

Halbjahresbericht

1. April 2024 bis 30. September 2024

Ampega Credit Opportunities Rentenfonds

OGAW-Sondervermögen

ampega.

Talanx Investment Group

Vermögensübersicht zum 30.09.2024

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	49.819.311,90	85,59
Belgien	1.801.820,00	3,10
Deutschland	6.693.379,00	11,50
Finnland	1.647.872,00	2,83
Frankreich	7.630.267,72	13,11
Großbritannien	5.617.467,50	9,65
Italien	1.942.778,00	3,34
Japan	1.080.760,00	1,86
Kaimaninseln	484.860,00	0,83
Luxemburg	2.292.048,00	3,94
Niederlande	8.392.298,00	14,42
Norwegen	812.072,00	1,40
Portugal	608.652,00	1,05
Schweden	853.456,00	1,47
Spanien	500.735,00	0,86
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	6.746.416,68	11,59
Österreich	2.714.430,00	4,66
Asset Backed Securities	7.559.182,10	12,99
Irland	7.559.182,10	12,99
Derivate	-155.584,78	-0,27
Zins-Derivate	23.955,00	0,04
Swaps	-179.539,78	-0,31
Sonstige Vermögensgegenstände	1.155.731,09	1,99
Verbindlichkeiten	-170.341,17	-0,29
Fondsvermögen	58.208.299,14	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	48.843.054,91	83,91
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	48.843.054,91	83,91
0,0500 % Aareal Bank MTN 2021/2026	DE000AAR0298		EUR	1.200	0	0 %	93,6940	1.124.328,00	1,93
0,2500 % Aareal Bank 2020/2027	DE000A289LU4		EUR	500	0	0 %	90,7380	453.690,00	0,78
0,5000 % De Volksbank MTN (covered) 2019/2026	XS1943455185		EUR	300	0	0 %	97,2930	291.879,00	0,50
0,5000 % Hamburg Commercial Bank MTN fix-to-float 2021/2026	DE000HCB0A86		EUR	600	0	0 %	96,7900	580.740,00	1,00
1,3750 % Evonik Industries fix-to-float (sub.) 2021/2081	DE000A3E5WW4		EUR	300	0	0 %	94,3630	283.089,00	0,49
1,3750 % Nationwide Building Society (covered) 2017/2032	XS1638816089		EUR	500	500	0 %	90,5830	452.915,00	0,78
1,4500 % Philip Morris Int. MC 2019/2039	XS2035474555		EUR	1.800	0	0 %	70,3180	1.265.724,00	2,17
1,5000 % Ball MC 2019/2027	XS2080318053		EUR	700	0	300 %	96,4570	675.199,00	1,16
1,6500 % Capital One Financial 2019/2029	XS2010331440		EUR	1.600	0	200 %	92,6760	1.482.816,00	2,55
2,6250 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2294155739		EUR	200	0	0 %	86,0600	172.120,00	0,30

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,6250 % RCI Banque fix-to-float (sub.) 2019/2030	FR0013459765		EUR	500	0	0 %	99,1870	495.935,00	0,85
2,8750 % Ziggo Secured Finance S.REGS MC 2019/2030	XS2069016165		EUR	600	600	0 %	92,5520	555.312,00	0,95
3,0000 % Arkea Home SFH 2022/2028	FR001400CZO3		EUR	600	600	0 %	101,6940	610.164,00	1,05
3,0000 % Sparebanken 1 Boligkreditt MTN 2024/2034	XS2820463003		EUR	800	800	0 %	101,5090	812.072,00	1,40
3,0000 % Vodafone Group S.NC10 fix-to-float (sub.) 2020/2080	XS2225204010		EUR	300	0	0 %	93,4250	280.275,00	0,48
3,0000 % ZF Europe Finance MC 2019/2029	XS2010039894		EUR	100	0	0 %	89,8000	89.800,00	0,15
3,1250 % La Poste PERP Multi Reset Notes (subord.) 2018/2199	FR0013331949		EUR	1.600	200	0 %	98,5480	1.576.768,00	2,71
3,2500 % Banco Santander MTN fix-to-float 2024/2029	XS2908735504		EUR	500	500	0 %	100,1470	500.735,00	0,86
3,2500 % Comcast MC 2024/2032	XS2909746310		EUR	200	200	0 %	100,5210	201.042,00	0,35
3,2500 % Mercedes Benz International Finance MTN 2024/2032	DE000A3LSYH6		EUR	500	500	0 %	100,1020	500.510,00	0,86
3,2500 % Vmed O2 UK Financing I PLC MC 2020/2031	XS2231188876		EUR	200	0	0 %	92,6160	185.232,00	0,32
3,3750 % Banco BPM MTN 2024/2030	IT0005580771		EUR	500	500	0 %	102,4480	512.240,00	0,88
3,3750 % SoftBank Group 2021/2029	XS2361255057		EUR	300	0	0 %	93,9270	281.781,00	0,48
3,5000 % Hamburg Commercial Bank 2024/2028	DE000HCB0B69		EUR	500	500	0 %	100,2540	501.270,00	0,86
3,5000 % International Game Technology MC 2019/2026	XS2009038113		EUR	850	0	0 %	99,8090	848.376,50	1,46
3,5000 % Telenet Finance Luxembourg MC 2017/2028	BE6300371273		EUR	500	0	800 %	98,5090	492.545,00	0,85
3,6250 % Darling Global Finance MC 2018/2026	XS1813579593		EUR	1.200	0	0 %	99,7260	1.196.712,00	2,06
3,6250 % Iren MTN MC 2024/2033	XS2906211946		EUR	200	200	0 %	99,9000	199.800,00	0,34
3,6250 % UPCB Finance VII MC 2017/2029	XS1634252628		EUR	500	500	0 %	96,9720	484.860,00	0,83
3,7500 % BAT S.NC8 PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2391790610		EUR	800	800	0 %	95,8550	766.840,00	1,32
3,8750 % Belden MC (subordinated) 2018/2028	XS1789515134		EUR	600	0	700 %	99,1850	595.110,00	1,02
3,8750 % Volkswagen Int. Fin. S.. PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2187689380		EUR	200	0	200 %	93,4400	186.880,00	0,32
4,0000 % SoftBank Group MC 2017/2029	XS1684385591		EUR	300	0	0 %	96,5830	289.749,00	0,50
4,2500 % Huhtamaki MC 2022/2027	FI4000523550		EUR	1.000	0	0 %	101,6270	1.016.270,00	1,75
4,2500 % ITV MTN MC 2024/2032	XS2838391170		EUR	500	500	0 %	102,0690	510.345,00	0,88
4,2500 % KBC Groep PERP fix-to-float (sub.) 2018/2199	BE0002592708		EUR	800	800	0 %	99,5250	796.200,00	1,37
4,3020 % Warner Media Holdings MC 2024/2030	XS2821805533		EUR	400	400	0 %	100,7830	403.132,00	0,69
4,5000 % Hessische Landesbank MTN fix-to-float (sub.) 2022/2032	XS2489772991		EUR	1.000	300	300 %	99,7390	997.390,00	1,71
4,5000 % Schaeffler MTN MC 2024/2030	DE000A383HC1		EUR	1.100	0	0 %	99,0560	1.089.616,00	1,87
4,5960 % Generali Finance PERP fix-to-float (subordinated) 2014/2199	XS1140860534		EUR	500	500	0 %	100,5330	502.665,00	0,86

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,6250 % Electricite de France MTN MC 2023/2043	FR001400FDC8		EUR	400	400	0 %	104,1790	416.716,00	0,72
4,6250 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float 2024/2029	XS2765027193		EUR	1.000	400	0 %	102,8720	1.028.720,00	1,77
4,6250 % TenneT Holding PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2783604742		EUR	700	0	0 %	101,2940	709.058,00	1,22
4,6930 % Warner Media Holdings MC 2024/2033	XS2721621154		EUR	1.276	1.276	0 %	100,2430	1.279.100,68	2,20
4,7500 % Electricite de France MTN MC 2024/2044	FR001400QR88		EUR	500	500	0 %	105,1710	525.855,00	0,90
4,8750 % CNP Assurances MTN MC (sub.) 2024/2054	FR001400RIX8		EUR	400	400	0 %	103,6870	414.748,00	0,71
4,8750 % Societe Generale fix-to-float 2023/2031	FR001400M6F5		EUR	800	900	100 %	105,7390	845.912,00	1,45
5,0000 % A2A SpA PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2830327446		EUR	500	500	0 %	101,9560	509.780,00	0,88
5,1250 % British Telecom MTN fix-to-float (sub.) 2024/2054	XS2794589403		EUR	500	0	0 %	102,8120	514.060,00	0,88
5,1250 % Huhtamaki MC 2023/2028	FI4000562202		EUR	600	0	0 %	105,2670	631.602,00	1,09
5,2500 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float (sub.) 2024/2035	XS2904849879		EUR	500	500	0 %	100,5240	502.620,00	0,86
5,3750 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2013/2199	FR0011401751		EUR	300	0	0 %	100,3700	301.110,00	0,52
5,3750 % Webuild 2024/2029	XS2830945452		EUR	700	1.000	300 %	102,9940	720.958,00	1,24
5,5000 % Bayer fix-to-float (sub.) 2024/2054	XS2900282133		EUR	400	400	0 %	100,1520	400.608,00	0,69
5,5000 % RCI Banque MTN fix-to-float (sub.) 2024/2034	FR001400QY14		EUR	500	500	0 %	102,3620	511.810,00	0,88
5,5000 % SES S.* fix-to-float (sub.) 2024/2054	XS2898762864		EUR	300	300	0 %	94,6930	284.079,00	0,49
5,6250 % Vmed O2 UK Financing I S.REGS MC 2024/2032	XS2796600307		EUR	1.300	0	0 %	101,2450	1.316.185,00	2,26
5,7500 % SoftBank Group 2024/2032	XS2854423469		EUR	500	500	0 %	101,8460	509.230,00	0,87
5,9930 % Veolia Environnement PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	FR001400KKC3		EUR	700	400	0 %	106,4910	745.437,00	1,28
6,0000 % SES fix-to-float (sub.) 2024/2054	XS2899636935		EUR	800	800	0 %	94,2260	753.808,00	1,30
6,1250 % ZF Europe Finance MTN MC 2023/2029	XS2681541327		EUR	1.200	300	0 %	102,4130	1.228.956,00	2,11
6,2500 % KBC Groep PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	BE0390152180		EUR	1.000	1.000	0 %	100,5620	1.005.620,00	1,73
6,3750 % ABN AMRO Bank PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2893176862		EUR	400	400	0 %	101,6950	406.780,00	0,70
6,6250 % Bayer S.NC5 fix-to-float (sub.) 2023/2083	XS2684826014		EUR	200	0	0 %	104,2520	208.504,00	0,36
6,7500 % Telefonica Europe S.. PERP fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2646608401		EUR	500	0	0 %	110,4350	552.175,00	0,95
6,8750 % ABN AMRO Bank PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2774944008		EUR	300	0	0 %	104,6050	313.815,00	0,54
7,0850 % SCULE 6X DR 2021/2034	XS2369735225		EUR	1.000	0	0 %	100,0423	1.000.423,45	1,72
7,2500 % Forvia MC 2022/2026	XS2553825949		EUR	146	0	304 %	103,6320	151.302,72	0,26
7,3850 % DRYD 2016-46X DRR 2021/2034	XS2318620486		EUR	1.000	0	0 %	100,1403	1.001.402,63	1,72
7,7500 % Fidelidade - Cia de Seg PERP. fix-to-float (sub.) 2024/2199	PTFIDAOM0000		EUR	600	600	0 %	101,4420	608.652,00	1,05

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
8,1250 % Deutsche Bank PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	DE000A383J53		EUR	600	600	0 %	104,2960	625.776,00	1,08
10,3940 % GLME 7X E 2024/2037	XS2827790481		EUR	1.000	1.000	0 %	101,1216	1.011.215,96	1,74
10,6050 % HAYEM 10X ER 2024/2038	XS2813168262		EUR	500	500	0 %	100,9833	504.916,61	0,87
10,6250 % JUBIL 2022-26X ER 2024/2038	XS2762951957		EUR	1.000	0	0 %	101,2631	1.012.630,88	1,74
10,7160 % PENTA 2024-16X E 2024/2036	XS2760076450		EUR	1.000	0	0 %	101,0318	1.010.317,85	1,74
10,8660 % TIKEH 10X E 2024/2038	XS2777379228		EUR	1.000	0	0 %	101,7044	1.017.043,63	1,75
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	8.535.439,09	14,66
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	8.535.439,09	14,66
2,2500 % Quintiles IMS Health S.REGS MC 2021/2029	XS2305744059		EUR	300	0	300 %	93,7270	281.181,00	0,48
2,6250 % Graphic Packaging International MC 2021/2029	XS2407520936		EUR	600	0	0 %	93,8520	563.112,00	0,97
2,8750 % SES PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2010028343		EUR	800	0	300 %	95,2020	761.616,00	1,31
3,0000 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2357357768		EUR	800	0	0 %	85,1670	681.336,00	1,17
3,6250 % Sappi Papier Holding S.REGS MC 2021/2028	XS2310951103		EUR	1.100	0	0 %	97,8980	1.076.878,00	1,85
4,5000 % Crown European Holdings S.REGS MC 2024/2030	XS2872799734		EUR	500	500	0 %	102,4730	512.365,00	0,88
4,7500 % Dufry One MC 2024/2031	XS2802883731		EUR	1.200	1.200	0 %	103,2950	1.239.540,00	2,13
4,8750 % Phoenix PIB Dutch Finance MC 2024/2029	XS2856820704		EUR	600	600	0 %	103,0360	618.216,00	1,06
5,0000 % Crown European Holdings MC 2023/2028	XS2623222978		EUR	500	0	650 %	104,4290	522.145,00	0,90
6,0000 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float 2023/2028	XS2682093526		EUR	100	0	0 %	106,2120	106.212,00	0,18
7,0000 % Bayer fix-to-float (sub.) 2023/2083	XS2684846806		EUR	400	0	0 %	107,0920	428.368,00	0,74
7,0880 % GLME 3X DR 2021/2032	XS2377775650		EUR	500	0	0 %	100,0442	500.221,12	0,86
7,2920 % BLACK 2019-1X DR 2021/2032	XS2390848427		EUR	500	0	0 %	100,2020	501.009,97	0,86
8,5000 % INEOS Quattro Finance 2 S.REGS MC 2023/2029	XS2719090636		EUR	700	0	0 %	106,1770	743.239,00	1,28
Summe Wertpapiervermögen								57.378.494,00	98,57
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	-155.584,78	-0,27
Zins-Derivate							EUR	23.955,00	0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte							EUR	23.955,00	0,04
Euro-Bund Future Dezember 2024		EUREX	STK	-38				-21.090,00	-0,04
Euro-Schatz Future Dezember 2024		EUREX	STK	117				45.045,00	0,08
Swaps							EUR	-179.539,78	-0,31
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Credit Default Swaps							EUR	-179.539,78	-0,31
Protection Seller									
Airbus MTN MC / 100 BP (CGME) 13.1.23-20.12.29		OTC	EUR	-1.000				27.124,17	0,05
BNP Paribas S.A. / 100 BP (BACRSEC) 27.6.24-20.6.29		OTC	EUR	-500				289,74	0,00
Barclays Bank MTN / 100 BP (JPM-AG) 12.6.23-20.6.28		OTC	EUR	-500				8.819,51	0,02

Vermögensaufstellung zum 30.09.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
CNH Industrial Finan. Europe MTN / 500 BP (BACRSEC) 1.3.23-20.12.29		OTC	EUR	-1.000				192.034,23	0,33
Cellnex Telecom MTN MC / 500 BP (DB) 7.3.24-20.12.30		OTC	EUR	-1.000				226.072,33	0,39
Iberdrola Int. MTN / 100 BP (BOASEC) 28.9.21-20.6.28		OTC	EUR	-500				12.718,46	0,02
Intesa Sanpaolo MTN / 100 BP (BACRSEC) 20.6.23-20.6.26		OTC	EUR	-500				5.347,30	0,01
SES MTN MC / 100 BP (JPM-AG) 18.6.24-20.6.31		OTC	EUR	-1.000				-73.009,32	-0,13
SYENSQO MC / 100 BP (JPM-AG) 10.5.23-20.6.30		OTC	EUR	-1.000				10.715,60	0,02
Stellantis MC / 500 BP (DB) 27.3.24-20.6.31		OTC	EUR	-1.000				177.976,60	0,31
Protection Buyer									
Bouygues MC / 100 BP (JPM-AG) 27.8.24-20.6.29		OTC	EUR	5.000				-153.988,56	-0,26
ITRAXX EUROPE CROSSO- VER SERIES 41 VERSION 1 / 500 BP (DB) 16.8.24-20.6.29		OTC	EUR	1.000				-95.196,98	-0,16
ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 VERSION 1 / 500 BP (JPM-AG) 27.8.24-20.6.29		OTC	EUR	1.000				-95.196,98	-0,16
ITRAXX EUROPE SERIES 41 VERSION 1 / 100 BP (BNP) 16.8.24-20.6.29		OTC	EUR	4.000				-87.716,80	-0,15
Philips (Konin.) MC / XX BP (BOASEC) 22.8.24-20.6.29		OTC	EUR	5.000				-154.077,43	-0,26
Unilever MTN (Finance) / XX BP (DB) 27.8.24-20.6.29		OTC	EUR	5.000				-181.451,65	-0,31
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.155.731,09	1,99
Ansprüche aus Cre- dit Default Swaps			EUR					6.111,14	0,01
Cash Collateral			EUR					210.000,00	0,36
Zinsansprüche			EUR					939.619,95	1,61
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-131.241,22	-0,23
EUR - Kredite							EUR	-131.241,22	-0,23
Verwahrstelle			EUR	-131.241,22				-131.241,22	-0,23
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾							EUR	-39.099,95	-0,07
Fondsvermögen							EUR	58.208.299,14	100,00²⁾
Anteilwert Klasse P (a)							EUR	99,64	
Anteilwert Klasse I (a)							EUR	99,16	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)							STK	214.114,694	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)							STK	371.857,219	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)							EUR	21.335.159,69	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)							EUR	36.873.139,45	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									98,57
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									-0,27

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung und Verbindlichkeiten aus Credit Default Swaps

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. September 2024 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 87,32 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 12,68 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Marktschlüssel**Terminbörsen**

EUREX European Exchange Deutschland

OTC Over-the-Counter

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**Die Vermögensgegenstände sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:**

Alle Vermögenswerte per 27.09.2024 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				
0,0100 % The Bank of Nova Scotia 2021/2027	XS2421186268	EUR	0	600
0,1250 % De Volksbank MTN 2020/2040	XS2259193998	EUR	0	1.000
0,7500 % TRATON Finance Luxembourg MTN MC 2021/2029	DE000A3KNP96	EUR	500	500
1,5000 % Cellnex Finance MTN MC 2021/2028	XS2348237871	EUR	0	200
1,7500 % Imperial Brands Finance MC 2021/2033	XS2320459063	EUR	0	800
1,8750 % Cellnex Telecom MC 2020/2029	XS2193658619	EUR	0	700
2,2500 % INEOS Styrolution Group MC 2020/2027	XS2108560306	EUR	0	300
2,3470 % Nat. Australia Bank (covered) 2022/2029	XS2526882001	EUR	0	500
2,3750 % Bayer fix-to-float (subord.) 2019/2079	XS2077670003	EUR	0	400
2,3760 % Telefonica Europe PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2293060658	EUR	0	300
2,5000 % Standard Chartered Bank fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2183818637	EUR	300	300
2,8750 % Elis MTN MC 2018/2026	FR0013318102	EUR	0	600
2,8750 % SoftBank Group 2021/2027	XS2361254597	EUR	0	300
2,9950 % TenneT Holding PERP fix-to-float (sub.) 2017/2024	XS1591694481	EUR	0	1.000
3,0000 % BAT 5.5.25 PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2391779134	EUR	800	800
3,0000 % Credit Agricole Home Loan SFH 2024/2032	FR001400PBM0	EUR	5.000	5.000
3,1250 % Altria Group MC 2019/2031	XS1843443786	EUR	0	500
3,1250 % BMW International Inv. MTN 2024/2030	XS2887901598	EUR	700	700
3,1250 % Bayer fix-to-float (sub.) 2019/2079	XS2077670342	EUR	0	400
3,1250 % DnB Boligkreditt 2024/2031	XS2834475704	EUR	2.000	2.000
3,3750 % Electricite de France PERP fix-to-float (sub.) 2020/2049	FR0013534336	EUR	0	400
3,3750 % Naturgy Finance Iberia PERP fix-to-float (sub.) 2015/2024	XS1224710399	EUR	0	500
3,3750 % Raiffeisen Bank Int. MTN 2023/2027	XS2626022656	EUR	0	600

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
3,3750 % Saint Gobain MTN MC 2024/2030	XS2796609787	EUR	500	500
3,5000 % SES MTN MC 2022/2029	XS2489775580	EUR	400	700
3,5750 % Natwest Group MTN fix-to-float 2024/2032	XS2898838516	EUR	800	800
3,6250 % Carrefour MTN MC 2024/2032	FR001400SID8	EUR	600	600
3,6250 % Saint Gobain MTN MC 2024/2036	XS2874381333	EUR	300	300
3,7500 % Mondi Finance MTN MC 2024/2032	XS2826812005	EUR	500	500
3,7500 % Philips (Konin.) MTN MC 2024/2032	XS2826712551	EUR	1.300	1.300
3,8280 % Becton Dickinson MC 2024/2032	XS2839004368	EUR	300	300
3,8500 % Intesa Sanpaolo MTN fix-to-float 2024/2032	IT0005611550	EUR	300	300
3,8500 % T-Mobile USA 2024/2036	XS2746663074	EUR	600	600
3,8750 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float 2024/2030	XS2893858352	EUR	300	300
3,8750 % Volkswagen Fin. Serv. 2024/2030	XS2837886287	EUR	400	400
4,0000 % Deutsche Bank MTN fix-to-float 2024/2028	DE000A383J95	EUR	300	300
4,0000 % General Motors Financial MTN MC 2024/2030	XS2816031160	EUR	500	500
4,1250 % A.P. Moeller-Maersk MTN MC 2024/2036	XS2776891207	EUR	0	200
4,1250 % Deutsche Bank MTN fix-to-float 2024/2030	DE000A3829D0	EUR	0	900
4,1250 % Electricite de France MTN 2024/2031	FR001400QR62	EUR	400	400
4,1250 % Elis MTN MC 2022/2027	FR001400AK26	EUR	0	500
4,1250 % LKQ Dutch Bond MC 2024/2031	XS2777367645	EUR	0	300
4,1500 % Medtronic MC 2024/2043	XS2834367992	EUR	500	500
4,1500 % Medtronic MC 2024/2053	XS2834368453	EUR	800	800
4,1650 % Ford Motor Credit 2024/2028	XS2822575648	EUR	400	400
4,2500 % Fidelidade Companhia de Seguros fix-to-float (sub.) 2021/2031	PTFIDBOM0009	EUR	200	700
4,2500 % Münchener Rückvers. fix-to-float (sub.) 2024/2044	XS2817890077	EUR	800	800
4,3750 % ABN AMRO Bank MTN MC (sub.) 2024/2036	XS2859413341	EUR	300	300
4,4450 % Ford Motor Credit MTN 2024/2030	XS2767246908	EUR	0	300
4,5000 % DS Smith MTN MC 2023/2030	XS2654098222	EUR	0	1.000
4,5000 % Deutsche Bank fix to float 2024/2035	DE000A383KA9	EUR	600	600
4,5000 % Raiffeisen Bank Int. MTN fix-to-float 2024/2030	XS2826609971	EUR	500	500
4,5990 % HSBC Holdings fix-to-float (sub.) 2024/2035	XS2788605660	EUR	0	200
4,7500 % Hamburg Commercial Bank MTN 2024/2029	DE000HCB0B36	EUR	400	400
4,7500 % Imerys MTN MC 2023/2029	FR001400M998	EUR	0	1.100
4,8000 % Arkema MTN PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	FR001400ORA4	EUR	0	400
4,8750 % TenneT Holding PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2783649176	EUR	0	600
4,9730 % Barclays MTN fix-to-float (sub.) 2024/2036	XS2831195644	EUR	300	300
5,0000 % SoftBank Group MC 2018/2028	XS1793255941	EUR	0	550
5,1250 % Ford Motor Credit MTN 2023/2029	XS2724457457	EUR	0	700
5,1250 % ORSTED fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2778385240	EUR	0	300
5,2500 % Imperial Brands Finance Netherlands MTN MC 2023/2031	XS2586739729	EUR	0	800
5,2500 % ORSTED fix-to-float (sub.) (1000Y) 2022/2199	XS2563353361	EUR	0	800
5,3370 % Celanese US Holdings MC 2022/2029	XS2497520887	EUR	0	800
5,3750 % Iliad MC 2024/2031	FR001400PRQ7	EUR	700	700
5,3750 % SoftBank Group 2024/2029	XS2854423386	EUR	400	400
5,3750 % Telefon-AB LM Ericsson MTN MC 2023/2028	XS2725836410	EUR	0	400
5,7520 % Telefonica Europe PERP fix-to-float (sub.) 2024/2199	XS2755535577	EUR	0	400
7,0000 % Bayerische Landesbank fix-to-float (sub.) 2023/2034	XS2696902837	EUR	0	800
7,0000 % Webuild MC 2023/2028	XS2681940297	EUR	0	1.000
7,0350 % Aegon MTN fix-to-float (subord.) 2014/2044	XS1061711575	EUR	0	500
7,8750 % Volkswagen Int. Fin. fix-to-float (sub.) 2023/2199	XS2675884733	EUR	0	700
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
2,3750 % Phoenix PIB Dutch Finance MC 2020/2025	XS2212959352	EUR	0	1.000
3,4600 % Mizuho Financial Group MTN fix-to-float 2024/2030	XS2886269013	EUR	300	300

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
3,6250 % JT Intl. Fin. Services MTN MC 2024/2034	XS2793255162	EUR	500	500
3,7000 % T-Mobile USA 2024/2032	XS2746662936	EUR	500	500
4,2500 % Molnlycke Holding MTN MC 2024/2034	XS2834462983	EUR	400	400
6,2500 % OI European Group S.REGS MC 2023/2028	XS2624554320	EUR	0	300

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)

Swaps

Credit Default Swaps

Gekaufte Kontrakte	EUR	8.000
(Basiswert(e): ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 41 VERSION 1 / 500 BP (JPM-AG) 8.5.24-20.6.29, Mercedes-Benz Gruppe MTN / 100 BP (BACRSEC) 12.4.24-20.6.29, Mercedes-Benz Gruppe MTN / XX BP (BACRSEC) 18.6.24-20.6.29)		

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte	EUR	18.988
(Basiswert(e): BUND, SCHATZANW.)		
Verkaufte Kontrakte	EUR	4.159
(Basiswert(e): BUND)		

Köln, im Oktober 2024

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

Überreicht durch:

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