

# Halbjahresbericht

## Stiftungsfonds STS

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen





## Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Vermögensgegenstände</b>		
<b>Aktien</b>	<b>5.357.928,82</b>	<b>7,92</b>
Belgien	208.408,00	0,31
Deutschland	1.834.945,20	2,71
Finnland	57.645,00	0,09
Frankreich	1.722.842,43	2,55
Großbritannien	94.630,00	0,14
Irland	236.206,74	0,35
Italien	15.950,21	0,02
Niederlande	814.083,66	1,20
Spanien	229.284,58	0,34
Österreich	143.933,00	0,21
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>	<b>60.787.117,50</b>	<b>89,81</b>
Belgien	1.793.061,00	2,65
Deutschland	19.981.506,00	29,52
Dänemark	88.519,00	0,13
Europäische Institutionen	3.779.143,00	5,58
Finnland	1.658.503,00	2,45
Frankreich	21.503.955,00	31,77
Großbritannien	492.605,00	0,73
Italien	4.392.250,00	6,49
Luxemburg	385.138,00	0,57
Niederlande	1.132.708,00	1,67
Schweden	4.062.693,50	6,00
Spanien	662.176,00	0,98
Österreich	854.860,00	1,26
<b>Derivate</b>	<b>221.900,00</b>	<b>0,33</b>
Aktienindex-Derivate	-8.175,00	-0,01
Zins-Derivate	230.075,00	0,34
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.240.542,23</b>	<b>1,83</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>162.903,54</b>	<b>0,24</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>	<b>-82.791,34</b>	<b>-0,12</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>67.687.600,75</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Vermögensgegenstände</b>									
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>63.371.774,32</b>	<b>93,62</b>
<b>Aktien</b>								<b>5.357.928,82</b>	<b>7,92</b>
<b>Belgien</b>								<b>208.408,00</b>	<b>0,31</b>
Anheuser-Busch InBev NV	BE0974293251		STK	3.000	0	0	EUR 51,0700	153.210,00	0,23
Umicore SA	BE0974320526		STK	2.200	470	0	EUR 25,0900	55.198,00	0,08
<b>Deutschland</b>								<b>1.834.945,20</b>	<b>2,71</b>
Adidas AG	DE000A1EWWW0		STK	325	0	0	EUR 173,5200	56.394,00	0,08
Allianz SE	DE0008404005		STK	700	350	0	EUR 211,0500	147.735,00	0,22
Carl Zeiss Meditec AG	DE0005313704		STK	800	150	0	EUR 96,6600	77.328,00	0,11
Deutsche Post AG	DE0005552004		STK	7.000	1.200	0	EUR 44,1950	309.365,00	0,46
Deutsche Telekom AG	DE0005557508		STK	9.000	0	1.405	EUR 19,9300	179.370,00	0,26
Infineon Technologies AG	DE0006231004		STK	4.800	0	0	EUR 36,6350	175.848,00	0,26
Merck KGaA	DE0006599905		STK	500	0	0	EUR 149,6000	74.800,00	0,11
SAP SE	DE0007164600		STK	1.500	0	0	EUR 123,3800	185.070,00	0,27

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
Sartorius AG Vz.	DE0007165631		STK	169	0	0	EUR 303,7000	51.325,30	0,08
Siemens AG	DE0007236101		STK	1.405	0	0	EUR 150,5800	211.564,90	0,31
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0		STK	6.500	0	0	EUR 15,7000	102.050,00	0,15
Siemens Healthineers AG	DE000SHL1006		STK	1.500	0	0	EUR 50,5800	75.870,00	0,11
Telefonica Deutschland Holding AG	DE000A1J5RX9		STK	25.000	0	0	EUR 2,5810	64.525,00	0,10
Wacker Chemie AG	DE000WCH8881		STK	1.000	0	0	EUR 123,7000	123.700,00	0,18
<b>Finland</b>							<b>EUR</b>	<b>57.645,00</b>	<b>0,09</b>
Nokia Corp.	FI0009000681		STK	15.000	0	0	EUR 3,8430	57.645,00	0,09
<b>Frankreich</b>							<b>EUR</b>	<b>1.722.842,43</b>	<b>2,55</b>
Accor SA	FR0000120404		STK	3.512	0	0	EUR 33,8200	118.775,84	0,18
Alstom SA	FR0010220475		STK	3.447	0	0	EUR 27,3300	94.206,51	0,14
BNP Paribas SA	FR0000131104		STK	2.500	0	0	EUR 56,7900	141.975,00	0,21
Danone SA	FR0000120644		STK	3.900	0	0	EUR 55,4400	216.216,00	0,32
Kering SA	FR0000121485		STK	169	0	0	EUR 501,3000	84.719,70	0,13
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014		STK	429	0	0	EUR 855,0000	366.795,00	0,54
Oreal (L') SA	FR0000120321		STK	390	0	0	EUR 419,7000	163.683,00	0,24
Sanofi SA	FR0000120578		STK	1.951	0	0	EUR 97,7800	190.768,78	0,28
Schneider Electric SE	FR0000121972		STK	1.000	0	0	EUR 162,9800	162.980,00	0,24
Vinci SA	FR0000125486		STK	1.730	0	0	EUR 105,6200	182.722,60	0,27
<b>Großbritannien</b>							<b>EUR</b>	<b>94.630,00</b>	<b>0,14</b>
Unilever PLC	GB00B10RZP78		STK	2.000	0	500	EUR 47,3150	94.630,00	0,14
<b>Irland</b>							<b>EUR</b>	<b>236.206,74</b>	<b>0,35</b>
CRH PLC	IE0001827041		STK	1.821	0	0	EUR 49,9400	90.940,74	0,13
Kerry Group PLC	IE0004906560		STK	1.650	0	0	EUR 88,0400	145.266,00	0,21
<b>Italien</b>							<b>EUR</b>	<b>15.950,21</b>	<b>0,02</b>
Nexi S.p.A.	IT0005366767		STK	2.276	0	0	EUR 7,0080	15.950,21	0,02
<b>Niederlande</b>							<b>EUR</b>	<b>814.083,66</b>	<b>1,20</b>
ASML Holding NV	NL0010273215		STK	400	0	120	EUR 668,4000	267.360,00	0,39
Adyen NV	NL0012969182		STK	100	0	0	EUR 1.568,8000	156.880,00	0,23
Akzo Nobel NV	NL0013267909		STK	1.171	0	0	EUR 73,4000	85.951,40	0,13
ING Groep NV	NL0011821202		STK	9.000	0	0	EUR 12,1840	109.656,00	0,16
Koninklijke Ahold Delhaize NV	NL0011794037		STK	1.000	0	1.500	EUR 30,9850	30.985,00	0,05
Koninklijke KPN NV	NL0000009082		STK	20.000	0	0	EUR 3,2700	65.400,00	0,10
Philips NV (Konin.)	NL0000009538		STK	3.601	154	0	EUR 19,4300	69.967,43	0,10
Qiagen NV	NL0012169213		STK	689	0	0	EUR 40,4700	27.883,83	0,04
<b>Spanien</b>							<b>EUR</b>	<b>229.284,58</b>	<b>0,34</b>
Banco Santander SA	ES0113900J37		STK	30.000	0	0	EUR 3,3415	100.245,00	0,15
Grifols SA	ES0171996087		STK	5.203	0	0	EUR 11,5250	59.964,58	0,09
Solaria Energia y Medio Ambiente SA	ES0165386014		STK	5.000	0	0	EUR 13,8150	69.075,00	0,10
<b>Österreich</b>							<b>EUR</b>	<b>143.933,00</b>	<b>0,21</b>
Verbund AG	AT0000746409		STK	1.210	0	0	EUR 73,3000	88.693,00	0,13
Wienerberger AG	AT0000831706		STK	2.000	2.000	0	EUR 27,6200	55.240,00	0,08
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>58.013.845,50</b>	<b>85,71</b>
0,0000 % Adidas MC 2020/2028	XS2240505268		EUR	1.000	0	0	% 84,1050	841.050,00	1,24
0,0000 % CADES 2020/2026	FR0014000UG9		EUR	1.000	0	0	% 91,5330	915.330,00	1,35
0,0000 % European Investment Bank MTN 2016/2026	XS1509006208		EUR	3.100	0	0	% 91,5230	2.837.213,00	4,19
0,0000 % Hessen S.2001 2020/2025	DE000A1RQDR4		EUR	1.500	100	600	% 94,1170	1.411.755,00	2,09
0,0000 % Hessen S.2008 2020/2027	DE000A1RQDY0		EUR	1.000	0	0	% 87,3500	873.500,00	1,29
0,0000 % Italy 2021/2026	IT0005437147		EUR	400	0	600	% 90,2910	361.164,00	0,53
0,0000 % KBC Bank 2020/2025	BE0002707884		EUR	500	0	0	% 91,5030	457.515,00	0,68

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
0,0000 % NRW.Bank MTN 2020/2030	DE000NWB0AJ5		EUR	200	0	0 %	81,5050	163.010,00	0,24
0,0000 % Nestle Finance International MTN MC 2020/2024	XS2170362326		EUR	300	0	0 %	95,2150	285.645,00	0,42
0,0100 % BAWAG MTN 2020/2028	XS2106563161		EUR	1.000	0	0 %	85,4860	854.860,00	1,26
0,0100 % Baden-Würt- temberg 2020/2027	DE000A14JZN7		EUR	500	0	0 %	87,7060	438.530,00	0,65
0,0100 % Belfius Bank MTN 2020/2025	BE6324720299		EUR	200	0	0 %	91,2630	182.526,00	0,27
0,0100 % Caisse Fran. de Fin. Local 2020/2030	FR0013519568		EUR	1.000	0	0 %	79,5340	795.340,00	1,18
0,0100 % Caisse de Ref. de l'Habitat (covered) 2019/2029	FR0013451796		EUR	4.000	0	0 %	81,5390	3.261.560,00	4,82
0,0100 % Hessen 2021/2031	DE000A1RQD43		EUR	600	0	0 %	78,8810	473.286,00	0,70
0,0100 % LB Baden- Württ. MTN 2019/2028	DE000LB2CMY0		EUR	1.400	0	0 %	84,6370	1.184.918,00	1,75
0,0100 % Natixis Pfand- briefbank Pfe. 2019/2024	DE000A14J0L1		EUR	500	0	0 %	94,7080	473.540,00	0,70
0,0100 % Nieder- sachsen 2020/2029	DE000A3H24E1		EUR	1.000	0	0 %	84,1420	841.420,00	1,24
0,0100 % Schleswig- Holstein 2020/2030	DE000SHFM741		EUR	1.400	0	0 %	81,2210	1.137.094,00	1,68
0,0100 % Wüstenrot Bau- sparkasse Pfe. 2020/2027	DE000WBP0A79		EUR	500	0	0 %	86,6740	433.370,00	0,64
0,0500 % BNG Bank MTN 2016/2024	XS1445725218		EUR	200	0	0 %	96,3240	192.648,00	0,28
0,0500 % Credit Agricole Home Loan SFH MTN 2019/2029	FR0013465010		EUR	4.000	0	0 %	81,1280	3.245.120,00	4,79
0,1000 % Bundeslän- der LSA 2016/2026	DE000A2BN5X6		EUR	2.100	0	0 %	89,9890	1.889.769,00	2,79
0,1000 % Caisse Fran. de Fin. Local MTN 2019/2029	FR0013459757		EUR	3.000	0	0 %	81,5770	2.447.310,00	3,62
0,1000 % Ile de France 2020/2030	FR0013521382		EUR	200	0	0 %	80,3730	160.746,00	0,24
0,1000 % Rheinland- Pfalz LSA 2016/2026	DE000RLP0777		EUR	200	0	0 %	90,3300	180.660,00	0,27
0,1000 % UNEDIC MTN 2020/2026	FR0126221896		EUR	1.000	0	0 %	89,7430	897.430,00	1,33
0,1250 % Bay. Landes- bank MTN 2021/2028	DE000BLB6J00		EUR	400	0	0 %	83,6300	334.520,00	0,49
0,1250 % NRW.Bank MTN 2019/2027	DE000NWB2KW3		EUR	500	0	0 %	88,6690	443.345,00	0,65
0,1250 % Nordrhein-West- falen MTN 2021/2031	DE000NRW0MY1		EUR	500	0	0 %	79,7700	398.850,00	0,59
0,1250 % Stadshypotek (covered) 2016/2026	XS1499574991		EUR	3.500	0	0 %	89,3860	3.128.510,00	4,62
0,2000 % European Financial Stability Facility (EFSF) MTN 2015/2025	EU000A1G0DE2		EUR	1.000	0	1.000 %	94,1930	941.930,00	1,39
0,2500 % Agence Francaise Develop MTN 2016/2026	FR0013190188		EUR	3.500	0	0 %	90,8000	3.178.000,00	4,70
0,2500 % Agence Francaise Develop MTN 2019/2029	FR0013431137		EUR	2.500	0	0 %	83,5930	2.089.825,00	3,09
0,2500 % Koninklijke Ahold Delhaize MC 2019/2025	XS2018636600		EUR	400	0	0 %	93,3160	373.264,00	0,55
0,2500 % OP Mortgage Bank (covered) 2017/2024	XS1576693110		EUR	1.700	0	0 %	97,5590	1.658.503,00	2,45
0,3000 % DekaBank MTN 2019/2026	XS2082333787		EUR	200	0	0 %	88,4210	176.842,00	0,26
0,3750 % ALD MTN 2019/2023	XS2029574634		EUR	700	0	0 %	99,8640	699.048,00	1,03
0,3750 % BMW Finance MTN 2020/2027	XS2102357014		EUR	200	0	0 %	89,5920	179.184,00	0,26
0,3750 % DSV Panalpina MC 2020/2027	XS2125426796		EUR	100	0	0 %	88,5190	88.519,00	0,13
0,3750 % Deutsche Bahn Finance MTN 2020/2029	XS2193666042		EUR	400	0	0 %	84,2930	337.172,00	0,50

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
0,3750 % Deutsche Post MTN MC 2020/2026	XS2177122541		EUR	150	0	0 %	92,3650	138.547,50	0,20
0,6250 % Evonik Industries MC 2020/2025	DE000A289NX4		EUR	200	0	0 %	92,8400	185.680,00	0,27
0,6250 % Koninklijke KPN MC 2016/2025	XS1485532896		EUR	200	0	0 %	94,4830	188.966,00	0,28
0,6250 % Sanofi MTN MC 2016/2024	FR0013143997		EUR	200	0	0 %	97,7310	195.462,00	0,29
0,7500 % KBC Groep MTN 2016/2023	BE0002266352		EUR	200	0	0 %	99,1050	198.210,00	0,29
0,8000 % Belgium S.74 2015/2025	BE0000334434		EUR	1.000	0	0 %	95,4810	954.810,00	1,41
1,2500 % Securitas MTN MC 2018/2025	XS1788605936		EUR	150	0	0 %	94,3730	141.559,50	0,21
1,5000 % CADES MTN 2022/2032	FR001400A3H2		EUR	2.200	0	0 %	87,8780	1.933.316,00	2,86
1,8000 % Bundesobligation S.G 2022/2053	DE0001030757		EUR	700	700	0 %	87,0550	609.385,00	0,90
2,3000 % Bundesobligation 2023/2033	DE000BU2Z007		EUR	500	1.500	1.000 %	99,0920	495.460,00	0,73
2,5000 % Brandenburg 2023/2029	DE000A3E5SL5		EUR	300	300	0 %	96,7830	290.349,00	0,43
2,5000 % Bundesanleihe 2014/2046	DE0001102341		EUR	600	600	0 %	101,4580	608.748,00	0,90
2,5000 % Italy 2022/2032	IT0005494239		EUR	600	900	300 %	88,9280	533.568,00	0,79
2,5000 % Spain 2022/2032	ES0000012K61		EUR	600	500	0 %	93,6780	562.068,00	0,83
2,6250 % LB Hessen-Thüringen 2022/2027	XS2525157470		EUR	300	0	0 %	94,6420	283.926,00	0,42
2,6250 % UniCredit Bank Pfe. 2022/2028	DE000HV2AY12		EUR	200	0	0 %	96,9620	193.924,00	0,29
2,6500 % Italy 2022/2027	IT0005500068		EUR	500	0	0 %	95,7680	478.840,00	0,71
2,7500 % Münchener Hyp. MTN 2023/2025	DE000MHB33J5		EUR	300	300	0 %	98,1110	294.333,00	0,43
2,7500 % Saarland 2023/2030	DE000A3H3GK4		EUR	500	500	0 %	98,0240	490.120,00	0,72
2,8750 % Agence Francaise Develop 2023/2030	FR001400F7C9		EUR	500	500	0 %	97,5790	487.895,00	0,72
3,0000 % Berlin Hyp MTN 2023/2033	DE000BHY0GM2		EUR	500	500	0 %	98,9700	494.850,00	0,73
3,0000 % Berlin S.548 2023/2028	DE000A3MQYR7		EUR	500	500	0 %	99,2210	496.105,00	0,73
3,0000 % France (Government of) 2022/2033	FR001400H7V7		EUR	600	600	0 %	100,5090	603.054,00	0,89
3,0000 % Italy 2019/2029	IT0005365165		EUR	500	400	0 %	95,9940	479.970,00	0,71
3,0000 % Nestle Finance International MTN MC 2022/2028	XS2555196463		EUR	100	0	0 %	99,4930	99.493,00	0,15
3,1250 % KfW MTN 2023/2030	DE000A30V9J0		EUR	1.000	1.000	0 %	100,9060	1.009.060,00	1,49
3,1250 % Wüstenrot Bausparkasse MTN S.19 2023/2030	DE000WBP0BJ1		EUR	500	500	0 %	99,1700	495.850,00	0,73
3,2500 % LB Baden-Württ. ÖPfe. 2023/2026	DE000LB386A8		EUR	450	450	0 %	99,2570	446.656,50	0,66
3,2500 % Lloyds Bank MTN 2023/2026	XS2582348046		EUR	500	500	0 %	98,5210	492.605,00	0,73
3,2500 % Swedish Covered Bond MTN 2023/2028	XS2617508481		EUR	800	1.000	200 %	99,0780	792.624,00	1,17
3,5000 % Schneider Electric MTN MC 2023/2033	FR001400IJU1		EUR	200	200	0 %	99,4470	198.894,00	0,29
3,8000 % Spain 2014/2024	ES00000124W3		EUR	100	100	0 %	100,1080	100.108,00	0,15
3,8750 % ABN AMRO Bank MTN 2023/2026	XS2637963146		EUR	200	200	0 %	99,3230	198.646,00	0,29
4,0000 % Bundesanleihe 2005/2037	DE0001135275		EUR	300	300	0 %	117,1840	351.552,00	0,52
4,0000 % LB Hessen-Thüringen MTN 2023/2030	XS2582195207		EUR	400	400	0 %	98,2660	393.064,00	0,58
4,4000 % Italy S. 10Y 2022/2033	IT0005518128		EUR	600	600	0 %	103,4220	620.532,00	0,92

**Vermögensaufstellung zum 30.06.2023**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	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
4,7500 % Italy BTP 2013/2044	IT0004923998		EUR	200	200	0 %	105,8970	211.794,00	0,31
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>2.773.272,00</b>	<b>4,10</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>2.773.272,00</b>	<b>4,10</b>
0,0000 % Italy 2021/2024	IT0005474330		EUR	1.800	300	1.200 %	94,7990	1.706.382,00	2,52
0,0100 % UNEDIC MTN 2021/2031	FR0014002P50		EUR	500	0	0 %	79,1250	395.625,00	0,58
0,2500 % Investiti- onsbank Schleswig- Holstein 2017/2024	DE000A13SL75		EUR	700	0	0 %	95,8950	671.265,00	0,99
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>66.145.046,32</b>	<b>97,72</b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>							<b>EUR</b>	<b>221.900,00</b>	<b>0,33</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>-8.175,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>-8.175,00</b>	<b>-0,01</b>
Euro Stoxx 50 Future September 2023		EUREX	STK	-70				-8.175,00	-0,01
<b>Zins-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>230.075,00</b>	<b>0,34</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>230.075,00</b>	<b>0,34</b>
Euro-BOBL Future September 2023		EUREX	STK	-116				212.280,00	0,31
Euro-BTP Future September 2023		EUREX	STK	-13				2.700,00	0,00
Euro-Bund Future September 2023		EUREX	STK	-5				6.900,00	0,01
Euro-OAT Future September 2023		EUREX	STK	-10				-5.620,00	-0,01
Euro-Schatz Future September 2023		EUREX	STK	-15				12.975,00	0,02
Short Euro-BTP Future September 2023		EUREX	STK	-1				840,00	0,00
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>1.240.542,23</b>	<b>1,83</b>
<b>Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>1.240.542,23</b>	<b>1,83</b>
<b>EUR - Guthaben bei</b>							<b>EUR</b>	<b>1.240.542,23</b>	<b>1,83</b>
Verwahrstelle			EUR	1.240.542,23				1.240.542,23	1,83
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>162.903,54</b>	<b>0,24</b>
Forderung CSDR Penalty			EUR					84,05	0,00
Quellensteuerrück- stattungsansprüche			EUR					2.214,72	0,00
Zinsansprüche			EUR					160.604,77	0,24
<b>Sonstige Verbindlichkeiten<sup>1)</sup></b>							<b>EUR</b>	<b>-82.791,34</b>	<b>-0,12</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>67.687.600,75</b>	<b>100,00<sup>2)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>1.000,64</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>67.644</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>97,72</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>0,33</b>

<sup>1)</sup> Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Veröffentlichungskosten, Managementgebühr, Depotgebühren, Steuern und Druckkosten

<sup>2)</sup> 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.

**Marktschlüssel****Terminbörsen**

EUREX European Exchange Deutschland

**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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Deutschland</b>				
Deutsche Börse AG	DE0005810055	STK	0	500
<b>Frankreich</b>				
Essilor International SA	FR0000121667	STK	0	100
<b>Großbritannien</b>				
CNH Industrial NV	NL0010545661	STK	0	4.877
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
0,0000 % BMW Finance MTN 2020/2023	XS2102355588	EUR	0	350
0,0100 % KfW MTN 2019/2027	XS1999841445	EUR	0	450
0,1250 % Rheinland-Pfalz LSA 2016/2023	DE000RLP0736	EUR	0	1.500
0,2500 % Spain 2019/2024	ES0000012E85	EUR	0	600
0,5000 % Bundesanleihe 2015/2025	DE0001102374	EUR	500	1.000
1,0000 % Bundesanleihe 2014/2024	DE0001102366	EUR	0	1.500
1,7000 % Bundesobligation 2022/2032	DE0001102606	EUR	400	400
1,7500 % Bundesanleihe 2014/2024	DE0001102333	EUR	200	700
3,0000 % DZ HYP MTN 2023/2027	DE000A3MQU11	EUR	1.000	1.000
6,2500 % Bundesanleihe 1994/2024	DE0001134922	EUR	500	1.000



Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Derivate</b>				
<b>(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>				
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
<b>Verkaufte Kontrakte</b>	<b>EUR</b>			<b>11.011</b>
<small>(Basiswert(e): Euro Stoxx 50)</small>				
<b>Zinsterminkontrakte</b>				
<b>Verkaufte Kontrakte</b>	<b>EUR</b>			<b>132.220</b>
<small>(Basiswert(e): 10Y French Republic Bond, 10YR Italian Govt. Bonds, 2YR Italian Govt. Bonds, BOBL, BUND, SCHATZANW.)</small>				

**Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)**

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Dividenden inländischer Aussteller (netto)		46.667,30
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		75.133,14
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren		88.945,91
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)		96.026,38
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		15.274,06
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-3.451,50
7. Sonstige Erträge		563,17
davon CSDR Penalties	563,17	
<b>Summe der Erträge</b>		<b>319.158,46</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-85,55
2. Verwaltungsvergütung		-12.177,24
3. Beratervergütung		20.371,40
4. Managementgebühr		-80.211,56
5. Verwahrstellenvergütung		-4.019,18
6. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-4.441,46
7. Sonstige Aufwendungen		-7.196,44
davon Depotgebühren	-6.979,52	
davon Negativzinsen Liquiditätsanlagen	-216,92	
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-87.760,03</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>231.398,43</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		1.437.623,52
2. Realisierte Verluste		-1.840.229,48
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-402.605,96</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-171.207,53</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-874.198,40
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.253.752,29
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>379.553,89</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>208.346,36</b>

**Entwicklung des Sondervermögens**

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>67.539.349,62</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr		0,00
2. Zwischenausschüttungen		-215.961,60
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		156.653,64
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinkäufen	156.653,64	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich / Aufwandsausgleich		-787,27
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		208.346,36
davon nicht realisierte Gewinne	-874.198,40	
davon nicht realisierte Verluste	1.253.752,29	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>67.687.600,75</b>

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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://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

Amundi Deutschland GmbH  
Arnulfstraße 124 - 126  
80636 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](http://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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)