ampega.
Talanx Investment Group

Halbjahresbericht

Kapital Total Return AMI

1. November 2020 bis 30. April 2021

Alternativer Investmentsfonds

Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.04.2021

	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Vermögensgegenstände		
Investmentanteile	**1.070.153,87**	**95,18**
Aktienfonds	460.557,06	40,96
Rentenfonds	608.878,97	54,16
Alternative Investments [1)]	717,84	0,06
Derivate	**-950,00**	**-0,08**
Zins-Derivate	-950,00	-0,08
Bankguthaben	**62.684,59**	**5,58**
Sonstige Vermögensgegenstände	**5.716,07**	**0,51**
Verbindlichkeiten	**-13.304,74**	**-1,18**
Fondsvermögen	**1.124.299,79**	**100,00 [2)]**

[1)] *Z. B. Rohstoff-Fonds, Private-Equity-Fonds etc.*

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

Vermögensaufstellung zum 30.04.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Investmentanteile							**EUR**		**1.070.153,87**	**95,18**
Gruppenfremde Investmentanteile							**EUR**		**1.070.153,87**	**95,18**
Deutsche Invest I Croci Sectors Plus FCH (P)	LU1701862812		ANT	0	0	0	EUR	150,0300	49,96	0,00
FISCH - Bond Global High Yield Fund	LU1816295767		ANT	935	1.985	1.350	EUR	100,7900	94.238,65	8,38
Flossbach von Storch - Bond Opportunities R	LU0399027613		ANT	1.190	2.600	2.160	EUR	141,6300	168.539,70	14,99
Lyxor UCITS ETF S&P 500 Daily Hedged D-EUR	LU0959211243		ANT	625	0	1.550	EUR	226,4500	141.531,25	12,59
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	LU0733665771		ANT	11.910	9.500	43.340	EUR	13,8200	164.596,20	14,64
Ve-RI Listed Infrastructure-I	DE000A0MKQN1		ANT	135	0	150	EUR	1.376,7100	185.855,85	16,53
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	IE00B53L3W79		ANT	1.000	1.700	700	EUR	133,1200	133.120,00	11,84
iShares JPMorgan USD Emerg. Markets Bond UCITS ETF	IE00B2NPKV68		ANT	2.000	6.625	6.325	USD	109,9100	181.504,42	16,14
Allianz Volatility Strategy-I	LU1586358795		ANT	1	670	730	EUR	1.011,0400	717,84	0,06
Summe Wertpapiervermögen									**1.070.153,87**	**95,18**
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							**EUR**		**-950,00**	**-0,08**
Zins-Derivate							**EUR**		**-950,00**	**-0,08**
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte							**EUR**		**-950,00**	**-0,08**
Euro-Bobl Future Juni 2021		EUREX	STK	2					-950,00	-0,08
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							**EUR**		**62.684,59**	**5,58**
Bankguthaben							**EUR**		**62.684,59**	**5,58**
EUR - Guthaben bei							**EUR**		**40.152,99**	**3,57**
Verwahrstelle			EUR	39.617,63					39.617,63	3,52
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	535,36					535,36	0,05

Vermögensaufstellung zum 30.04.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2021	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds-vermögens
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							**EUR**		**22.531,60**	**2,00**
Verwahrstelle			USD	27.288,02					22.531,60	2,00
Sonstige Vermögensgegenstände							**EUR**		**5.716,07**	**0,51**
Forderungen aus Zielfondsausschüttungen			EUR						5.716,07	0,51
Sonstige Verbindlichkeiten [1]							**EUR**		**-13.304,74**	**-1,18**
Fondsvermögen							**EUR**		**1.124.299,79**	**100,00** [2]
Anteilwert							**EUR**		**94,36**	
Umlaufende Anteile							**STK**		**11.914,831**	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)										**95,18**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)										**-0,08**

[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. April 2021 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 29.04.2021

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,21110	= 1 (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen	
EUREX	European Exchange Deutschland

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 29.04.2021 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
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
Black Rock- European Opportunities Extension Fund	LU0418791066	ANT	0	1.200
DWS Concept Dividend Equity Risk Control	LU1865033333	ANT	0	1.700
Marshall Wace - MW Liquid Alpha Fund B	IE00BYW7BD64	ANT	440	440
Ossiam Shiller Barclays Cape US Sector Value TR	LU1079841273	ANT	0	200
Geldmarktfonds				
Gruppenfremde Geldmarktfonds				
Amundi Cash Corporate-IC-C	FR0010251660	ANT	3	4

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)				
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte	**EUR**			**329**
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)				
Verkaufte Kontrakte	**EUR**			**1.790**
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50, Standard & Poor's 500)				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte	**EUR**			**811**
(Basiswert(e): BOBL)				

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Abs. 1 Nr. 3d KARBV

Verwaltungsvergütung der im Kapital Total Return AMI enthaltenen Investmentanteile:	% p.a.
Allianz Volatility Strategy-I	0,69000
Amundi Cash Corporate-IC-C	0,50000
Black Rock- European Opportunities Extension Fund	1,30000
DWS Concept Dividend Equity Risk Control	1,00000
Deutsche Invest I Croci Sectors Plus FCH (P)	k.A.
FISCH - Bond Global High Yield Fund	0,60000
Flossbach von Storch - Bond Opportunities R	0,93000
Lyxor UCITS ETF S&P 500 Daily Hedged D-EUR	k.A.
Marshall Wace - MW Liquid Alpha Fund B	k.A.
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	0,30000
Ossiam Shiller Barclays Cape US Sector Value TR	k.A.
Ve-RI Listed Infrastructure-I	1,05000
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	k.A.
iShares JPMorgan USD Emerg. Markets Bond UCITS ETF	k.A.

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im Juni 2021

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 30.04.2021)
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
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

Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers 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 Service AG (Rechnungswesen) und die HDI Systeme AG (IT-Dienstleistungen).

Auslagerung Portfoliomanagement

Veritas Institutional GmbH
Messberg 4
20095 Hamburg
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