

Halbjahresbericht

Stiftungsfonds STU

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	146.934.835,00	99,14
Belgien	1.242.534,00	0,84
Deutschland	37.448.889,00	25,27
Dänemark	990.300,00	0,67
Estland	1.230.480,00	0,83
Europäische Institutionen	3.533.695,00	2,38
Finnland	8.991.588,00	6,07
Frankreich	30.339.704,00	20,47
Großbritannien	21.479.805,00	14,49
Italien	1.368.108,00	0,92
Litauen	249.930,00	0,17
Luxemburg	4.869.618,00	3,29
Niederlande	3.453.822,00	2,33
Norwegen	7.229.515,00	4,88
Portugal	1.467.975,00	0,99
Schweden	5.448.202,00	3,68
Slowakei	2.137.718,00	1,44
Spanien	1.350.807,00	0,91
Tschechische Republik	1.359.920,00	0,92
Österreich	12.742.225,00	8,60
Bankguthaben	1.074.655,23	0,73
Sonstige Vermögensgegenstände	337.511,51	0,23
Verbindlichkeiten	-130.613,31	-0,09
Fondsvermögen	148.216.388,43	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. Wgh. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	136.867.048,00	92,34
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	136.867.048,00	92,34
0,0000 % Adidas MC 2020/2024	XS2224621347	EUR	500	0	0 %	95,5480	477.740,00	0,32
0,0000 % European Union MTN S.NGEU 2021/2028	EU000A3KWCF4	EUR	1.000	0	0 %	85,1170	851.170,00	0,57
0,0000 % Lanxess MTN MC 2021/2027	XS2383886947	EUR	700	0	0 %	83,8220	586.754,00	0,40
0,0000 % Mercedes-Benz Interna- tional Finance MTN 2019/2024	DE000A2YNZV0	EUR	700	0	0 %	97,7610	684.327,00	0,46
0,0000 % Societe du Grand Paris MTN 2020/2030	FR00140005B8	EUR	4.600	0	0 %	78,8810	3.628.526,00	2,45
0,0000 % UNEDIC MTN 2020/2028	FR0014000667	EUR	5.400	0	0 %	84,6130	4.569.102,00	3,08
0,0100 % BAWAG Fun- dierte Anl. 2021/2029	XS2380748439	EUR	3.500	0	0 %	81,2900	2.845.150,00	1,92
0,0100 % BPCE SFH 2020/2030	FR0013514502	EUR	2.000	0	0 %	79,6570	1.593.140,00	1,07
0,0100 % BPCE SFH 2021/2029	FR0014001MO8	EUR	3.000	0	0 %	82,9760	2.489.280,00	1,68
0,0100 % Berlin Hyp Pfe. 2019/2027	DE000BHY0GL4	EUR	2.600	0	0 %	87,3970	2.272.322,00	1,53
0,0100 % Credit Agricole Home Loan SFH MTN 2021/2028	FR0014004EJ9	EUR	500	0	0 %	85,0710	425.355,00	0,29
0,0100 % Komerčni Banka MTN 2021/2026	XS2289128162	EUR	1.000	0	0 %	90,4100	904.100,00	0,61
0,0100 % Yorkshire Buil- ding Soc. MTN 2020/2027	XS2243314528	EUR	2.900	0	0 %	85,4710	2.478.659,00	1,67
0,0500 % AXA Home Loan SFH SA 2019/2027	FR0013432069	EUR	5.000	0	0 %	87,1600	4.358.000,00	2,94
0,0500 % BNG Bank MTN 2016/2024	XS1445725218	EUR	700	0	0 %	96,3240	674.268,00	0,45

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
0,0500 % European Financial Stability Facility (EFSF) 2019/2029	EU000A1G0EE0	EUR	1.500	0	0 %	82,8730	1.243.095,00	0,84
0,0500 % Nationwide Build. MTN (covered) 2019/2024	XS2004366287	EUR	4.000	0	0 %	96,4510	3.858.040,00	2,60
0,0500 % SP-Kiinnitysluotopankki Oyj 2019/2026	XS2014370915	EUR	3.000	0	1.700 %	89,8820	2.696.460,00	1,82
0,0500 % Santander UK MTN 2020/2027	XS2102283814	EUR	4.500	0	0 %	87,9670	3.958.515,00	2,67
0,0500 % Sparebanken 1 Boligkreditt MTN 2021/2028	XS2404591161	EUR	1.500	0	0 %	83,6480	1.254.720,00	0,85
0,0500 % Swedbank Hypo. MTN 2019/2025	XS2002504194	EUR	2.900	0	0 %	93,1080	2.700.132,00	1,82
0,1000 % Commerzbank MTN 2021/2025	DE000CB0HRY3	EUR	1.000	0	0 %	91,9680	919.680,00	0,62
0,1000 % Santander UK MTN 2019/2024	XS1995645287	EUR	700	0	0 %	96,7410	677.187,00	0,46
0,1250 % Coventry Building (covered) 2019/2026	XS2015230365	EUR	4.500	0	0 %	89,6910	4.036.095,00	2,72
0,1250 % Credit Agricole Home Loan SFH MTN (covered) 2020/2024	FR0013505575	EUR	2.000	0	0 %	94,7660	1.895.320,00	1,28
0,1250 % Dassault Systemes MC 2019/2026	FR0013444544	EUR	1.000	0	0 %	89,4970	894.970,00	0,60
0,1250 % Estland 2020/2030	XS2181347183	EUR	600	0	0 %	80,5840	483.504,00	0,33
0,1250 % Merck Financial Services MTN MC 2020/2025	XS2102916793	EUR	1.000	0	0 %	92,8380	928.380,00	0,63
0,1250 % Niedersachsen LSA 5.887 2019/2027	DE000A2TSB40	EUR	3.000	0	0 %	88,9020	2.667.060,00	1,80
0,1250 % SAP MC 2020/2026	XS2176715584	EUR	1.000	0	0 %	90,9920	909.920,00	0,61
0,1250 % Sparebanken 1 Boligkreditt MTN 2019/2026	XS1995620967	EUR	4.000	0	0 %	90,3680	3.614.720,00	2,44
0,1250 % Volkswagen Fin. Serv. MTN 2021/2027	XS2374595044	EUR	1.500	0	0 %	86,4240	1.296.360,00	0,87
0,1250 % Yorkshire Building Soc. 2019/2024	XS1991186500	EUR	3.000	0	0 %	96,7120	2.901.360,00	1,96
0,2500 % ASFINAG MTN 2017/2024	XS1701458017	EUR	500	0	0 %	95,6010	478.005,00	0,32
0,2500 % Agence Francaise Develop MTN 2019/2029	FR0013431137	EUR	4.000	0	0 %	83,5930	3.343.720,00	2,26
0,2500 % BNG Bank MTN 2015/2025	XS1227748214	EUR	2.400	0	0 %	94,0190	2.256.456,00	1,52
0,2500 % Erste Group Bank Pfe. 2018/2024	XS1845161790	EUR	2.500	0	0 %	96,4430	2.411.075,00	1,63
0,2500 % European Investment Bank MTN 2017/2024	XS1575991358	EUR	1.500	0	0 %	95,9620	1.439.430,00	0,97
0,2500 % ING-DiBa Hyp-Pfe. 2018/2023	DE000A1KRJR4	EUR	2.000	0	0 %	99,1270	1.982.540,00	1,34
0,2500 % Norddeutsche Landesbank Hyp-Pfe. 2016/2024	DE000DHY4648	EUR	3.000	0	0 %	96,9090	2.907.270,00	1,96
0,2500 % OEBK Oest. Kontrollbank MTN 2017/2024	XS1689595830	EUR	1.600	0	0 %	95,7140	1.531.424,00	1,03
0,2500 % Societe Generale SFH (covered) 2018/2023	FR0013358496	EUR	2.000	0	0 %	99,3820	1.987.640,00	1,34
0,2500 % Swedbank MTN S.GMTN 2021/2026	XS2404027935	EUR	500	0	0 %	87,9040	439.520,00	0,30
0,2500 % Vorarlberger Landes-Hypobank MTN 2019/2027	XS1999728394	EUR	2.200	0	0 %	87,8850	1.933.470,00	1,30
0,2500 % Vseobecná Uverova Banka (covered) 2019/2024	SK4120015108	EUR	2.200	0	1.900 %	97,1690	2.137.718,00	1,44
0,2500 % Wallonische Region MTN 2019/2026	BE6313645127	EUR	500	0	0 %	91,3900	456.950,00	0,31
0,3000 % Banco Santander MTN 2019/2026	XS2063247915	EUR	400	0	0 %	88,9310	355.724,00	0,24
0,3250 % Cie Fin. Foncier Obl. Fon. 2017/2023	FR0013231081	EUR	2.000	0	0 %	99,3940	1.987.880,00	1,34
0,3250 % UniCredit MTN 2021/2026	XS2289133915	EUR	600	0	0 %	90,6740	544.044,00	0,37
0,3750 % Credit Agricole Home Loan SFH (covered) 2017/2024	FR0013263951	EUR	1.500	0	0 %	95,7920	1.436.880,00	0,97
0,3750 % Eika Boligkreditt MTN (covered) 2017/2025	XS1725524471	EUR	2.500	0	0 %	94,4030	2.360.075,00	1,59
0,5000 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2027	XS2152932542	EUR	200	0	0 %	89,7070	179.414,00	0,12
0,5000 % Hypo NOE Gruppe Bank ÖPfe. 2018/2025	XS1875268689	EUR	1.500	0	0 %	93,0270	1.395.405,00	0,94
0,5000 % Lithuania MTN 2019/2029	XS2013677864	EUR	300	0	0 %	83,3100	249.930,00	0,17

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
0,5000 % Nat. Westminster Bank MTN (covered) 2017/2024	XS1612958253	EUR	2.300	0	0 %	97,0390	2.231.897,00	1,51
0,5000 % Nordrhein-Westfalen LSA 2017/2027	DE000NRW0KB3	EUR	1.000	0	0 %	90,4690	904.690,00	0,61
0,5000 % RCI Banque MTN MC 2022/2025	FR0014007KL5	EUR	500	0	0 %	92,5890	462.945,00	0,31
0,5400 % Ferrovial Emisiones MC 2020/2028	ES0205032040	EUR	500	0	0 %	84,2090	421.045,00	0,28
0,6250 % Commerzbank Hyp-Pfe. 2018/2025	DE000CZ40MN2	EUR	1.800	0	0 %	94,7490	1.705.482,00	1,15
0,6250 % Lansforsakringar Hypothek (covered) 2019/2026	XS1942708873	EUR	2.500	0	0 %	92,3420	2.308.550,00	1,56
0,6250 % NRW.Bank 2018/2028	DE000NWB18D6	EUR	500	0	0 %	89,1280	445.640,00	0,30
0,7500 % Austria MTN 2018/2028	AT0000A1ZGE4	EUR	200	0	0 %	90,5180	181.036,00	0,12
0,7500 % Deutsche Kreditbank 2017/2024	DE000GRN0016	EUR	500	0	0 %	95,8660	479.330,00	0,32
0,8270 % Madrid (Comunidad de) 2020/2027	ES0000101966	EUR	200	0	0 %	89,9970	179.994,00	0,12
0,8750 % Banco Santander Totta Obr. Hipot. (covered) 2017/2024	PTBSRIOE0024	EUR	1.000	0	0 %	97,5120	975.120,00	0,66
0,8750 % London Stock Exchange Group MTN 2017/2024	XS1685653302	EUR	700	0	0 %	96,2920	674.044,00	0,45
1,0000 % Intesa Sanpaolo MTN 2019/2026	XS2081018629	EUR	500	0	0 %	89,8440	449.220,00	0,30
1,1250 % Deutsche Bahn Finance MTN 2019/2028	XS1936139770	EUR	200	0	0 %	89,5520	179.104,00	0,12
1,1250 % Deutsche Bank MTN 2015/2025	DE000DB7XJP9	EUR	700	0	0 %	93,8840	657.188,00	0,44
1,1250 % Euroclear Investments 2016/2026	BE6334365713	EUR	200	0	0 %	90,8040	181.608,00	0,12
1,1250 % Orange MTN MC 2019/2024	FR0013396512	EUR	500	0	0 %	97,1480	485.740,00	0,33
1,5000 % Ceske Drahy 2019/2026	XS1991190361	EUR	500	0	0 %	91,1640	455.820,00	0,31
1,7500 % Intesa Sanpaolo MTN 2018/2028	XS1785340172	EUR	200	0	0 %	89,4490	178.898,00	0,12
2,5000 % Brandenburg 2023/2029	DE000A3E5SL5	EUR	600	600	0 %	96,7830	580.698,00	0,39
2,5000 % Bundesobligation 2023/2025	DE000BU22007	EUR	1.400	2.000	600 %	98,7810	1.382.934,00	0,93
2,7500 % LB Baden-Württ. ÖPfe. 2022/2024	DE000LB381U7	EUR	1.000	0	0 %	98,8420	988.420,00	0,67
2,7500 % Münchener Hyp. MTN 2023/2025	DE000MHB33J5	EUR	3.400	3.400	0 %	98,1110	3.335.774,00	2,25
2,7500 % OP Mortgage Bank MTN 2022/2026	XS2558247677	EUR	4.700	0	0 %	97,4240	4.578.928,00	3,09
2,8750 % Berlin Hyp 2023/2030	DE000BHY0GT7	EUR	2.100	2.100	0 %	97,9890	2.057.769,00	1,39
2,8750 % LB Baden-Württ. Pfe. 2023/2026	DE000LB384E5	EUR	2.100	2.100	0 %	98,3220	2.064.762,00	1,39
3,0000 % Aareal Bank MTN 2023/2027	DE000AAR0371	EUR	300	300	0 %	98,1180	294.354,00	0,20
3,0000 % Belfius Bank 2023/2027	BE0002921022	EUR	800	800	0 %	98,1980	785.584,00	0,53
3,0000 % UniCredit Bank MTN 2023/2026	DE000HV2AZC4	EUR	2.000	2.000	0 %	98,3380	1.966.760,00	1,33
3,1250 % APRR MTN MC 2023/2030	FR001400I145	EUR	600	600	0 %	97,2030	583.218,00	0,39
3,1250 % BAWAG 2023/2029	XS2570759154	EUR	1.500	1.500	0 %	98,2650	1.473.975,00	0,99
3,1250 % UniCredit Bank Austria MTN 2023/2029	AT000B049945	EUR	500	500	0 %	98,5370	492.685,00	0,33
3,1250 % UniCredit Bank ÖPfe. S.2140 2023/2025	DE000HV2AZG5	EUR	2.000	2.000	0 %	98,8030	1.976.060,00	1,33
3,2500 % Banco Santander 2023/2028	ES0413900939	EUR	400	400	0 %	98,5110	394.044,00	0,27
3,2500 % Jyske Realkredit 2023/2030	DK0009412553	EUR	1.000	1.000	0 %	99,0300	990.300,00	0,67
3,3750 % Banco Santander Totta Obr. Hipot. 2023/2028	PTBSPAOM0008	EUR	500	500	0 %	98,5710	492.855,00	0,33
3,3750 % Volkswagen Fin. Serv. MTN 2020/2028	XS2152061904	EUR	500	500	0 %	96,5900	482.950,00	0,33
3,6250 % Robert Bosch MTN MC 2023/2030	XS2629468278	EUR	200	200	0 %	99,1240	198.248,00	0,13
4,1250 % Italgas MTN 2023/2032	XS2633317701	EUR	200	200	0 %	97,9730	195.946,00	0,13
5,0000 % Dt. Pfandbriefbank MTN 2023/2027	DE000A30WF84	EUR	400	400	0 %	101,3630	405.452,00	0,27

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
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	10.067.787,00	6,79
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	10.067.787,00	6,79
0,0100 % Danske Bank 2020/2028	XS2058989489	EUR	2.000	0	0 %	85,8100	1.716.200,00	1,16
0,0100 % Luminor Bank MTN 2020/2025	XS2133077383	EUR	800	0	0 %	93,3720	746.976,00	0,50
0,0100 % Nord LB Luxembourg Covered Bond Bank MTN 2020/2027	XS2186093410	EUR	5.400	0	0 %	86,8150	4.688.010,00	3,16
0,2000 % Coca-Cola European Partners MC 2020/2028	XS2264977146	EUR	800	0	0 %	83,0010	664.008,00	0,45
0,3750 % LB Baden-Württemberg MTN 2020/2027	DE000LB2CRG6	EUR	1.200	0	0 %	86,5040	1.038.048,00	0,70
1,0000 % JAB Holdings 2019/2027	DE000A2SBDE0	EUR	600	0	0 %	87,1830	523.098,00	0,35
2,7500 % KfW MTN 2023/2028	DE000A30VUK5	EUR	300	300	0 %	98,6430	295.929,00	0,20
3,8750 % Bouygues MC 2023/2031	FR001400IBM5	EUR	200	200	0 %	98,9940	197.988,00	0,13
4,0000 % Deutsche Bank MTN 2022/2027	DE000A30VQ09	EUR	200	200	0 %	98,7650	197.530,00	0,13
Summe Wertpapiervermögen							146.934.835,00	99,14
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	1.074.655,23	0,73
Bankguthaben						EUR	1.074.655,23	0,73
EUR - Guthaben bei						EUR	1.074.655,23	0,73
Verwahrstelle		EUR	1.074.655,23				1.074.655,23	0,73
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	337.511,51	0,23
Forderung CSDR Penalty		EUR					1.053,46	0,00
Quellensteuerrückstellungenansprüche		EUR					825,00	0,00
Zinsansprüche		EUR					335.633,05	0,23
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-130.613,31	-0,09
Fondsvermögen						EUR	148.216.388,43	100,00²⁾
Anteilwert						EUR	1.006,96	
Umlaufende Anteile						STK	147.192	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								99,14
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Veröffentlichungskosten, Managementgebühr, Depotgebühren und Druckkosten

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 29.06.2023 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				
Aktien				
Belgien				
Groupe Bruxelles Lambert SA	BE0003797140	STK	0	2.000
Deutschland				
Adidas AG	DE000A1EWWW0	STK	0	580
Allianz SE	DE0008404005	STK	0	1.000
BASF SE	DE000BASF111	STK	0	6.000
Henkel AG & Co. KGaA Vz.	DE0006048432	STK	0	2.500
Mercedes-Benz Gruppe AG	DE0007100000	STK	0	2.500
Münchener Rückvers. AG	DE0008430026	STK	0	1.000
Nemetschek AG	DE0006452907	STK	0	4.000
SAP SE	DE0007164600	STK	0	2.900
Siemens AG	DE0007236101	STK	0	3.200
Siemens Healthineers AG	DE000SHL1006	STK	0	7.200
Sixt SE St.	DE0007231326	STK	0	2.400
Frankreich				
Air Liquide SA	FR0000120073	STK	0	1.250
Danone SA	FR0000120644	STK	0	7.000
Essilor International SA	FR0000121667	STK	0	1.650
Hermes International SA	FR0000052292	STK	0	250
Kering SA	FR0000121485	STK	0	250
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014	STK	0	750
Oreal (L') SA	FR0000120321	STK	0	1.100
Schneider Electric SE	FR0000121972	STK	0	950
Luxemburg				
Eurofins SCI Inhaber	FR0014000MR3	STK	0	1.500
Niederlande				
ASML Holding NV	NL0010273215	STK	0	1.000
Adyen NV	NL0012969182	STK	0	100
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Iceland Government International Bond 2021/2028	XS2293755125	EUR	0	500
0,0000 % Telenor MTN MC 2019/2023	XS2056395606	EUR	0	500
0,2500 % BRFKredit (covered) 2016/2023	XS1435774903	EUR	0	2.000
0,3750 % Belfius Bank MTN (covered) 2018/2023	BE0002620012	EUR	0	500
0,3750 % Vonovia MTN MC 2021/2027	DE000A3E5MG8	EUR	0	700
0,5000 % Dt. Pfandbriefbank Hyp-Pfe. 2016/2023	DE000A13SWC0	EUR	0	1.000
0,6250 % BMW Finance MTN 2019/2023	XS1948612905	EUR	0	500
0,6250 % Iceland (Republic of) MTN 2020/2026	XS2182399274	EUR	0	300
0,6250 % Mercedes-Benz International Finance MTN 2019/2023	DE000A2RYD83	EUR	0	500
0,6250 % RLB Steiermark Pfe. 2016/2023	AT000B092622	EUR	0	2.200
1,2500 % Vonovia Finance MTN 2016/2024	DE000A189ZX0	EUR	0	200
1,4500 % Italy 2017/2024	IT0005282527	EUR	0	1.000

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	EUR			3.535
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte	EUR			83.913
(Basiswert(e): BOBL, BUND, SCHATZANW.)				

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

	EUR	EUR
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller (netto)		20.568,13
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		3.391,13
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		190.828,80
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		202.150,01
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		9.608,92
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-3.817,14
7. Sonstige Erträge		579,08
davon CSDR Penalties	579,08	
Summe der Erträge		423.308,93
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-133,44
2. Verwaltungsvergütung		-24.128,96
3. Beratervergütung		56.884,50
4. Managementgebühr		-158.815,70
5. Verwahrstellenvergütung		-8.807,94
6. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-4.659,62
7. Sonstige Aufwendungen		-23.715,78
davon Depotgebühren	-23.715,78	
Summe der Aufwendungen		-163.376,94
III. Ordentlicher Nettoertrag		259.931,99
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne		1.382.727,19
2. Realisierte Verluste		-1.793.168,56
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-410.441,37
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-150.509,38
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-1.215.320,28
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.650.541,97
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.435.221,69
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.284.712,31

Entwicklung des Sondervermögens

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		146.486.388,33
1. Ausschüttung für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttungen		-482.707,50
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		926.864,44
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinkäufen	941.989,24	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	-15.124,80	
4. Ertragsausgleich / Aufwandsausgleich		1.130,85
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		1.284.712,31
davon nicht realisierte Gewinne	-1.215.320,28	
davon nicht realisierte Verluste	2.650.541,97	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		148.216.388,43

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

CACEIS Bank S.A., Germany Branch
Lilienthalallee 36
80939 München
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

Lampe Asset Management GmbH
Schwannstraße 10
40476 Düsseldorf
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