

Halbjahresbericht

FS Colibri Event Driven Bonds

1. November 2023 bis 30. April 2024

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.04.2024

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	25.180,23	0,02
Frankreich	25.180,23	0,02
Verzinsliche Wertpapiere	127.515.792,73	89,56
Belgien	5.893.680,00	4,14
Deutschland	18.075.673,52	12,70
Frankreich	16.141.738,40	11,34
Großbritannien	13.005.495,81	9,13
Italien	8.207.271,00	5,76
Jersey	208.176,80	0,15
Lettland	4.382.685,00	3,08
Luxemburg	3.134.107,00	2,20
Niederlande	29.942.590,00	21,03
Portugal	8.669.716,00	6,09
Schweden	4.739.475,00	3,33
Schweiz	5.372.069,55	3,77
Österreich	9.743.114,65	6,84
Derivate	12.990,17	0,01
Devisen-Derivate	12.990,17	0,01
Bankguthaben	13.582.719,99	9,54
Sonstige Vermögensgegenstände	1.894.123,80	1,33
Verbindlichkeiten	-647.633,17	-0,45
Fondsvermögen	142.383.173,75	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände									
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	97.113.086,56	68,21
Aktien							EUR	25.180,23	0,02
Frankreich							EUR	25.180,23	0,02
Casino Guichard Perrachon SA	FR0000125585		STK	877.360	877.360	0	EUR 0,0287	25.180,23	0,02
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	97.087.906,33	68,19
7,7411 % Aryzta FRN PERP (sub.) 2013/2199	CH0200044813		CHF	5.200	1.200	0	% 101,3100	5.372.069,55	3,77
0,0000 % Novo Banco (Luxembourg Branch) MTN 2014/2048	XS1053939978		EUR	7.000	5.000	0	% 31,3360	2.193.520,00	1,54
0,0000 % Novo Banco Luxembourg MTN 2014/2052	XS1055501974		EUR	3.800	0	0	% 26,6420	1.012.396,00	0,71
0,0000 % Novo Banco MTN 2014/2049	XS1031115014		EUR	10.000	8.000	1.050	% 29,6480	2.964.800,00	2,08
0,2500 % Heimstaden Bos- stad MTN MC 2021/2024	XS2397239000		EUR	4.000	1.000	0	% 97,0630	3.882.520,00	2,73
1,3750 % Global Switch Finance MTN MC 2020/2030	XS2241825111		EUR	5.000	800	0	% 91,0580	4.552.900,00	3,20
1,6250 % Merck fix-to- float (sub.) 2019/2079	XS2011260531		EUR	4.000	4.000	0	% 98,5070	3.940.280,00	2,77
1,7500 % Infrastrut- ture Wireless Italiane MTN MC 2021/2031	XS2332687040		EUR	4.500	1.400	0	% 88,6050	3.987.225,00	2,80
2,6250 % Total MTN PERP fix-to-float (sub.) 2015/2199	XS1195202822		EUR	3.000	3.000	0	% 98,3870	2.951.610,00	2,07
2,8620 % Aegon FRN PERP (sub.) 2004/2199	NL0000116150		EUR	5.000	0	0	% 83,8520	4.192.600,00	2,94

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,9230 % AXA MTN PERP fix-to-float (sub.) 2004/2199	XS0203470157		EUR	2.000	2.000	0 %	91,1440	1.822.880,00	1,28
3,0110 % AXA MTN FRN PERP (sub.) 2003/2199	XS0181369454		EUR	300	300	0 %	91,0690	273.207,00	0,19
3,2480 % Heimstaden Bostad PERP fix-to-float (sub.) 2019/2199	XS2010037765		EUR	6.500	6.500	0 %	72,9150	4.739.475,00	3,33
3,3750 % Volkswagen Int. Fin. PERP Multi Reset Notes (sub.) 2018/2199	XS1799938995		EUR	3.000	3.000	0 %	99,7270	2.991.810,00	2,10
3,6300 % AXA MTN FRN PERP (sub.) 2003/2199	XS0179060974		EUR	1.000	1.000	0 %	90,8860	908.860,00	0,64
3,8750 % Tele Columbus MC 2018/2025	XS1814546013		EUR	8.544	10.271	8.427 %	63,9630	5.465.137,52	3,84
4,5420 % Around-town PERP fix-to-float (sub.) 2018/2199	XS1752984440		EUR	600	0	0 %	51,6570	309.942,00	0,22
4,6500 % Barclays Bank PERP fix-to-float (subordinated) 2005/2199	XS0214398199		EUR	1.000	0	0 %	94,8850	948.850,00	0,67
5,3750 % Porr PERP fix-to-float (sub.) 2020/2025	XS2113662063		EUR	535	550	4.465 %	97,1990	520.014,65	0,37
5,7500 % Sigma Holdco MC 2018/2026	XS1813504666		EUR	5.000	500	0 %	93,6540	4.682.700,00	3,29
6,3750 % Groupama fix-to-float PERP (sub.) 2014/2199	FR0011896513		EUR	4.000	4.000	0 %	100,1260	4.005.040,00	2,81
6,7500 % Air Baltic MC 2019/2024	XS1843432821		EUR	4.500	1.250	0 %	97,3930	4.382.685,00	3,08
7,0780 % ATF Netherlands MC 2016/2199	XS1508392625		EUR	8.000	0	2.000 %	66,5870	5.326.960,00	3,74
7,7080 % Banca Monte d Paschi Siena fix-to-float (Sub.) 2018/2028	XS1752894292		EUR	2.100	0	0 %	104,6260	2.197.146,00	1,54
8,0000 % Banca Monte Dei P. di S. fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2106849727		EUR	2.000	0	0 %	101,1450	2.022.900,00	1,42
9,0390 % Raiffeisen Bank Int. PERP fix-to-float (sub.) 2017/2199	XS1640667116		EUR	5.000	1.000	0 %	96,6640	4.833.200,00	3,39
10,8060 % Aareal Bank PERP fix-to-float (sub.) 2014/2199	DE000A1TNDK2		EUR	5.400	1.400	0 %	80,4140	4.342.356,00	3,05
3,8750 % TalkTalk Telecom Group MC 2020/2025	XS2121167345		GBP	4.500	4.500	0 %	90,7350	4.782.462,28	3,36
12,0000 % Metro Bank Holdings MTN S.REGS fix-to-float 2023/2029	XS2720120596		GBP	4.000	4.000	0 %	85,4020	4.001.218,14	2,81
7,5000 % MCLAUT S.REGS MC 2021/2026	XS2369684050		USD	4.000	4.000	0 %	87,4700	3.272.965,39	2,30
9,7500 % Petrofac S.REGS MC 2021/2026	USG7052TAF87		USD	1.100	7.089	8.900 %	20,2310	208.176,80	0,15
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	28.279.105,00	19,86
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	28.279.105,00	19,86
3,0000 % Vivion Investments 2019/2024	XS2031925840		EUR	2.900	2.900	0 %	97,3850	2.824.165,00	1,98
4,3750 % Peach Property Finance MC 2020/2025	XS2247301794		EUR	5.000	1.000	0 %	86,5580	4.327.900,00	3,04
5,6250 % Transportes Aereos Portugueses SA MC 2019/2024	PTTAPDOM0005		EUR	2.500	0	0 %	99,9600	2.499.000,00	1,76
5,7500 % Lenzing PERP fix-to-float (sub.) 2020/2199	XS2250987356		EUR	5.000	2.300	0 %	87,7980	4.389.900,00	3,08
5,9280 % BNP Paribas Fortis Cv (subordinated) 2007/2199	BE0933899800		EUR	6.500	3.500	0 %	90,6720	5.893.680,00	4,14
8,6470 % Burger King France S.REGS FRN MC 2021/2026	XS2403031912		EUR	4.000	4.000	0 %	100,7840	4.031.360,00	2,83
10,0000 % Selecta Group S.REGs MC 2020/2026	XS2249859328		EUR	5.000	5.000	0 %	86,2620	4.313.100,00	3,03

Vermögensaufstellung zum 30.04.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.04.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	2.148.781,40	1,51
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	2.148.781,40	1,51
8,5000 % Quatrim Pay-in-Kind 2024/2027	XS2770000326		EUR	2.385	2.385	0	% 90,0790	2.148.781,40	1,51
Summe Wertpapiervermögen								127.540.972,96	89,58
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)							EUR	12.990,17	0,01
Devisen-Derivate							EUR	12.990,17	0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Futures auf Devisen							EUR	12.990,17	0,01
EUR/CHF FX Currency Future Juni 2024		CME	CHF	5.000				117.269,16	0,08
EUR/GBP FX Currency Future Juni 2024		CME	GBP	7.500				-37.774,08	-0,03
EUR/USD FX Currency Future Juni 2024		CME	USD	3.125				-66.504,91	-0,05
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	13.582.719,99	9,54
Bankguthaben							EUR	13.582.719,99	9,54
EUR - Guthaben bei							EUR	11.166.777,11	7,84
Verwahrstelle			EUR	11.166.777,11				11.166.777,11	7,84
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen							EUR	64.088,71	0,05
Verwahrstelle			GBP	54.716,38				64.088,71	0,05
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	2.351.854,17	1,65
Verwahrstelle			CHF	138.531,71				141.265,19	0,10
Verwahrstelle			USD	2.363.119,62				2.210.588,98	1,55
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.894.123,80	1,33
Zinsansprüche			EUR					1.894.123,80	1,33
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾							EUR	-647.633,17	-0,45
Fondsvermögen							EUR	142.383.173,75	100,00²⁾
Anteilwert Klasse I (a)							EUR	99,60	
Anteilwert Klasse S (a)							EUR	1.009,67	
Anteilwert Klasse X (t)							EUR	1.080,74	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)							STK	323.766,846	
Umlaufende Anteile Klasse S (a)							STK	31.159	
Umlaufende Anteile Klasse X (t)							STK	72.798	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)							EUR	32.247.429,23	
Fondsvermögen Anteilklasse S (a)							EUR	31.460.235,49	
Fondsvermögen Anteilklasse X (t)							EUR	78.675.509,03	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)									89,58
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)									0,01

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Performance Fee und Kosten für Researchmaterial

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.

Zum Stichtag 30. April 2024 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 95,46 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 4,54 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.04.2024

Schweiz, Franken	(CHF)	0,98065	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85376	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,06900	= 1 (EUR)

Marktschlüssel**Terminbörsen**

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte	per 30.04.2024 oder letztbekannte
---------------------	-----------------------------------

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen**Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugang zum Berichtsstichtag)**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Frankreich				
Casino Guichard Perrachon SA junge Aktien	FR001400OJ98	STK	877.360	877.360
Verzinsliche Wertpapiere				
0,2500 % Aareal Bank 2020/2027	DE000A289LU4	EUR	3.200	3.200
0,7500 % Aareal Bank MTN 2022/2028	DE000AAR0322	EUR	2.000	2.000
2,8750 % Arountown MTN PERP fix-to-float (sub.) 2019/2199	XS2027946610	EUR	0	500
4,1250 % Madrid (Comunidad de) 2014/2024	ES0000101602	EUR	0	1.800
4,2500 % Alpha Services and Hold MTN fix-to-float (sub.) 2020/2030	XS2111230285	EUR	0	1.250
4,4980 % Casino Guichard-Perrachon MC -rating sensitive-2014/2025	FR0011765825	EUR	0	2.100
5,2500 % Intralot Capital Luxembourg S.REGS MC 2017/2024	XS1685702794	EUR	0	1.600
5,4510 % Enel fix-to-float (sub.) 2013/2024	XS0954675129	EUR	0	3.000
7,2320 % Aegon MTN fix-to-float (subord.) 2014/2044	XS1061711575	EUR	0	4.000
7,8410 % NN Group fix-to-float (sub.) 2014/2044	XS1054522922	EUR	0	3.000
9,7500 % Piraeus Group Finance (sub.) 2019/2029	XS2018638648	EUR	0	1.800
7,0000 % Tullow Oil MC 2018/2025	USG91237AA87	USD	0	4.300
7,0000 % UBS Group S.REGS PERP fix-to-float (sub.) 2019/2024	USH4209UAT37	USD	0	5.000
10,5000 % Aston Martin Capital S.REGS MC 2020/2025	USG05891AH20	USD	0	4.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
2,2500 % DIC Asset MC 2021/2026	XS2388910270	EUR	100	3.900
5,8750 % Quatrim MC 2019/2024	XS2010039118	EUR	0	2.686
6,6250 % Casino Guichard-Perrachon MC 2020/2026	XS2276596538	EUR	0	600
8,5000 % Vallourec MC 2021/2024	XS2352739184	EUR	1.000	4.000

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				
Futures auf Devisen				
Gekaufte Kontrakte	EUR			20.658
(Basiswert(e): Spot EUR gegen CHF, Spot EUR gegen USD)				

Köln, im Mai 2024

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 30.04.2024)
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

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).

Auslagerung Portfoliomanagement

Fidus Finanz AG
August-Schanz-Straße 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