

Halbjahresbericht

Mayerhofer Strategie AMI

1. Oktober 2022 bis 31. März 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 31.03.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	17.808.538,05	50,09
Deutschland	8.703.000,00	24,48
Dänemark	1.014.624,46	2,85
Irland	966.300,16	2,72
Kanada	662.278,56	1,86
Niederlande	2.406.400,00	6,77
Portugal	738.750,00	2,08
Schweiz	1.962.695,22	5,52
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	1.354.489,65	3,81
Verzinsliche Wertpapiere	8.031.918,00	22,59
Deutschland	816.500,00	2,30
Italien	856.510,00	2,41
Niederlande	2.617.598,00	7,36
Spanien	1.481.250,00	4,17
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	2.260.060,00	6,36
Zertifikate	1.759.700,00	4,95
Deutschland	1.747.200,00	4,91
Luxemburg	12.500,00	0,04
Investmentanteile	7.376.060,00	20,75
Aktienfonds	7.376.060,00	20,75
Bankguthaben	527.789,06	1,48
Sonstige Vermögensgegenstände	103.314,72	0,29
Verbindlichkeiten	-53.066,22	-0,15
Fondsvermögen	35.554.253,61	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	26.198.416,05	73,69	
Aktien						EUR	17.808.538,05	50,09	
Deutschland						EUR	8.703.000,00	24,48	
Allianz SE	DE0008404005	STK	4.000	0	0	EUR	211,8000	847.200,00	2,38
Deutsche Telekom AG	DE0005557508	STK	50.000	0	0	EUR	22,1300	1.106.500,00	3,11
Formycon AG	DE000A1EWVY8	STK	14.000	6.000	0	EUR	67,0000	938.000,00	2,64
Infineon Technologies AG	DE0006231004	STK	30.000	30.000	0	EUR	37,8400	1.135.200,00	3,19
Krones AG	DE0006335003	STK	6.000	0	0	EUR	109,8000	658.800,00	1,85
Merck KGaA	DE0006599905	STK	4.000	0	0	EUR	171,7500	687.000,00	1,93
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026	STK	3.750	750	0	EUR	322,4000	1.209.000,00	3,40
Rheinmetall AG	DE0007030009	STK	3.000	3.000	0	EUR	271,7000	815.100,00	2,29
Sedlmayr Grund u.Immobilien AG	DE0007224008	STK	20	0	0	EUR	2.080,0000	41.600,00	0,12
Vonovia SE	DE000A1ML7J1	STK	30.000	30.000	0	EUR	17,3700	521.100,00	1,47
Wacker Chemie AG	DE000WCH8881	STK	5.000	5.000	0	EUR	148,7000	743.500,00	2,09
Dänemark						EUR	1.014.624,46	2,85	
Novo Nordisk A/S	DK0060534915	STK	7.000	0	0	DKK	1.079,6000	1.014.624,46	2,85
Irland						EUR	966.300,16	2,72	
Linde PLC	IE00059YS762	STK	3.000	3.000	0	USD	351,5400	966.300,16	2,72
Kanada						EUR	662.278,56	1,86	
Teck Resources Ltd. -Class B-	CA8787422044	STK	20.000	20.000	0	CAD	48,9000	662.278,56	1,86
Niederlande						EUR	2.406.400,00	6,77	
ASML Holding NV	NL0010273215	STK	2.000	0	0	EUR	623,7000	1.247.400,00	3,51

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Wolters Kluwer NV	NL0000395903	STK	10.000	10.000	0	EUR 115,9000	1.159.000,00	3,26
Portugal						EUR	738.750,00	2,08
Energias de Portugal SA	PTEDPOAM0009	STK	150.000	0	0	EUR 4,9250	738.750,00	2,08
Schweiz						EUR	1.962.695,22	5,52
Lindt&Spruengli AG PS	CH0010570767	STK	100	100	0	CHF 10.700,0000	1.073.706,43	3,02
Nestle SA	CH0038863350	STK	8.000	0	0	CHF 110,7400	888.988,79	2,50
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)						EUR	1.354.489,65	3,81
Albemarle Corp.	US0126531013	STK	2.000	0	0	USD 222,4400	407.623,24	1,15
Alcoa Corporation	US0138721065	STK	10.000	10.000	0	USD 41,7600	382.627,82	1,08
Enphase Energy Inc	US29355A1079	STK	3.000	0	0	USD 205,2700	564.238,59	1,59
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	6.642.678,00	18,68
0,3750 % Bayer MC 2021/2029	XS2281343256	EUR	1.000	0	0	% 81,6500	816.500,00	2,30
0,5000 % Dow Chemical MC 2020/2027	XS2122485845	EUR	1.000	0	0	% 87,0820	870.820,00	2,45
1,1250 % Santander Consumer Fin. MTN 2018/2023	XS1888206627	EUR	1.500	0	0	% 98,7500	1.481.250,00	4,17
1,2500 % ISS Finance MTN MC 2020/2025	XS2199343513	EUR	1.000	0	0	% 94,1690	941.690,00	2,65
2,4500 % Italy BTP 2016/2033	IT0005240350	EUR	1.000	0	0	% 85,6510	856.510,00	2,41
3,2500 % Volkswagen Int. Fin. 2018/2030	XS1910948329	EUR	1.800	0	0	% 93,1060	1.675.908,00	4,71
Zertifikate						EUR	1.747.200,00	4,91
Deutsche Börse XETRA Gold ETC	DE000A059GB0	STK	30.000	40.000	10.000	EUR 58,2400	1.747.200,00	4,91
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	1.401.740,00	3,94
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	1.389.240,00	3,91
2,0000 % Phillipp Morris 2016/2036	XS1408421763	EUR	2.000	2.000	0	% 69,4620	1.389.240,00	3,91
Zertifikate						EUR	12.500,00	0,04
Focus Global Forests Zert.	XS0410448459	STK	12.500	0	0	EUR 1,0000	12.500,00	0,04
Investmentanteile						EUR	7.376.060,00	20,75
Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	7.376.060,00	20,75
Lyxor 1 TecDAX DR UCITS ETF	DE000ETF9082	ANT	36.000	36.000	0	EUR 25,0350	901.260,00	2,53
VanEck Semiconductor UCITS ETF	IE00BMC38736	ANT	70.000	70.000	0	EUR 22,8300	1.598.100,00	4,49
db x-trackers MSCI World Materials Index UCITS ETF	IE00BM67HS53	ANT	40.000	60.000	20.000	EUR 49,1300	1.965.200,00	5,53
iShares MSCI World Energy Sector UCITS ETF	IE00BJ5JP105	ANT	300.000	300.000	0	EUR 5,9490	1.784.700,00	5,02
iShares STOXX Europe 600 Autom.&Parts (DE) ETF	DE000A0Q4R28	ANT	20.000	20.000	0	EUR 56,3400	1.126.800,00	3,17
Summe Wertpapiervermögen							34.976.216,05	98,37
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	527.789,06	1,48
Bankguthaben						EUR	527.789,06	1,48
EUR - Guthaben bei						EUR	495.741,18	1,39
Verwahrstelle		EUR	495.016,67				495.016,67	1,39
Kreissparkasse Köln		EUR	364,54				364,54	0,00
Kreissparkasse München Starnberg Ebersberg		EUR	40,40				40,40	0,00
Landesbank Baden-Württemberg		EUR	319,57				319,57	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen						EUR	0,87	0,00
Verwahrstelle		GBP	0,77				0,87	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	32.047,01	0,09
Verwahrstelle		USD	34.976,10				32.047,01	0,09
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	103.314,72	0,29
Dividendenansprüche		EUR					7.708,10	0,02
Quellensteuerrückstellungenansprüche		EUR					17.963,95	0,05
Zinsansprüche		EUR					77.642,67	0,22
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-53.066,22	-0,15
Fondsvermögen						EUR	35.554.253,61	100,00²⁾
Anteilwert Klasse P (a)						EUR	140,10	
Anteilwert Klasse I (a)						EUR	95,79	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)						STK	185.143,795	

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Umlaufende Anteile Klasse I (a)				STK			100.377	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)				EUR			25.939.223,63	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)				EUR			9.615.029,98	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								98,37
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 31. März 2023 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 99,96 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0,04 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren. Bei den sonstigen Bewertungsverfahren handelt es sich um Wertansätze für geschlossene Immobilienfonds.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.03.2023

Kanada, Dollar	(CAD)	1,47672	= 1 (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,99655	= 1 (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44827	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,88152	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,09140	= 1 (EUR)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte per 30.03.2023 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				
Aktien				
Deutschland				
Aixtron AG	DE000A0WMPJ6	STK	30.000	30.000
Encavis AG	DE0006095003	STK	0	20.000
PNE Wind AG	DE000A0JBPG2	STK	30.000	30.000
SMA Solar Technology AG	DE000A0DJ6J9	STK	0	15.000
Sartorius AG Vz.	DE0007165631	STK	0	2.000
Symrise AG	DE000SYM9999	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
Frankreich				
Bouygues SA	FR0000120503	STK	5.900	5.900
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014	STK	0	1.500
Michelin SA	FR001400AJ45	STK	5.600	5.600
Irland				
Linde PLC	IE00BZ12WP82	STK	1.000	3.000
Italien				
Assicurazioni Generali SpA	IT0000062072	STK	10.100	10.100
Enel SpA	IT0003128367	STK	27.200	27.200
Kanada				
Pan American Silver Corp.	CA6979001089	STK	40.000	40.000
Niederlande				
Argenx SE	NL0010832176	STK	0	1.500
Koninklijke Ahold Delhaize NV	NL0011794037	STK	6.600	6.600
Norwegen				
Equinor ASA	NO0010096985	STK	20.000	40.000
Schweiz				
Arbonia AG	CH0110240600	STK	20.000	60.000
Bachem Holding AG	CH1176493729	STK	7.500	7.500
Straumann Holdings	CH1175448666	STK	0	5.000
Tecan Group AG	CH0012100191	STK	2.000	2.000
Spanien				
Iberdrola SA	ES0144580Y14	STK	15.557	15.557
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)				
CVS Health Corp.	US1266501006	STK	1.700	1.700
Chevron Corp.	US1667641005	STK	1.050	1.050
Corning Inc.	US2193501051	STK	4.600	4.600
Eastman Chemical Company	US2774321002	STK	1.900	1.900
Genuine Parts Co.	US3724601055	STK	1.100	1.100
Intel Corp.	US4581401001	STK	4.400	4.400
Juniper Networks Inc.	US48203R1041	STK	6.000	6.000
Newmont Corp.	US6516391066	STK	0	15.000
PulteGroup Inc.	US7458671010	STK	3.800	3.800
Verzinsliche Wertpapiere				
2,0000 % Goldman Sachs Group MTN 2015/2023	XS1265805090	EUR	0	1.500
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
Deutschland				
Wallstreet:Online AG	DE000A2GS609	STK	0	60.000
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
Auag ESG Gold Mining UCITS ETF	IE00BNTVVR89	ANT	8.000	8.000
BNP Paribas Easy EUR Corp Bond SRI Fossil Free 1-3	LU2008760592	ANT	108.000	108.000
BNY - Responsible Horizons	IE00BKWGFQ61	ANT	900.000	900.000
Evli Nordic Corporate Bond	FI0008812011	ANT	7.000	7.000
Gamma Plus	DE000A3CT6E6	ANT	7.200	7.200
Lyxor EURO STOXX Banks DR UCITS ETF	LU1829219390	ANT	40.000	40.000
Lyxor STOXX Europe 600 Basic Resources UCITS ETF	LU1834983550	ANT	20.000	20.000
Nordea I-Danish Mortgage Bond	LU0351545586	ANT	31.000	31.000
Principal Global Investors Funds - Post Global Ltd	IE00B4L22Q21	ANT	100.000	100.000
iShares Gold Producers UCITS ETF	IE00B6R52036	ANT	140.000	140.000

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 Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)				
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte				12.545
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)				

Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

Verwaltungsvergütung der im Mayerhofer Strategie AMI enthaltenen Investmentanteile:	% p.a.
Auag ESG Gold Mining UCITS ETF	0,60000
BNP Paribas Easy EUR Corp Bond SRI Fossil Free 1-3	0,08000
BNY - Responsible Horizons	k.A.
Evli Nordic Corporate Bond	0,40000
Gamma Plus	1,00000
Lyxor 1 TecDAX DR UCITS ETF	0,40000
Lyxor EURO STOXX Banks DR UCITS ETF	0,30000
Lyxor STOXX Europe 600 Basic Resources UCITS ETF	0,30000
Nordea I-Danish Mortgage Bond	0,30000
Principal Global Investors Funds - Post Global Ltd	0,70000
VanEck Semiconductor UCITS ETF	k.A.
db x-trackers MSCI World Materials Index UCITS ETF	0,10000
iShares Gold Producers UCITS ETF	1,10000
iShares MSCI World Energy Sector UCITS ETF	0,25000
iShares STOXX Europe 600 Autom.&Parts (DE) ETF	0,45000

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschlüsse gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im April 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 31.03.2023)
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 (ab dem 01.01.2023)
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).

Auslagerung Portfoliomanagement

MFI Asset Management GmbH
Brienner Str. 53 a
80333 München
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