

Halbjahresbericht

FS Colibri Event Driven Bonds

1. November 2022 bis 30. April 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.04.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Verzinsliche Wertpapiere	48.032.970,27	96,55
Australien	704.603,12	1,42
Belgien	1.394.697,50	2,80
Deutschland	5.113.786,82	10,28
Finnland	1.346.379,50	2,71
Frankreich	7.168.020,94	14,41
Griechenland	526.578,00	1,06
Großbritannien	6.808.690,26	13,69
Irland	1.294.111,00	2,60
Italien	3.868.586,00	7,78
Luxemburg	2.556.894,00	5,14
Niederlande	7.758.877,00	15,60
Portugal	2.794.909,30	5,62
Schweden	861.228,00	1,73
Schweiz	1.132.858,83	2,28
Österreich	4.702.750,00	9,45
Derivate	101.351,82	0,20
Devisen-Derivate	101.351,82	0,20
Bankguthaben	451.982,24	0,91
Sonstige Vermögensgegenstände	1.192.721,41	2,40
Verbindlichkeiten	-29.744,17	-0,06
Fondsvermögen	49.749.281,57	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	35.029.820,75	70,41
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	35.029.820,75	70,41
0,0000 % Novo Banco (Luxembourg Branch) MTN 2014/2048	XS1053939978		EUR	900	900	0 %	27,4190	246.771,00	0,50
0,0000 % Novo Banco Luxembourg MTN 2014/2052	XS1055501974		EUR	1.600	1.600	0 %	22,4810	359.696,00	0,72
0,0000 % Novo Banco MTN 2014/2049	XS1031115014		EUR	350	350	0 %	27,7070	96.974,50	0,19
0,8750 % Vonovia Finance MTN MC 2018/2023	DE000A192ZH7		EUR	1.000	1.000	0 %	99,4450	994.450,00	2,00
1,3750 % Global Switch Finance MTN MC 2020/2030	XS2241825111		EUR	2.300	1.600	0 %	84,4150	1.941.545,00	3,90
1,7500 % Infrastructure Wireless Italiane MTN MC 2021/2031	XS2332687040		EUR	1.600	1.600	0 %	85,6630	1.370.608,00	2,76
2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield PERP fix-to-float (sub.) 2018/2199	FR0013330529		EUR	1.300	1.300	0 %	88,4280	1.149.564,00	2,31
2,4890 % Aegon FRN PERP (sub.) 2004/2199	NL0000116150		EUR	800	400	0 %	79,2760	634.208,00	1,27
2,7080 % Total MTN PERP Multi Reset Notes (subord.) 2016/2023	XS1501167164		EUR	600	600	0 %	99,9140	599.484,00	1,21
3,1000 % Vodafone Group fix-to-float (sub.) 2018/2079	XS1888179477		EUR	1.450	1.450	0 %	98,8350	1.433.107,50	2,88
3,6670 % Barclays Bank PERP fix-to-float (subordinated) 2005/2199	XS0214398199		EUR	1.000	600	0 %	83,2770	832.770,00	1,67

Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
4,2500 % Alpha Services and Hold MTN fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2111230285		EUR	650	300	0 %	81,0120	526.578,00	1,06
4,2500 % Aquarius & Investment fix-to-float (subordinated) 2013/2043	XS0897406814		EUR	1.300	800	0 %	99,5470	1.294.111,00	2,60
4,2500 % Finnair MC 2021/2025	FI4000507132		EUR	350	450	100 %	90,2130	315.745,50	0,63
4,3750 % Transportes Aereos Portugueses SA 2019/2023	PTTAPBOM0007		EUR	430	80	0 %	99,2260	426.671,80	0,86
4,4980 % Casino Guichard-Perrachon MTN -rating sensitive- 2014/2024	FR0011765825		EUR	2.100	1.900	0 %	30,0870	631.827,00	1,27
4,5000 % Lanxess Multi Reset Notes (subordinated) 2016/2023	XS1405763019		EUR	600	600	0 %	99,8580	599.148,00	1,20
5,1250 % AXA fix-to-float (subord.) 2013/2043	XS0878743623		EUR	1.000	550	0 %	100,1010	1.001.010,00	2,01
5,1250 % Volkswagen Int. Fin. PERP fix-to-float (sub.) 2013/2199	XS0968913342		EUR	1.000	700	0 %	100,0630	1.000.630,00	2,01
5,2500 % Intralot Capital Luxembourg MC 2017/2024	XS1685702794		EUR	1.500	1.050	0 %	94,1540	1.412.310,00	2,84
5,3750 % Porr PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2113662063		EUR	1.400	900	0 %	89,4380	1.252.132,00	2,52
5,7500 % Engie Alliance GIE MTN 2003/2023	FR0000475758		EUR	2.000	2.000	0 %	100,2930	2.005.860,00	4,03
5,7500 % Sigma Holdco MC 2018/2026	XS1813504666		EUR	1.700	1.700	0 %	79,8860	1.358.062,00	2,73
6,0000 % NIBC Bank PERP fix-to-float (sub.) 2017/2199	XS1691468026		EUR	600	400	0 %	76,2930	457.758,00	0,92
6,0000 % Raiffeisen Bank Int. MTN (subord.) 2013/2023	XS0981632804		EUR	1.000	700	0 %	99,1250	991.250,00	1,99
6,1250 % Aviva fix-to-float (subordinated) 2013/2043	XS0951553592		EUR	1.000	1.000	0 %	100,1820	1.001.820,00	2,01
6,6250 % UniCredit PERP fix-to-float (sub.) 2017/2199	XS1619015719		EUR	1.300	900	0 %	100,1980	1.302.574,00	2,62
7,3210 % Aareal Bank PERP fix-to-float (sub.) 2014/2199	DE000A1TNDK2		EUR	1.400	1.000	0 %	78,5940	1.100.316,00	2,21
7,5000 % Nidda Healthcare S.REGS MC 2022/2026	XS2550063478		EUR	550	550	0 %	97,4930	536.211,50	1,08
7,6760 % Banca Monte d'Paschi Siena fix-to-float (Sub.) 2018/2028	XS1752894292		EUR	1.400	950	0 %	85,3860	1.195.404,00	2,40
8,5000 % Novo Banco Fix-to-Float (sub.) 2018/2028	PTNOBFOM0017		EUR	700	200	0 %	98,3980	688.786,00	1,38
8,6590 % Raiffeisen Bank Int. PERP fix-to-float (sub.) 2017/2199	XS1640667116		EUR	1.400	1.400	0 %	85,5920	1.198.288,00	2,41
9,2500 % Intrum S.REGS MC 2022/2028	XS2566291865		EUR	900	900	0 %	95,6920	861.228,00	1,73
9,7500 % Piraeus Group Finance (sub.) 2019/2029	XS2018638648		EUR	1.400	1.000	0 %	96,0590	1.344.826,00	2,70
10,2500 % Finnair PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	FI4000441860		EUR	1.100	600	0 %	93,6940	1.030.634,00	2,07
5,3967 % Westpac Banking FRN PERP (sub.) 1986/2199	GB0009573998		USD	1.000	500	0 %	77,7600	704.603,12	1,42
6,5000 % Credit Suisse (sub.) 2013/2023	XS0957135212		USD	1.300	1.300	0 %	96,1710	1.132.858,83	2,28
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	13.003.149,52	26,14
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	13.003.149,52	26,14
0,7500 % Vantage Towers MC 2021/2030	DE000A3H3J30		EUR	800	800	0 %	100,0000	800.000,00	1,61
2,2500 % DIC Asset MC 2021/2026	XS2388910270		EUR	1.200	1.200	0 %	61,4560	737.472,00	1,48
2,8750 % SES PERP fix-to-float (sub.) 2021/2199	XS2010028343		EUR	1.400	1.400	0 %	81,7560	1.144.584,00	2,30

Vermögensaufstellung zum 30.04.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
3,7500 % Saipem Finance International MTN 2016/2023	XS1487495316		EUR	800	600	0 %	99,7480	797.984,00	1,60
4,6460 % BNP Paribas Fortis Cv (subordinated) 2007/2199	BE0933899800		EUR	1.750	1.250	0 %	79,6970	1.394.697,50	2,80
5,6250 % Transportes Aereos Portugueses SA MC 2019/2024	PTTAPDOM0005		EUR	1.000	900	0 %	97,6010	976.010,00	1,96
5,7500 % Lenzing PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2250987356		EUR	1.500	1.500	0 %	84,0720	1.261.080,00	2,53
5,8750 % Quatrim MC 2019/2024	XS2010039118		EUR	686	800	114 %	84,7790	581.583,94	1,17
6,0000 % HSBC Holdings PERP fix-to-float (sub.) 2015/2199	XS1298431104		EUR	1.400	1.400	0 %	98,3340	1.376.676,00	2,77
6,0000 % Kirk Beauty Zero S.REGS MC 2021/2026	XS2326497802		EUR	1.000	1.000	0 %	89,2910	892.910,00	1,79
6,3750 % Schoeller Packaging MC 2019/2024	XS2070055095		EUR	800	800	0 %	71,7800	574.240,00	1,15
8,2500 % Kirk Beauty SUN MC 2021/2026	XS2326505240		EUR	623	419	0 %	71,8300	447.729,32	0,90
8,5000 % Vallourec MC 2021/2026	XS2352739184		EUR	1.200	1.200	0 %	99,8910	1.198.692,00	2,41
5,4851 % Barclays Bank S.TWO FRN PERP (sub.) 1986/2199	GB0000777705		USD	1.000	800	0 %	90,4390	819.490,76	1,65
Summe Wertpapiervermögen								48.032.970,27	96,55
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)						EUR		101.351,82	0,20
Devisen-Derivate						EUR		101.351,82	0,20
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Futures auf Devisen						EUR		101.351,82	0,20
EUR/USD FX Currency Future Juni 2023		CME	USD	2.875				101.351,82	0,20
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR		451.982,24	0,91
Bankguthaben						EUR		451.982,24	0,91
EUR - Guthaben bei						EUR		287.107,76	0,58
Verwahrstelle			EUR	281.872,94				281.872,94	0,57
Landesbank Baden-Württemberg			EUR	5.234,82				5.234,82	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR		164.874,48	0,33
Verwahrstelle			USD	181.955,47				164.874,48	0,33
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR		1.192.721,41	2,40
Zinsansprüche			EUR					1.192.721,41	2,40
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR		-29.744,17	-0,06
Fondsvermögen						EUR		49.749.281,57	100,00²⁾
Anteilwert Klasse I (a)						EUR		94,34	
Anteilwert Klasse S (a)						EUR		951,69	
Anteilwert Klasse X (t)						EUR		972,72	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)						STK		184.418	
Umlaufende Anteile Klasse S (a)						STK		26.336	
Umlaufende Anteile Klasse X (t)						STK		7.492	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)						EUR		17.397.934,42	
Fondsvermögen Anteilklasse S (a)						EUR		25.063.724,38	
Fondsvermögen Anteilklasse X (t)						EUR		7.287.622,77	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									96,55
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,20

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren und Verwahrstellenvergütung²⁾ 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. April 2023 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 97,49 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 2,51 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 28.04.2023

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,10360	= 1 (EUR)
----------------------------	-------	---------	-----------

Marktschlüssel**Terminbörsen**

CME	Chicago Mercantile Exchange
-----	-----------------------------

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 28.04.2023 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				
3,0000 % Fastighets AB Balder fix-to-float (subordinated) 2017/2023	XS1677911825	EUR	200	700
3,8950 % Ageasfinlux S.REGS FRN PERP (sub.) 2002/2199	XS0147484074	EUR	0	250
4,5610 % Casino Guichard-Perrachon MTN -rating sensitive-2013/2023	FR0011400571	EUR	0	200
4,8500 % Volvo Treasury Multi Reset Notes (sub.) 2014/2023	XS1150695192	EUR	100	500
5,0000 % AT&S PERP fix-to-float (sub.) 2022/2199	XS2432941693	EUR	0	200
6,0000 % Achmea fix-to-float (subordinated) 2013/2023	XS0911388675	EUR	600	1.000
6,2500 % ORSTED fix-to-float (sub.) (1000Y) 2013/3013	XS0943370543	EUR	0	600
6,8200 % Arysza Euro Finance PERP fix-to-float (sub.) 2014/2023	XS1134780557	EUR	550	1.000
6,8750 % Storebrand Livsforsikring fix-to-float (sub.) 2013/2023	XS0909773268	EUR	0	700
7,3750 % Raiffeisen Bank Int. fix-to-float (sub.) 2022/2032	XS2534786590	EUR	0	400
5,0000 % ING Groep MTN fix-to-float (subordinated) 2018/2023	XS1796077946	USD	0	400
5,0000 % UBS Group PERP fix-to-float (sub.) 2018/2023	CH0400441280	USD	0	700
5,2663 % BAC Capital Trust XIV S.G PERP (sub.) 2007/2199	US05518VAA35	USD	0	400
5,7299 % Goldman Sachs Capital II fix-to-float PERP (Sub.) 2007/2199	US381427AA15	USD	0	350
5,8636 % JP Morgan Chase & Co. S.W FRN MC (sub.) 2017/2077	US48123UAB08	USD	0	500
6,2803 % USB Capital IX FRN PERP (sub.) 2006/2199	US91731KAA88	USD	0	250
7,2500 % International Petroleum MC 2022/2027	NO0012423476	USD	0	200
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
3,5000 % Nidda Healthcare Holding MC 2017/2024	XS1690644668	EUR	0	300
3,7160 % Credit Suisse London MTN FRN 2021/2023	XS2381633150	EUR	1.200	1.200

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
6,3750 % Raffinerie Heide MC 2017/2022	XS1729059862	EUR	0	100
6,5000 % Nordex MC 2018/2023	XS1713474168	EUR	0	200

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

Futures auf Devisen

Gekaufte Kontrakte	EUR	4.281
--------------------	-----	-------

(Basiswert(e): Spot EUR gegen USD)

Köln, im Mai 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 30.04.2023)
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

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).

Anlageberater

Fidus Finanz AG
August-Schanz-Str. 30 - 32
60433 Frankfurt am Main
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