

Halbjahresbericht

Tresides Balanced Return AMI

1. Juli 2022 bis 31. Dezember 2022

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 31.12.2022

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	53.111.908,14	27,10
Deutschland	20.972.259,00	10,70
Dänemark	2.361.079,61	1,20
Finnland	2.990.870,00	1,53
Frankreich	7.941.975,00	4,05
Großbritannien	3.365.993,55	1,72
Irland	1.110.300,00	0,57
Italien	2.211.200,00	1,13
Niederlande	2.732.692,00	1,39
Norwegen	958.135,12	0,49
Schweden	1.958.910,19	1,00
Schweiz	5.786.093,67	2,95
Spanien	722.400,00	0,37
Verzinsliche Wertpapiere	135.982.293,50	69,39
Belgien	1.413.735,00	0,72
Chile	1.287.735,00	0,66
Deutschland	28.509.514,00	14,55
Europäische Institutionen	149.803,50	0,08
Finnland	4.349.295,00	2,22
Frankreich	18.394.835,00	9,39
Großbritannien	8.351.519,00	4,26
Irland	1.423.616,00	0,73
Italien	13.131.228,50	6,70
Japan	1.391.325,00	0,71
Luxemburg	2.871.930,00	1,47
Niederlande	21.310.695,00	10,87
Schweden	5.604.485,00	2,86
Schweiz	1.426.875,00	0,73
Spanien	1.539.112,50	0,79
Tschechische Republik	1.991.500,00	1,02
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	12.673.050,00	6,47
Österreich	10.162.040,00	5,19
Derivate	128.885,00	0,07
Aktienindex-Derivate	90.050,00	0,05
Zins-Derivate	38.835,00	0,02
Bankguthaben	4.664.786,23	2,38
Sonstige Vermögensgegenstände	2.227.980,16	1,14
Verbindlichkeiten	-144.245,11	-0,07
Fondsvermögen	195.971.607,92	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Verkäufe /		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
					Zugänge	Abgänge				
Vermögensgegenstände										
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	175.521.011,64	89,56
Aktien								EUR	53.111.908,14	27,10
Deutschland								EUR	20.972.259,00	10,70
Bechtle AG	DE0005158703		STK	28.000	5.000	15.000	EUR	33,0600	925.680,00	0,47
Beiersdorf AG	DE0005200000		STK	5.500	0	5.500	EUR	107,2000	589.600,00	0,30
Brenntag AG	DE000A1DAHH0		STK	21.500	20.550	17.050	EUR	59,7200	1.283.980,00	0,66
Daimler Truck Holding AG	DE000DTR0CK8		STK	35.000	35.000	0	EUR	28,9450	1.013.075,00	0,52

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Deutsche Post AG	DE0005552004		STK	22.800	800	22.000	EUR	35,1800	802.104,00	0,41
Deutsche Telekom AG	DE0005557508		STK	72.000	2.000	85.000	EUR	18,6380	1.341.936,00	0,68
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	75.000	0	35.000	EUR	9,3340	700.050,00	0,36
Gerresheimer AG	DE000A0LD6E6		STK	15.000	15.000	0	EUR	62,8000	942.000,00	0,48
Hugo Boss AG	DE000A1PHFF7		STK	20.000	11.000	16.000	EUR	54,1600	1.083.200,00	0,55
Infineon Technologies AG	DE0006231004		STK	45.000	10.000	25.000	EUR	28,4300	1.279.350,00	0,65
Jenoptik AG	DE000A2NB601		STK	38.000	0	17.000	EUR	25,5600	971.280,00	0,50
Jungheinrich AG VZ	DE0006219934		STK	45.000	70.000	25.000	EUR	26,5800	1.196.100,00	0,61
Lanxess AG	DE0005470405		STK	19.000	0	11.000	EUR	37,7000	716.300,00	0,37
Mercedes-Benz Gruppe AG	DE0007100000		STK	5.000	25.000	20.000	EUR	61,4000	307.000,00	0,16
Merck KGaA	DE0006599905		STK	7.000	7.000	0	EUR	180,9000	1.266.300,00	0,65
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026		STK	2.500	0	4.500	EUR	304,0000	760.000,00	0,39
Puma SE	DE0006969603		STK	10.000	10.000	0	EUR	56,7000	567.000,00	0,29
RWE AG St.	DE0007037129		STK	33.000	0	17.000	EUR	41,5900	1.372.470,00	0,70
SAP SE	DE0007164600		STK	13.000	0	9.000	EUR	96,3900	1.253.070,00	0,64
Secunet Security Networks AG	DE0007276503		STK	3.500	4.500	1.000	EUR	196,4000	687.400,00	0,35
Siemens AG	DE0007236101		STK	8.750	250	9.500	EUR	129,6400	1.134.350,00	0,58
Volkswagen AG Vz.	DE0007664039		STK	6.700	6.700	0	EUR	116,4200	780.014,00	0,40
Dänemark							EUR		2.361.079,61	1,20
Carlsberg A/S	DK0010181759		STK	8.000	8.000	6.000	DKK	923,2000	993.159,26	0,51
DSV Panalpina A/S	DK0006079531		STK	5.000	0	3.000	DKK	1.096,5000	737.244,86	0,38
Novo Nordisk A/S	DK00060534915		STK	5.000	5.000	0	DKK	938,0000	630.675,49	0,32
Finland							EUR		2.990.870,00	1,53
Neste Oyj	FI0009013296		STK	23.000	0	17.000	EUR	43,0200	989.460,00	0,50
Nokia Corp.	FI0009000681		STK	180.000	30.000	100.000	EUR	4,3270	778.860,00	0,40
UPM-Kymmene Corp.	FI0009005987		STK	35.000	16.000	25.000	EUR	34,9300	1.222.550,00	0,62
Frankreich							EUR		7.941.975,00	4,05
Air Liquide SA	FR0000120073		STK	8.800	300	5.800	EUR	132,4000	1.165.120,00	0,59
BNP Paribas SA	FR0000131104		STK	26.000	8.000	22.000	EUR	53,2500	1.384.500,00	0,71
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014		STK	1.300	0	1.500	EUR	679,9000	883.870,00	0,45
Safran SA	FR0000073272		STK	9.000	0	6.000	EUR	116,9200	1.052.280,00	0,54
Sanofi SA	FR0000120578		STK	6.000	0	14.000	EUR	89,8400	539.040,00	0,28
Veolia Environnement SA	FR0000124141		STK	36.000	0	34.000	EUR	24,0000	864.000,00	0,44
Verallia SA	FR0013447729		STK	28.000	10.000	32.000	EUR	31,6800	887.040,00	0,45
Vinci SA	FR0000125486		STK	12.500	0	9.500	EUR	93,2900	1.166.125,00	0,60
Großbritannien							EUR		3.365.993,55	1,72
CNH Industrial NV	NL0010545661		STK	45.000	0	55.000	EUR	14,9650	673.425,00	0,34
Diageo PLC	GB0002374006		STK	20.000	0	20.000	GBP	36,5000	823.053,62	0,42
Relx PLC	GB00B2B0D97		STK	35.000	55.000	20.000	EUR	25,8400	904.400,00	0,46
SSE PLC	GB0007908733		STK	50.000	10.000	25.000	GBP	17,1200	965.114,93	0,49
Irland							EUR		1.110.300,00	0,57
CRH PLC	IE0001827041		STK	30.000	0	30.000	EUR	37,0100	1.110.300,00	0,57
Italien							EUR		2.211.200,00	1,13
Intesa Sanpaolo SpA	IT0000072618		STK	400.000	850.000	450.000	EUR	2,0780	831.200,00	0,42
Terna SpA	IT0003242622		STK	200.000	160.000	60.000	EUR	6,9000	1.380.000,00	0,70
Niederlande							EUR		2.732.692,00	1,39
ASML Holding NV	NL0010273215		STK	1.540	40	1.200	EUR	503,8000	775.852,00	0,40
Koninklijke DSM NV	NL0000009827		STK	6.000	0	4.000	EUR	114,3000	685.800,00	0,35
Shell Eo-07	GB00BP6MXD84		STK	48.000	0	53.000	EUR	26,4800	1.271.040,00	0,65
Norwegen							EUR		958.135,12	0,49
Telenor ASA	NO0010063308		STK	110.000	175.000	65.000	NOK	91,6000	958.135,12	0,49
Schweden							EUR		1.958.910,19	1,00
Sandvik AB	SE0000667891		STK	50.000	20.000	40.000	SEK	188,4000	847.082,69	0,43
Svenska Handelsbanken AB	SE0007100599		STK	70.000	160.000	90.000	SEK	105,1000	661.569,78	0,34

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Thule Group AB	SE0006422390		STK	23.000	20.000	32.000	SEK	217,7000	450.257,72	0,23
Schweiz							EUR	5.786.093,67	2,95	
Compagnie Financière Richemont SA	CH0210483332		STK	11.000	0	7.000	CHF	119,9000	1.336.072,54	0,68
Lonza Group AG	CH0013841017		STK	1.700	600	1.400	CHF	453,1000	780.299,19	0,40
SIG Combibloc Group AG	CH0435377954		STK	53.000	0	37.000	CHF	20,2000	1.084.539,59	0,55
Swiss Life Holding AG	CH0014852781		STK	1.100	0	750	CHF	476,8000	531.308,91	0,27
UBS Group AG	CH0244767585		STK	60.000	25.000	65.000	CHF	17,2050	1.045.740,91	0,53
Zurich Insurance Group AG	CH0011075394		STK	2.250	0	2.050	CHF	442,3000	1.008.132,53	0,51
Spanien							EUR	722.400,00	0,37	
Viscofan SA	ES0184262212		STK	12.000	0	18.000	EUR	60,2000	722.400,00	0,37
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	122.409.103,50	62,46	
0,0000 % Austria 2019/2024	AT0000A28KX7		EUR	2.000	0	8.000	%	95,8720	1.917.440,00	0,98
0,0000 % Austria 2021/2031	AT0000A2NWX3		EUR	3.000	0	7.000	%	77,9300	2.337.900,00	1,19
0,0000 % France (Government of) 2022/2032	FR0014007L00		EUR	3.000	0	7.000	%	75,3380	2.260.140,00	1,15
0,1000 % Chile (Republic of) MC 2021/2027	XS2369244087		EUR	1.500	0	1.500	%	85,8490	1.287.735,00	0,66
0,2500 % EnBW Int. Fin. MC 2020/2030	XS2242728041		EUR	1.500	3.000	1.500	%	74,4870	1.117.305,00	0,57
0,3750 % Tesco Corporate Treasury Services MTN MC 2021/2029	XS2289877941		EUR	1.500	0	1.500	%	77,3650	1.160.475,00	0,59
0,5000 % Volkswagen Leasing MTN 2021/2029	XS2282095970		EUR	1.500	0	1.500	%	77,7570	1.166.355,00	0,60
0,6250 % Grenke Finance MTN 2019/2025	XS2078696866		EUR	100	100	0	%	87,7760	87.776,00	0,04
0,6250 % Grenke Finance MTN S.DEC 2022/2025	XS2560495207		EUR	1.500	1.500	0	%	89,0560	1.335.840,00	0,68
0,7500 % Cellnex Finance MC 2021/2026	XS2300292617		EUR	1.500	0	1.500	%	85,7030	1.285.545,00	0,66
0,8000 % AGCO MTN MC 2021/2028	XS2393323071		EUR	1.500	0	1.500	%	81,8620	1.227.930,00	0,63
0,8350 % Exxon Mobil MC 2020/2032	XS2196322403		EUR	1.000	0	2.000	%	74,9070	749.070,00	0,38
0,8750 % American Tower MC 2021/2029	XS2346207892		EUR	1.500	0	1.800	%	79,6200	1.194.300,00	0,61
0,8750 % Swedish Match MTN MC 2020/2027	XS2125123039		EUR	1.500	0	1.500	%	87,9120	1.318.680,00	0,67
1,0000 % ING Groep fix-to-float (sub.) 2019/2030	XS2079079799		EUR	1.500	0	1.500	%	88,1970	1.322.955,00	0,68
1,0000 % UniCredit MTN 2018/2023	XS1754213947		EUR	3.000	0	0	%	99,9580	2.998.740,00	1,53
1,1250 % Fresenius MTN MC 2020/2033	XS2237447961		EUR	1.500	0	1.500	%	67,5580	1.013.370,00	0,52
1,2500 % BAT Int. Finance MTN MC 2015/2027	XS1203859928		EUR	1.500	0	1.500	%	88,6660	1.329.990,00	0,68
1,2500 % Davide Campari-Milano MC 2020/2027	XS2239553048		EUR	2.000	0	1.000	%	86,5650	1.731.300,00	0,88
1,2500 % Renault MTN MC 2019/2025	FR0013428414		EUR	3.000	0	0	%	89,8920	2.696.760,00	1,38
1,5000 % Bundesanleihe 2014/2024	DE0001102358		EUR	450	450	0	%	98,6460	443.907,00	0,23
1,5000 % KBC Groep MTN fix-to-float 2022/2026	BE0002846278		EUR	1.500	0	1.500	%	94,2490	1.413.735,00	0,72
1,5140 % Ford Motor Credit 2019/2023	XS2013574202		EUR	3.000	0	0	%	99,4940	2.984.820,00	1,52
1,6250 % KION Group MTN MC 2020/2025	XS2232027727		EUR	2.000	0	1.000	%	89,0030	1.780.060,00	0,91
1,7440 % Ford Motor Credit MTN 2020/2024	XS2116728895		EUR	1.500	0	1.500	%	95,6780	1.435.170,00	0,73
1,7500 % France (Government of) OAT 2012/2023	FR0011486067		EUR	150	150	0	%	99,7620	149.643,00	0,08
1,7500 % Sixt MTN MC 2020/2024	DE000A3H2UX0		EUR	2.000	0	1.000	%	96,7410	1.934.820,00	0,99
1,7500 % Voestalpine MTN 2019/2026	AT0000A27LQ1		EUR	3.000	0	0	%	93,4580	2.803.740,00	1,43

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
1,8750 % Air France- KLM MC 2020/2025	FR0013477254		EUR	1.300	0	0 %	90,7010	1.179.113,00	0,60
1,8750 % European Financial Stability Facility (EFSF) MTN 2013/2023	EU000A1G0BC0		EUR	150	150	0 %	99,8690	149.803,50	0,08
2,0000 % Nokia MTN MC 2019/2026	XS1960685383		EUR	1.500	0	1.500 %	94,0150	1.410.225,00	0,72
2,0000 % Smiths Group MTN MC 2017/2027	XS1570260460		EUR	1.500	0	1.500 %	93,6710	1.405.065,00	0,72
2,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2026	XS2010039381		EUR	2.000	0	1.000 %	86,4340	1.728.680,00	0,88
2,1250 % Credit Suisse London MTN 2022/2024	XS2480543102		EUR	1.500	0	1.500 %	95,1250	1.426.875,00	0,73
2,1250 % Fraport MC 2020/2027	XS2198879145		EUR	3.000	0	0 %	89,4050	2.682.150,00	1,37
2,1250 % SIG Com- bibloc PurchaseCo S.REGS 2020/2025	XS2189594315		EUR	1.500	0	1.500 %	96,4310	1.446.465,00	0,74
2,1250 % Volvo Car MC 2019/2024	XS1971935223		EUR	1.000	0	2.000 %	97,2920	972.920,00	0,50
2,2500 % Coloplast Finance MTN MC 2022/2027	XS2481287808		EUR	1.500	0	1.500 %	93,7950	1.406.925,00	0,72
2,2500 % Evonik Indust- ries MTN MC 2022/2027	XS2485162163		EUR	2.000	0	1.000 %	93,2260	1.864.520,00	0,95
2,2500 % Quadient MC 2020/2025	FR0013478849		EUR	2.000	0	1.000 %	92,5820	1.851.640,00	0,94
2,3750 % EQT MC 2022/2028	XS2463988795		EUR	1.500	0	1.500 %	87,8910	1.318.365,00	0,67
2,7500 % Schaeffler MTN MC 2020/2025	DE000A289Q91		EUR	1.500	0	1.500 %	95,4730	1.432.095,00	0,73
2,7500 % ZF North Ame- rica Capital 2015/2023	DE000A14J7G6		EUR	2.000	0	1.000 %	99,6850	1.993.700,00	1,02
2,8550 % Intesa SanPaolo MTN (subor- dinated) 2015/2025	XS1222597905		EUR	1.500	0	1.500 %	97,6090	1.464.135,00	0,75
2,8750 % AT&T S.B PERP fix- to-float (sub.) 2020/2199	XS2114413565		EUR	1.600	100	1.500 %	90,0100	1.440.160,00	0,73
2,8750 % Telefonica Europe PERP fix-to- float (sub.) 2019/2099	XS2056371334		EUR	1.500	0	1.500 %	83,9770	1.259.655,00	0,64
3,0000 % Universal Music Group MTN MC 2022/2027	XS2496288593		EUR	1.500	0	1.500 %	96,0070	1.440.105,00	0,73
3,0190 % HSBC Holdings fix-to-float 2022/2027	XS2486589596		EUR	1.500	0	1.500 %	95,2880	1.429.320,00	0,73
3,1000 % Vodafone Group fix-to-float (sub.) 2018/2079	XS1888179477		EUR	1.600	100	1.500 %	98,1140	1.569.824,00	0,80
3,1250 % Faurecia MC 2019/2026	XS1963830002		EUR	1.600	0	1.400 %	88,7840	1.420.544,00	0,72
3,2500 % K+S MC 2018/2024	XS1854830889		EUR	1.800	3.000	1.200 %	99,3540	1.788.372,00	0,91
3,2500 % Münchener Rückvers. fix-to-float (sub.) 2018/2049	XS1843448314		EUR	1.500	0	1.500 %	89,5440	1.343.160,00	0,69
3,3750 % Crown European Holdings MC 2015/2025	XS1227287221		EUR	1.500	0	1.500 %	98,7480	1.481.220,00	0,76
3,3750 % Imperial Brands Finance MTN MC 2014/2026	XS1040508241		EUR	1.500	0	1.500 %	97,1230	1.456.845,00	0,74
3,5000 % Volkswagen Int. Fin. S.. PERP fix-to- float (sub.) 2020/2199	XS2187689034		EUR	1.500	0	1.500 %	92,7450	1.391.175,00	0,71
3,7500 % ELM BV PERP fix- to-float (sub.) 2020/2199	XS2182055009		EUR	1.500	0	1.500 %	95,2360	1.428.540,00	0,73
3,8750 % Enel Finance Int. MTN MC 2022/2029	XS2531420656		EUR	1.500	3.000	1.500 %	98,8800	1.483.200,00	0,76
3,8750 % Fresenius Medical Care MTN -sin- gle callable- 2022/2027	XS2530444624		EUR	3.000	7.000	4.000 %	95,8300	2.874.900,00	1,47
4,0000 % Electricite de France PERP fix-to- float (sub.) 2018/2099	FR0013367612		EUR	3.000	0	0 %	94,0620	2.821.860,00	1,44

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
4,0000 % Telecom Italia MTN 2019/2024	XS1935256369		EUR	1.800	0	1.200 %	97,7000	1.758.600,00	0,90	
4,2500 % Huhtamaki MC 2022/2027	FI4000523550		EUR	3.000	0	0 %	97,9690	2.939.070,00	1,50	
4,4000 % Spain 2013/2023	ES00000123X3		EUR	250	250	0 %	101,4270	253.567,50	0,13	
4,5000 % Bayer S.N5.5 fix-to-float (sub.) 2022/2082	XS2451802768		EUR	1.500	0	1.500 %	91,4640	1.371.960,00	0,70	
4,5000 % Italy BTP 2013/2024	IT0004953417		EUR	150	150	0 %	101,5890	152.383,50	0,08	
4,5000 % Stellantis MC 2020/2028	XS2199351375		EUR	1.500	3.000	1.500 %	100,0040	1.500.060,00	0,77	
4,7500 % Intesa Sanpaolo MTN 2022/2027	XS2529233814		EUR	1.500	5.000	3.500 %	100,7030	1.510.545,00	0,77	
4,8500 % Volvo Treasury Multi Reset Notes (sub.) 2014/2078	XS1150695192		EUR	2.000	0	1.000 %	99,7260	1.994.520,00	1,02	
5,0000 % Assicurazioni Generali fix-to-float (subord.) 2016/2048	XS1428773763		EUR	2.000	0	1.000 %	99,6580	1.993.160,00	1,02	
5,1250 % AXA fix-to-float (subord.) 2013/2043	XS0878743623		EUR	3.000	0	0 %	100,6440	3.019.320,00	1,54	
5,2500 % Orange PERP Multi Reset Notes (subord.) 2014/2099	XS1028599287		EUR	1.500	0	1.500 %	100,9730	1.514.595,00	0,77	
5,2500 % Wuerthtemb. Lebensvers. fix-to-float (sub.) 2014/2044	XS1064049767		EUR	2.500	0	0 %	100,9770	2.524.425,00	1,29	
5,6250 % Ceske Drahny MC 2022/2027	XS2495084621		EUR	2.000	2.000	0 %	99,5750	1.991.500,00	1,02	
5,8500 % UniCredit MTN fix-to-float 2022/2027	XS2555420103		EUR	1.500	1.500	0 %	101,4910	1.522.365,00	0,78	
5,8750 % Telefonica Europe PERP Multi Reset Notes (sub.) 2014/2099	XS1050461034		EUR	3.000	0	0 %	99,5850	2.987.550,00	1,52	
6,2500 % OMV PERP Multi Reset Notes (subord.) 2015/2099	XS1294343337		EUR	3.000	0	0 %	103,4320	3.102.960,00	1,58	
7,7500 % Telecom Italia Fin. MTN 2003/2033	XS0161100515		EUR	1.350	50	1.200 %	105,5900	1.425.465,00	0,73	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	13.573.190,00	6,93	
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	13.573.190,00	6,93	
0,5000 % Brenntag Finance MTN MC 2021/2029	XS2394063437		EUR	1.500	3.000	1.500 %	75,6850	1.135.275,00	0,58	
0,8750 % Ball 2019/2024	XS2080317832		EUR	1.500	0	1.500 %	96,7120	1.450.680,00	0,74	
0,9000 % Harley-Davidson Financial Services MC 2019/2024	XS2075185228		EUR	1.500	0	1.500 %	95,0100	1.425.150,00	0,73	
2,1250 % Wüstenrot & Württemberg. fix-to-float (sub.) 2021/2041	XS2378468420		EUR	3.000	0	0 %	70,4830	2.114.490,00	1,08	
2,3750 % Mahle MTN MC 2021/2028	XS2341724172		EUR	3.000	0	0 %	72,4470	2.173.410,00	1,11	
2,3750 % Phoenix PIB Dutch Finance MC 2020/2025	XS2212959352		EUR	2.000	0	1.000 %	94,0670	1.881.340,00	0,96	
2,6520 % Nissan Motor S.REGS MC 2020/2026	XS2228683277		EUR	1.500	0	1.500 %	92,7550	1.391.325,00	0,71	
3,1250 % BayWa MTN MC 2019/2024	XS2002496409		EUR	2.000	0	1.000 %	100,0760	2.001.520,00	1,02	
Summe Wertpapiervermögen								189.094.201,64	96,49	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	128.885,00	0,07	
Aktienindex-Derivate							EUR	90.050,00	0,05	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte							EUR	90.050,00	0,05	
Optionsrechte auf Aktienindizes										
Option STOXX Europe 50 C3750 März 2023		EUREX	STK	-1.000			EUR	55,2000	-55.200,00	-0,03
Option STOXX Europe 50 Put 3400 März 2023		EUREX	STK	3.500			EUR	41,5000	145.250,00	0,07

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Zins-Derivate							EUR	38.835,00	0,02
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	38.835,00	0,02
Euro-BUXL Future März 2023	EUREX	STK		-7				196.960,00	0,10
Euro-Schatz Future März 2023	EUREX	STK		115				-158.125,00	-0,08
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	4.664.786,23	2,38
Bankguthaben							EUR	4.664.786,23	2,38
EUR - Guthaben bei							EUR	4.517.058,05	2,30
Verwahrstelle		EUR		4.517.058,05				4.517.058,05	2,30
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	140.968,19	0,07
Verwahrstelle		GBP		125.030,47				140.968,19	0,07
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	6.759,99	0,00
Verwahrstelle		CHF		6.673,10				6.759,99	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	2.227.980,16	1,14
Dividendenansprüche		EUR						108.546,70	0,06
Quellensteuerrück- stattungsansprüche		EUR						46.722,92	0,02
Zinsansprüche		EUR						2.072.710,54	1,06
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾							EUR	-144.245,11	-0,07
Fondsvermögen							EUR	195.971.607,92	100,00 ²⁾
Anteilwert Klasse B (a)							EUR	90,21	
Anteilwert Klasse A (a)							EUR	91,38	
Umlaufende Anteile Klasse B (a)							STK	7.068,168	
Umlaufende Anteile Klasse A (a)							STK	2.137.616,497	
Fondsvermögen Anteilklasse B (a)							EUR	637.603,92	
Fondsvermögen Anteilklasse A (a)							EUR	195.334.004,00	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									96,49
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,07

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 31. Dezember 2022 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 99,32 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0,68 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.12.2022

Schweiz, Franken	(CHF)	0,98715	= 1 (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,43647	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88694	= 1 (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	10,51626	= 1 (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,12052	= 1 (EUR)

Marktschlüssel**Terminbörsen**

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 30.12.2022 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				
Aktien				
Deutschland				
Dermapharm Holding SE	DE000A2G55D8	STK	0	10.000
Dr Ing hc F Porsche AG Vz.	DE000PAG9113	STK	9.000	9.000
Hannover Rück SE	DE0008402215	STK	250	250
Siltronic AG	DE000WAF3001	STK	6.000	6.000
Synlab AG	DE000A2TSL71	STK	0	13.539
Dänemark				
GN Store Nord A/S	DK0010272632	STK	0	40.000
Finnland				
Nordea Bank Holding ABP	FI4000297767	STK	0	1.900
Frankreich				
Credit Agricole SA	FR0000045072	STK	3.000	103.000
Essilor International SA	FR0000121667	STK	0	11.000
Euroapi Sas	FR0014008VX5	STK	0	869
M6 Metropole TV SA	FR0000053225	STK	2.500	2.500
Schneider Electric SE	FR0000121972	STK	0	7.000
Technip Energies NV	NL0014559478	STK	70.000	70.000
Total SA	FR0000120271	STK	1.200	41.200
Großbritannien				
Biffa PLC	GB00BD8DR117	STK	0	555.000
Italien				
Enel SpA	IT0003128367	STK	7.000	7.000
Eni SpA	IT0003132476	STK	140.000	140.000
Moncler SpA	IT0004965148	STK	0	40.000
Luxemburg				
Majorel Group Luxembourg SA	LU2382956378	STK	0	56.349
Schweden				
Alleima Ab	SE0017615644	STK	18.000	18.000
Holmen AB Class B	SE0011090018	STK	0	20.000
Svenska Cellulosa AB SCA	SE0000112724	STK	0	50.000
Schweiz				
Geberit AG	CH0030170408	STK	2.500	2.500
LafargeHolcim Ltd.	CH0012214059	STK	700	700
Nestle SA	CH0038863350	STK	0	5.000

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
Spanien				
Inditex SA	ES0148396007	STK	0	55.000
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Spain 2021/2027	ES0000012J15	EUR	0	5.000
0,6250 % Kerry Group Financial Services MC 2019/2029	XS2042667944	EUR	0	3.000
0,8000 % Thermo Fisher Scientific Finance I MC 2021/2030	XS2366407018	EUR	0	3.000
0,8750 % DS Smith MC 2019/2026	XS2051777873	EUR	0	3.000
1,0000 % ArcelorMittal MTN MC 2019/2023	XS2082323630	EUR	0	3.000
1,0000 % Volkswagen Leasing MTN 2018/2023	XS1865186321	EUR	0	3.000
1,2890 % UbiSoft Entertainment MC 2018/2023	FR0013313186	EUR	0	3.000
1,5000 % Grenke Finance MTN 2018/2023	XS1910851242	EUR	0	3.000
1,5000 % Kraft Heinz Foods MC 2016/2024	XS1405782407	EUR	0	2.500
1,5000 % Neste MC 2017/2024	FI4000261201	EUR	0	2.500
1,6250 % Anglo American Capital MTN 2017/2025	XS1686846061	EUR	0	3.000
1,6250 % UniCredit MTN -single callable- 2019/2025	XS2021993212	EUR	0	3.000
1,8750 % Carrefour MTN MC 2022/2026	FR0014009DZ6	EUR	0	3.000
2,2500 % DS Smith MTN MC 2015/2022	XS1291448824	EUR	0	3.000
2,3750 % Barry Callebaut Services 2016/2024	BE6286963051	EUR	0	2.500
2,7500 % BNP Paribas MTN fix-to-float 2022/2028	FR001400AKP6	EUR	0	3.000
3,2500 % BP Capital Markets PERP fix-to-float (sub.) 2020/2099	XS2193661324	EUR	0	3.000
3,8750 % Stellantis MC 2020/2026	XS2178833773	EUR	0	3.000
4,5000 % Italy BTP 2013/2023	IT0004898034	EUR	0	5.000
5,4510 % Enel Multi Reset Notes (subord.) 2013/2074	XS0954675129	EUR	0	2.999
6,2500 % ORSTED Multi Reset Notes (subord.) 2013/2099	XS0943370543	EUR	0	396
7,1250 % ABN AMRO Bank MTN (sub.) 2012/2022	XS0802995166	EUR	0	1.500
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,7500 % Crown European Holdings 2019/2022	XS2071622216	EUR	0	3.000

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 Optionscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)				
Optionsrechte				
Wertpapier-Optionsrechte				
Optionsrechte auf Aktien				
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put)	EUR			15.464
(Basiswert(e): Adidas AG, Airbus Group SE, Aperam SA, BASF SE, Kone Oyj, Michelin SA, OMV AG, Oreal (L') SA, Siemens Healthineers AG, VAT Group AG, Volkswagen AG Vz., Wacker Chemie AG)				

Köln, im Januar 2023

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



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 31.12.2022)
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

SÜDWESTBANK - BAWAG AG
Niederlassung Deutschland
Rotebühlstr. 125
70178 Stuttgart
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

Tresides Asset Management GmbH
Stephanstr. 25
70173 Stuttgart
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.

Besonderheiten für Anleger aus Österreich

Zahl- und Informationsstelle

(Einrichtung gem. Artikel 92 der OGAW-Richtlinie in der Änderungsfassung auf Grund der Richtlinie (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.



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