

Halbjahresbericht

Zantke Euro High Yield AMI

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	39.656.018,50	98,16
Belgien	1.047.748,00	2,59
Deutschland	3.136.318,00	7,76
Dänemark	964.225,00	2,39
Finnland	394.536,00	0,98
Frankreich	6.396.069,50	15,83
Griechenland	1.469.415,00	3,64
Großbritannien	5.982.905,00	14,81
Italien	2.160.465,50	5,35
Luxemburg	5.764.360,00	14,27
Mexiko	1.137.458,00	2,82
Niederlande	5.214.909,50	12,91
Panama	1.013.050,00	2,51
Rumänien	1.187.158,00	2,94
Schweden	1.765.305,00	4,37
Spanien	587.648,00	1,45
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	807.381,00	2,00
Österreich	627.067,00	1,55
Bankguthaben	142.087,96	0,35
Sonstige Vermögensgegenstände	664.373,26	1,64
Verbindlichkeiten	-61.383,02	-0,15
Fondsvermögen	40.401.096,70	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	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	21.440.788,00	53,07
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	21.440.788,00	53,07
0,8750 % GN Store Nord MTN MC 2021/2024	XS2412258522	EUR	500	500	0	% 93,2800	466.400,00	1,15
1,8000 % Samvardhana Motherson Automotive System 2017/2024	XS1635870923	EUR	1.500	0	0	% 96,6050	1.449.075,00	3,59
2,0000 % Dometic Group MTN MC 2021/2028	XS2391403354	EUR	500	0	0	% 80,9520	404.760,00	1,00
2,0000 % ZF Finance MTN 2021/2027	XS2338564870	EUR	800	0	0	% 87,2490	697.992,00	1,73
3,0000 % Dometic Group MTN -single callable- 2019/2026	XS1991114858	EUR	500	0	0	% 93,7170	468.585,00	1,16
3,2500 % RCS + RDS MC 2020/2028	XS2107452620	EUR	1.400	0	0	% 84,7970	1.187.158,00	2,94
3,2500 % Verisure Holding S.REGS MC 2021/2027	XS2289588837	EUR	1.000	0	0	% 89,1960	891.960,00	2,21
3,3750 % CAB SELAS 2021/2028	XS2294186965	EUR	1.400	0	0	% 81,7390	1.144.346,00	2,83
3,5000 % Grupo Antolin Irausa S.REGS MC 2021/2028	XS2355632584	EUR	800	0	0	% 73,4560	587.648,00	1,45
3,6250 % Victoria MC 2021/2026	XS2307567086	EUR	1.200	0	0	% 82,7800	993.360,00	2,46
3,7500 % BAT S.NC8 PERP fix- to-float (sub.) 2021/2199	XS2391790610	EUR	1.900	0	0	% 77,2310	1.467.389,00	3,63
3,7500 % INEOS Quattro Finance 1 S.REGS MC 2021/2026	XS2291928849	EUR	500	0	500	% 88,3610	441.805,00	1,09
3,7500 % WP/AP Telecom Hol- dings IV S.REGS MC 2021/2029	XS2417090789	EUR	850	0	0	% 87,5170	743.894,50	1,84
4,1250 % Numericable S.REGS MC 2020/2029	XS2232102876	EUR	500	0	0	% 72,8880	364.440,00	0,90
4,2500 % Huhtamaki MC 2022/2027	FI4000523550	EUR	400	0	0	% 98,6340	394.536,00	0,98

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
4,6250 % Cullinan Holdco S.REGS MC 2021/2026	XS2397354528	EUR	1.500	0	0 %	84,9330	1.273.995,00	3,15
5,1250 % Iliad Holding 2026 MC 2021/2026	XS2397781357	EUR	500	0	0 %	95,8300	479.150,00	1,19
5,2500 % ORSTED fix-to-float (sub.) (1000Y) 2022/2199	XS2563353361	EUR	500	0	500 %	99,5650	497.825,00	1,23
5,5000 % Nexans MC 2023/2028	FR001400H0F5	EUR	1.000	1.000	0 %	103,0150	1.030.150,00	2,55
5,7500 % Loxam MC (sub-ordinated) 2019/2027	XS2031871143	EUR	350	0	0 %	91,7970	321.289,50	0,80
5,7500 % Sarens Finance Co MC 2020/2027	BE6318634548	EUR	400	0	0 %	85,0930	340.372,00	0,84
5,8750 % Maxeda DIY Holding MC 2020/2026	XS2232108568	EUR	400	0	0 %	72,0700	288.280,00	0,71
6,0000 % ams-OSRAM S.REGS MC 2020/2025	XS2195511006	EUR	700	0	0 %	89,5810	627.067,00	1,55
6,6250 % Enel MTN PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2576550243	EUR	1.500	1.500	0 %	100,8590	1.512.885,00	3,74
6,7500 % Eurofins Scientific PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2579480307	EUR	1.000	1.000	0 %	100,1080	1.001.080,00	2,48
7,2500 % Stena International S.REGS MC 2023/2028	XS2010025836	EUR	800	800	0 %	102,4700	819.760,00	2,03
8,4920 % Monitchem HoldCo 3 S.REGS FRN MC 2023/2028	XS2615006983	EUR	700	700	0 %	97,8730	685.111,00	1,70
9,0980 % Italmatch Chemicals FRN 2023/2028	XS2582796541	EUR	250	250	0 %	94,5760	236.440,00	0,59
10,0000 % Italmatch Chemicals FRN 2023/2028	XS2582788100	EUR	100	100	0 %	97,6700	97.670,00	0,24
10,1250 % Carnival S.REGS MC 2020/2026	XS2010030596	EUR	500	0	0 %	105,2730	526.365,00	1,30
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	18.215.230,50	45,09
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	18.215.230,50	45,09
2,0000 % Q-Park Holdings MC 2020/2027	XS2115190451	EUR	1.500	0	0 %	85,7670	1.286.505,00	3,18
2,1250 % Numericable S.REGS MC 2020/2025	XS2110799751	EUR	500	0	500 %	92,0780	460.390,00	1,14
2,2500 % DIC Asset MC 2021/2026	XS2388910270	EUR	1.800	0	0 %	61,4170	1.105.506,00	2,74
2,2500 % InPost SA S.REGS MC 2021/2027	XS2010028004	EUR	1.400	0	0 %	87,0410	1.218.574,00	3,02
2,2500 % Nemak MC 2021/2028	XS2362994068	EUR	1.400	0	600 %	81,2470	1.137.458,00	2,82
2,2500 % Standard Industries MC 2019/2026	XS2080766475	EUR	400	0	800 %	89,1040	356.416,00	0,88
2,5000 % Nomad Foods Bondco S.REGS MC 2021/2028	XS2355604880	EUR	1.700	0	0 %	88,0630	1.497.071,00	3,71
2,8750 % WEPA Hygieneprodukte S.REGS MC 2019/2027	DE000A254QA9	EUR	1.000	0	500 %	86,7190	867.190,00	2,15
3,5000 % Ontex Group MC 2021/2026	BE6329443962	EUR	800	0	0 %	88,4220	707.376,00	1,75
3,6250 % Nobian Finance S.REGS MC 2021/2026	XS2358383466	EUR	500	0	500 %	84,6130	423.065,00	1,05
3,7500 % Stena International 2020/2025	XS2110768525	EUR	400	0	0 %	96,9890	387.956,00	0,96
3,7500 % Virgin Media Finance S.REGS MC 2020/2030	XS2189766970	EUR	2.000	0	0 %	79,1640	1.583.280,00	3,92
3,8750 % Public Power Corporation MC 2021/2026	XS2314265237	EUR	1.500	0	0 %	97,9610	1.469.415,00	3,64
4,1250 % Gruenthal GmbH MC 2021/2028	XS2337703537	EUR	500	0	500 %	93,1260	465.630,00	1,15
4,3750 % SCIL IV / SCIL USA Holdings S.REGS MC 2021/2026	XS2401849315	EUR	500	0	0 %	90,1930	450.965,00	1,12
5,0000 % Crown European Holdings MC 2023/2028	XS2623222978	EUR	500	500	0 %	101,0980	505.490,00	1,25
5,2500 % Albion Financing 1 / Aggreko Hold. S.REGs MC 2021/2026	XS2399700959	EUR	400	0	0 %	94,4710	377.884,00	0,94
5,3750 % Goldstory S.REGS MC 2021/2026	XS2294854745	EUR	1.000	0	0 %	96,8230	968.230,00	2,40
6,1250 % Marcolin S.REGS MC 2021/2026	XS2346563500	EUR	350	0	0 %	89,5630	313.470,50	0,78
6,2500 % OI European Group S.REGS MC 2023/2028	XS2624554320	EUR	1.000	1.000	0 %	102,4090	1.024.090,00	2,53
7,6250 % Carnival S.REGs MC 2020/2026	XS2264155305	EUR	500	0	0 %	97,3370	486.685,00	1,20
8,1250 % Air France-KLM MC 2023/2028	FR001400F2R8	EUR	600	600	0 %	103,6890	622.134,00	1,54

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
8,5000 % Vallourec MC 2021/2026	XS2352739184	EUR	500	0	200 %	100,0900	500.450,00	1,24
Summe Wertpapiervermögen							39.656.018,50	98,16
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	142.087,96	0,35
Bankguthaben						EUR	142.087,96	0,35
EUR - Guthaben bei						EUR	142.087,96	0,35
Verwahrstelle		EUR	142.087,96				142.087,96	0,35
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	664.373,26	1,64
Zinsansprüche		EUR					664.373,26	1,64
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-61.383,02	-0,15
Fondsvermögen						EUR	40.401.096,70	100,00²⁾
Anteilwert Klasse P (a)						EUR	110,89	
Anteilwert Klasse I (a)						EUR	111,42	
Anteilwert Klasse S (a)						EUR	110,32	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)						STK	97.703	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)						STK	84.554	
Umlaufende Anteile Klasse S (a)						STK	182.610	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)						EUR	10.834.493,44	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)						EUR	9.420.869,51	
Fondsvermögen Anteilklasse S (a)						EUR	20.145.733,75	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								98,16
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Depotgebühren und Kosten für Reserachmaterial.

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.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte per 30.06.2023 oder letztbekannte

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
1,6250 % Huhtamaki MC 2017/2024	FI4000282801	EUR	150	150
1,8160 % EP Infrastructure MC 2021/2031	XS2304675791	EUR	0	1.500
1,8750 % Air France-KLM MC 2020/2025	FR0013477254	EUR	0	400
2,8750 % Ineos Finance MC 2019/2026	XS1843437549	EUR	0	1.300
2,8750 % Samhallsbyggnadsbolaget PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2010028186	EUR	0	1.000
3,2000 % Grifols MC 2017/2025	XS1598757760	EUR	0	1.000
3,6250 % Allied Universal REGS MC 2021/2028	XS2342057143	EUR	0	800
4,0000 % Lorca Telecom Bondco S.REGS MC 2020/2027	XS2240463674	EUR	0	1.000
4,2500 % Kleopatra Finco MC 2021/2026	XS2298381307	EUR	0	400
4,5000 % Anglo American Capital MTN MC 2023/2028	XS2598746290	EUR	750	750
4,5000 % Porsche Automobil Holding MTN MC 2023/2028	XS2615940215	EUR	400	400
4,7500 % PCF S.REGS MC 2021/2026	XS2333301674	EUR	0	400
5,1250 % Autostrade per l'Italia MTN MC 2023/2033	XS2636745882	EUR	400	400
6,8750 % Telecom Italia MC 2023/2028	XS2581393134	EUR	500	500
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
1,6250 % Grifols MC 2019/2025	XS2076836555	EUR	200	200
2,1250 % Ardagh Packaging Fin/MP Holdings USA REGS MC 2020/2026	XS2189356996	EUR	0	500
2,6240 % Samhallsbyggnads bolaget PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2010032618	EUR	0	1.200
2,8750 % OI European Group MC 2019/2025	XS2077666316	EUR	0	600
3,0000 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2357357768	EUR	0	1.700
3,0000 % Progroup MC 2018/2026	DE000A2G8WA3	EUR	0	1.400
3,5000 % VZ Secured Financing S.REGS MC 2022/2032	XS2431015655	EUR	0	800
3,6250 % United Group MC 2020/2028	XS2111947748	EUR	0	1.000
5,6250 % HSE Finance 2021/2026	XS2337308238	EUR	0	800
6,4010 % WEPA Hygieneprodukte S.REGS FRN MC 2019/2026	DE000A254QC5	EUR	0	400
Nicht notierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
5,0000 % Kongsberg Actuation Systems S.REGS MC 2018/2025	XS1843461689	EUR	0	400

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

UBS Europe SE
Bockenheimer Landstr. 2 - 4
60306 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).

Auslagerung Portfoliomanagement

Zantke & Cie. Asset Management GmbH
Marienstr. 43
70178 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.



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