XS1203859928	EUR	0	300
1,2500 % ZF Europe Finance MC 2019/2023	XS2010040124	EUR	0	100
1,3750 % Covestro MC 2020/2030	XS2188805845	EUR	0	200
1,3750 % Medtronic Global Holdings MC 2020/2040	XS2238792332	EUR	400	400
1,5000 % Ball MC 2019/2027	XS2080318053	EUR	300	300
1,6000 % AT&T MC 2020/2028	XS2180007549	EUR	0	300
1,6250 % Mondi Finance MTN MC 2018/2026	XS1813593313	EUR	0	400
1,6940 % General Motors Financial MTN MC 2018/2025	XS1792505866	EUR	0	200
1,7500 % ThyssenKrupp MTN MC 2015/2020	DE000A14J579	EUR	0	400
1,8750 % ThyssenKrupp MTN MC 2019/2023	DE000A2YN6V1	EUR	0	200
2,0000 % Kraft Heinz Foods MC 2015/2023	XS1253558388	EUR	0	400
2,0000 % Nokia MTN MC 2019/2026	XS1960685383	EUR	0	300
2,2000 % General Motors Financial MTN MC 2019/2024	XS1939356645	EUR	0	200
2,2500 % Kraft Heinz Foods MC 2016/2028	XS1405784015	EUR	0	300
2,3750 % Mondi Finance Europe GmbH MTN MC 2020/2028	XS2151059206	EUR	0	200
2,5000 % Gazprom (via Gaz Capital) MTN LPN 2018/2026	XS1795409082	EUR	0	200
2,6250 % Eni S.NC5. PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2242929532	EUR	200	200
2,6250 % Faurecia S.JUL MC 2020/2025	XS2209343495	EUR	200	200
2,7500 % RWE Multi Reset Notes (subord.) 2015/2020	XS1219498141	EUR	0	800
2,7500 % ThyssenKrupp MTN -single callable- 2016/2020	DE000A2AAPF1	EUR	0	200
2,8750 % Crown European Holdings MC 2018/2026	XS1758723883	EUR	0	300
2,8750 % Groupe Auchan MTN MC 2020/2026	FR0013510179	EUR	100	600
3,0000 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2019/2099	FR0013464922	EUR	0	200
3,2500 % IQVIA MC 2017/2025	XS1533922776	EUR	0	900
3,2500 % Schaeffler Finance MC 2015/2020	XS1212470972	EUR	0	500
3,3750 % Syngenta Finance MTN S.OCT MC 2020/2026	XS2242913882	EUR	1.200	1.200
4,1250 % Gas Natural Fenosa Fin PERP Multi Reset Nts.(sub.) 2014/2099	XS1139494493	EUR	0	500
4,2470 % Repsol Int. Finance PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2186001314	EUR	0	300
4,4960 % Energias de Portugal Multi Reset Notes (sub.) 2019/2079	PTEDPKOM0034	EUR	0	600

## &gt;&gt; Fortsetzung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
4,7500 % Arkema PERP Multi Reset Notes (subordinated) 2014/2020	FR0012278539	EUR	0	100
5,1180 % Solvay Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2015/2099	XS1323897485	EUR	0	700
5,6250 % BHP Billiton Finance Multi Reset Notes (sub.) 2015/2079	XS1309436910	EUR	0	800
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
0,7500 % Crown European Holdings 2019/2023	XS2071622216	EUR	400	400
1,5000 % ADLER Real Estate MC 2019/2022	XS1843441491	EUR	0	500
1,6250 % Grifols MC 2019/2025	XS2076836555	EUR	0	700
2,0000 % Dufry One MC 2019/2027	XS2079388828	EUR	0	500
2,5000 % Dufry One MC 2017/2024	XS1699848914	EUR	0	200
2,7500 % ADO Properties MC 2020/2026	XS2248826294	EUR	500	500
2,8750 % Equinix MC 2017/2025	XS1679781424	EUR	0	600
3,6250 % Netflix 2017/2027	XS1821883102	EUR	0	100

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Volumen in 1.000
<b>Derivate</b>		
<b>(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>		
<b>Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>		
<b>Credit Default Swaps</b>		
<b>Protection Seller</b>	EUR	4.000
(Basiswert(e): iTraxx Europe Crossover Index S.33 -5 Jahre- / 500 BP (CSSS) 18.8.20-20.6.25)		
<b>Protection Buyer</b>	EUR	20.000
(Basiswert(e): iTraxx Europe Index S.33 -5 Jahre- / 100 BP (CSSS) 18.8.20-20.6.25)		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
<b>Verkaufte Kontrakte</b>	EUR	8.794
(Basiswert(e): BUND)		

### 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 31.12.2020 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 91,04 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 8,96 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

### Marktschlüssel

#### a) Terminbörsen

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

b) OTC	Over-the-Counter
--------	------------------

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In- und ausländische verzinsliche Wertpapiere	per 29.12.2020
Alle anderen Vermögenswerte	per 29.12.2020

# 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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)

Amtsgericht Köln: HRB 3495  
USt-Id-Nr. DE 115658034

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 31.12.2020)  
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. Jan Wicke, stellv. Vorsitzender (ab dem 01.09.2020)  
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Dr. Immo Querner, stellv. Vorsitzender (bis zum 31.08.2020)  
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

## 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](http://www.ampega.com)) informiert.**

# Angaben zum Sondervermögen

## Portfoliomanager

Ampega Investment GmbH  
Charles-de-Gaulle-Platz 1  
50679 Köln  
Deutschland

## Abschlussprüfer

PwC Société Coopérative  
2, Rue Gerhard Mercator  
L-1014 Luxembourg  
Luxemburg

## Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA  
Kaiserstr. 24  
60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

## Aufsichtsbehörde

Commission de Surveillance du Secteur Financier  
110, route d'Arlon  
1150 Luxembourg  
Luxemburg

## Verwahrstellen-Dienstleister

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA  
Niederlassung Luxemburg  
1C, rue Gabriel Lippmann  
5365 Munsbach  
Luxemburg

## Zahl- und Vertriebsstelle Großherzogtum Luxemburg

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA  
Niederlassung Luxemburg  
1C, rue Gabriel Lippmann  
5365 Munsbach  
Luxemburg

## Angaben für Anleger aus Deutschland

### Zahl- und Informationsstelle Bundesrepublik Deutschland

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA  
Kaiserstr. 24  
60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

### Vertriebsstelle

Ampega Investment GmbH  
Charles-de-Gaulle-Platz 1  
50679 Köln  
Deutschland

## Angaben 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](http://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 § 126 InvG im Verkaufsprospekt (Widerrufsrechte bei „Haustürgeschäften“) gilt, dass für österreichische Anleger § 3 KSchG anzuwenden ist.

Überreicht durch:



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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)