

Halbjahresbericht

Ampega Faktor StrategiePlus

1. Oktober 2022 bis 31. März 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 31.03.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	36.925.011,49	97,96
Belgien	969.421,60	2,57
Deutschland	10.176.650,40	27,00
Finnland	2.113.787,58	5,61
Frankreich	14.715.319,50	39,04
Großbritannien	1.021.055,90	2,71
Italien	1.861.429,50	4,94
Niederlande	4.749.436,02	12,60
Spanien	1.317.910,99	3,50
Derivate	-1.613.230,00	-4,28
Aktienindex-Derivate	-1.613.230,00	-4,28
Bankguthaben	2.294.835,54	6,09
Sonstige Vermögensgegenstände	121.818,15	0,32
Verbindlichkeiten	-34.457,48	-0,09
Fondsvermögen	37.693.977,70	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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	36.925.011,49	97,96
Aktien							EUR	36.925.011,49	97,96
Belgien							EUR	969.421,60	2,57
Groupe Bruxelles Lambert SA	BE0003797140		STK	4.340	1.200	1.860	EUR 77,6400	336.957,60	0,89
KBC Groep NV	BE0003565737		STK	5.600	0	4.400	EUR 62,8400	351.904,00	0,93
UCB SA	BE0003739530		STK	3.360	0	1.440	EUR 83,5000	280.560,00	0,74
Deutschland							EUR	10.176.650,40	27,00
Allianz SE	DE0008404005		STK	5.250	1.000	3.750	EUR 211,8000	1.111.950,00	2,95
BASF SE	DE000BASF111		STK	14.700	0	9.300	EUR 47,9000	704.130,00	1,87
Bayer AG	DE000BAY0017		STK	15.400	22.000	6.600	EUR 57,7800	889.812,00	2,36
Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft St.	DE0005190003		STK	6.580	0	2.820	EUR 100,6800	662.474,40	1,76
Deutsche Börse AG	DE0005810055		STK	3.990	0	1.710	EUR 177,9500	710.020,50	1,88
Deutsche Post AG	DE0005552004		STK	16.100	0	13.900	EUR 42,5250	684.652,50	1,82
Deutsche Telekom AG	DE0005557508		STK	49.000	10.000	31.000	EUR 22,1300	1.084.370,00	2,88
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	30.100	0	12.900	EUR 11,4600	344.946,00	0,92
Fresenius SE & Co KGaA St.	DE0005785604		STK	13.300	4.000	5.700	EUR 24,4000	324.520,00	0,86
Henkel AG & Co. KGaA Vz.	DE0006048432		STK	5.250	0	3.750	EUR 70,9200	372.330,00	0,99
Merck KGaA	DE0006599905		STK	2.100	0	900	EUR 171,7500	360.675,00	0,96
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026		STK	2.450	0	1.550	EUR 322,4000	789.880,00	2,10
SAP SE	DE0007164600		STK	12.600	2.000	9.400	EUR 115,3600	1.453.536,00	3,86
Siemens Healthineers AG	DE000SHL1006		STK	7.000	2.100	3.000	EUR 52,4600	367.220,00	0,97
Vonovia SE	DE000A1ML7J1		STK	18.200	7.000	13.800	EUR 17,3700	316.134,00	0,84
Finnland							EUR	2.113.787,58	5,61
Kone Oyj	FI0009013403		STK	7.700	0	5.300	EUR 46,7400	359.898,00	0,95
Nokia Corp.	FI0009000681		STK	112.000	40.000	48.000	EUR 4,4710	500.752,00	1,33
Nordea Bank Holding ABP	FI4000297767		STK	70.000	50.000	40.000	EUR 9,8810	691.670,00	1,83
Sampo Oyj	FI0009003305		STK	6.954	0	2.980	EUR 43,2700	300.899,58	0,80
UPM-Kymmene Corp.	FI0009005987		STK	8.400	12.000	3.600	EUR 31,0200	260.568,00	0,69
Frankreich							EUR	14.715.319,50	39,04
AXA SA	FR0000120628		STK	31.500	0	18.500	EUR 28,2850	890.977,50	2,36

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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	
Air Liquide SA	FR0000120073		STK	7.000	1.000	5.000	EUR	152,7000	1.068.900,00	2,84
Bureau Veritas SA	FR0006174348		STK	14.000	5.500	6.000	EUR	26,5200	371.280,00	0,98
Cap Gemini SA	FR0000125338		STK	1.750	0	1.750	EUR	170,5000	298.375,00	0,79
Danone SA	FR0000120644		STK	11.200	0	4.800	EUR	56,5900	633.808,00	1,68
Essilor International SA	FR0000121667		STK	4.900	0	2.100	EUR	163,8500	802.865,00	2,13
Gecina SA REIT	FR0010040865		STK	2.800	1.624	2.200	EUR	95,8000	268.240,00	0,71
Kering SA	FR0000121485		STK	1.225	500	975	EUR	594,6000	728.385,00	1,93
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014		STK	2.660	300	2.340	EUR	827,0000	2.199.820,00	5,84
Legrand SA	FR0010307819		STK	3.360	0	1.440	EUR	83,6000	280.896,00	0,75
Michelin SA	FR001400AJ45		STK	9.800	0	4.200	EUR	28,0800	275.184,00	0,73
Orange SA	FR0000133308		STK	35.700	0	15.300	EUR	10,8200	386.274,00	1,02
Oreal (L') SA	FR0000120321		STK	3.150	0	1.850	EUR	405,5500	1.277.482,50	3,39
Pernod Ricard SA	FR0000120693		STK	3.500	0	1.500	EUR	206,5000	722.750,00	1,92
Publicis Groupe SA	FR0000130577		STK	5.250	0	3.750	EUR	72,5800	381.045,00	1,01
Sanofi SA	FR0000120578		STK	15.050	2.000	9.950	EUR	99,4300	1.496.421,50	3,97
Schneider Electric SE	FR0000121972		STK	7.700	0	5.300	EUR	153,1000	1.178.870,00	3,13
Veolia Environnement SA	FR0000124141		STK	11.200	0	4.800	EUR	28,2600	316.512,00	0,84
Vinci SA	FR0000125486		STK	7.700	0	5.300	EUR	105,4200	811.734,00	2,15
Vivendi SA	FR0000127771		STK	35.000	0	15.000	EUR	9,3000	325.500,00	0,86
Großbritannien							EUR	1.021.055,90	2,71	
Coca-Cola Europacific Partners PLC	GB00BDCPN049		STK	6.273	0	2.688	EUR	53,4000	334.978,20	0,89
Relx PLC	GB00B2B0D9G7		STK	12.180	0	5.220	EUR	29,5500	359.919,00	0,95
Unilever PLC	GB00B10RZP78		STK	6.860	0	2.940	EUR	47,5450	326.158,70	0,87
Italien							EUR	1.861.429,50	4,94	
Assicurazioni Generali SpA	IT0000062072		STK	18.900	0	8.100	EUR	18,2950	345.775,50	0,92
Enel SpA	IT0003128367		STK	140.000	0	60.000	EUR	5,6100	785.400,00	2,08
Recordati SpA	IT0003828271		STK	9.100	4.500	3.900	EUR	39,2600	357.266,00	0,95
Terna SpA	IT0003242622		STK	49.000	85.000	36.000	EUR	7,6120	372.988,00	0,99
Niederlande							EUR	4.749.436,02	12,60	
ASML Holding NV	NL0010273215		STK	4.025	0	3.475	EUR	623,7000	2.510.392,50	6,66
Heineken NV	NL0000009165		STK	3.044	0	1.304	EUR	97,5800	297.033,52	0,79
Koninklijke Ahold Delhaize NV	NL0011794037		STK	19.600	0	12.400	EUR	31,0000	607.600,00	1,61
Koninklijke DSM NV	NL0000009827		STK	2.800	1.500	1.200	EUR	108,0000	302.400,00	0,80
NN Group NV	NL0010773842		STK	9.100	3.600	3.900	EUR	33,4000	303.940,00	0,81
Philips NV (Konin.)	NL0000009538		STK	19.600	0	16.400	EUR	16,4500	322.420,00	0,86
Wolters Kluwer NV	NL0000395903		STK	3.500	0	1.500	EUR	115,9000	405.650,00	1,08
Spanien							EUR	1.317.910,99	3,50	
Iberdrola SA	ES0144580Y14		STK	88.958	12.650	53.125	EUR	11,4050	1.014.565,99	2,69
Red Electrica Corporacion SA	ES0173093024		STK	18.900	0	8.100	EUR	16,0500	303.345,00	0,80
Summe Wertpapiervermögen								36.925.011,49	97,96	
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	-1.613.230,00	-4,28	
Aktienindex-Derivate							EUR	-1.613.230,00	-4,28	
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-1.613.230,00	-4,28	
Euro Stoxx 50 Future Juni 2023		EUREX	STK	-660				-1.613.230,00	-4,28	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.294.835,54	6,09	
Bankguthaben							EUR	2.294.835,54	6,09	
EUR - Guthaben bei							EUR	2.294.835,54	6,09	
Verwahrstelle			EUR	2.294.835,54				2.294.835,54	6,09	
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	121.818,15	0,32	
Dividendenansprüche			EUR					36.400,00	0,10	
Quellensteuerrück- stattungsansprüche			EUR					85.418,15	0,23	

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
Sonstige Verbindlichkeiten ¹⁾							EUR	-34.457,48	-0,09
Fondsvermögen							EUR	37.693.977,70	100,00²⁾
Anteilwert Klasse I (a)							EUR	96,00	
Anteilwert Klasse P (a)							EUR	93,12	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)							STK	123.416,232	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)							STK	277.549,631	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)							EUR	11.847.990,73	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)							EUR	25.845.986,97	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									97,96
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									-4,28

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 100 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 0 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Marktschlüssel**Terminbörsen**

EUREX European Exchange Deutschland

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				
Siemens AG	DE0007236101	STK	0	16.000
Frankreich				
Engie SA	FR0010208488	STK	0	37.000
Euroapi Sas	FR0014008VX5	STK	0	869

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
Irland				
Linde PLC	IE00BZ12WP82	STK	1.200	10.000
Niederlande				
Akzo Nobel NV	NL0013267909	STK	0	7.000
Spanien				
Iberdrola Inh. -Anr-	ES06445809P3	STK	125.000	125.000
Nicht notierte Wertpapiere				
Aktien				
Spanien				
Iberdrola Inh. Eo -,75	ES0144583277	STK	2.083	2.083

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		EUR		42.393
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)				

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

Kreissparkasse Köln
Neumarkt 18 - 24
50667 Köln
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).

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