

# Jahresbericht

## Ampega ISP Komfort

1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

OGAW-Sondervermögen





# Jahresbericht

## Tätigkeitsbericht

### Anlageziel

Der Ampega ISP Komfort strebt als Anlageziel die Erwirtschaftung einer attraktiven Wertentwicklung an. Er ist darauf ausgerichtet, eine risikoadjustierte Investition über alle Assetklassen hinweg an den weltweiten Kapitalmärkten umzusetzen. Das Fondsmanagement investiert dabei in ein breit diversifiziertes Portfolio.

Zusätzlich strebt der Ampega ISP Komfort eine aktive Steuerung über ein jährliches Risikobudget gemessen am Value at Risk (VaR) von 5 % an. In bestimmten Marktphasen kann das Verlustrisiko auch über dieses Niveau hinausgehen.

### Anlagestrategie und Anlageergebnis

Der Fonds wird aktiv gemanagt und orientiert sich nicht an einer Benchmark.

Die Informationen zum Umgang mit ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Anhang enthalten.

Mit dem Ampega ISP Komfort investieren Anleger in ein global diversifiziertes Portfolio. Verlustphasen sind grundsätzlich nicht auszuschließen. Das Fondsmanagement agiert ohne Orientierung an bestimmten Benchmarks, so dass die Fondsentwicklung von der Entwicklung einzelner Assetklassen stark abweichen kann.

Im Berichtszeitraum war das Sondervermögen über aktive Publikumsfonds und ETFs in die Anlageklassen Aktien, Renten, Rohstoffe, Immobilien sowie Geldmarkt investiert.

Der Fonds startete das Berichtsjahr mit einer Aktienquote von rund 13,9 %, einer Rentenquote von 78,8 %, einem Anteil an alternativen und immobiliennahen Anlagen rund 7,1 % sowie 0,2 % Liquidität. Die Aktienmärkte entwickelten sich in der abgelaufenen Berichtsperiode positiv und gewannen in den USA prozentual zweistellig und in Europa prozentual ebenfalls zweistellig unter Berücksichtigung von Ausschüt-

tungen. Die globalen Rentenmärkte entwickelten sich im Aggregat für Unternehmens- und Staatsanleihen in der Berichtsperiode positiv.

Die Vermögensaufteilung verschob sich im Fonds während des Jahres und so liegt zum Geschäftsjahresende die Aktienquote bei 15,0 %, während sich die Rentenquote auf 70,2 % beläuft. Alternative und immobiliennahe Investments machen einen Anteil von rund 12,5 % aus und der Kasseanteil liegt bei 2,3 % im Portfolio zum Geschäftsjahresende. Im Verlaufe der positiven Aktien- und Rentenmarktentwicklung im Berichtszeitraum konnte das Portfolio etwas offensiver mit einer höheren Aktien- und Immobilienquote ausgerichtet werden.

In Summe ergibt sich für den Ampega ISP Komfort im Berichtszeitraum eine Performance von 4,68 % und eine Volatilität von 3,56 %.

### Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

#### Marktpreisrisiken

Durch die Investition in verschiedene Wertpapier-Investmentanteile war und ist das Sondervermögen einem der Allokation entsprechenden Markt- und Kursrisiko ausgesetzt, welches jedoch durch die breite Diversifikation und ein striktes Risikomanagement begrenzt wurde.

#### Aktienrisiken

Durch Investition in Aktienfonds bzw. hauptsächlich ETFs (Exchange-traded funds = börsengehandelte Fonds) ist das Sondervermögen sowohl allgemeinen als auch spezifischen Aktienrisiken ausgesetzt. Die spezifischen Aktienrisiken werden durch Diversifikation in eine Vielzahl von Aktienfonds bzw. ETFs, die wiederum in eine Vielzahl von Einzelaktien investiert sind, gesteuert und begrenzt. Die Steuerung der allgemeinen Marktrisiken erfolgt durch Investitionen in unterschiedliche Regionen und Segmente.

### *Währungsrisiken*

Da der Fonds weltweit investiert, wird die Entwicklung des Fondsvermögens in Teilen durch die Entwicklung der unterschiedlichen Währungen beeinflusst. Zur Nutzung der Chancen aus Verschiebungen der Währungsparitäten werden aktiv entsprechende Zielfonds eingesetzt. Dadurch trägt der Investor die Chancen und das Risiko der Wechselkursentwicklungen der verschiedenen Währungsräume relativ zum Euro.

### *Zinsänderungsrisiken*

Das Sondervermögen ist allgemeinen Zinsänderungsrisiken hauptsächlich über Investments in Rentenfonds bzw. ETFs ausgesetzt. Das allgemeine Zinsänderungsrisiko wird durch Berücksichtigung der Duration bei der Zielfondsauswahl gesteuert und begrenzt. Darüber hinaus ist das Sondervermögen insbesondere über die Investition in Rentenfonds, die in Anleihen bonitätsrisikobehafteter Emittenten investieren, auch entsprechenden Spreadrisiken ausgesetzt. Die Steuerung dieser Risiken erfolgt über verschiedene Indexkonzepte, welche nach hohen Qualitätsanforderungen ausgewählt werden.

### *Spezielle Risiken bei Rohstoff- und Edelmetallinvestments*

Die Anlagestrategie des Fonds beinhaltet auch verbrieft Investments in physische Rohstoffe, die neben den für diese Anlageklasse typischen Marktrisiken üblicherweise den Gesetzmäßigkeiten des Terminmarktes unterliegen. Insbesondere können sogenannte "Rollverluste" am Terminmarkt Verluste produzieren, selbst wenn der jeweilige Rohstoffpreis längerfristig steigt.

### **Adressenausfallrisiken**

Adressenausfallrisiken entstehen im Wesentlichen aus den einzelnen Renteninvestments in den Zielfonds, bei denen es zu einem Ausfall der Zins- und Tilgungszahlungen kommen kann. Das Risiko wird durch eine gezielte Fondsauswahl und Streuung auf verschiedene Fonds im Rahmen der Anlageentscheidung gesteuert. Adressenausfallrisiken ergeben sich weiterhin durch die Anlage liquider Mittel bei Banken.

### **Liquiditätsrisiken**

Die Liquiditätssituation des Sondervermögens wird wesentlich durch die Liquiditätssituation der Zielfonds bestimmt. Grundsätzlich ist der Fonds einem gewissen Liquiditätsrisiko ausgesetzt. Durch Investition in Fonds, die schwerpunktmä-

ßig in Segmente mit einer hinreichenden Markttiefe investieren, wird das Liquiditätsrisiko gesteuert und begrenzt. Aufgrund der breiten Streuung über eine Vielzahl von Investmentfonds und ETFs verschiedener Kapitalverwaltungsgesellschaften und deren gesetzlicher Rücknahmeverpflichtungen sowie durch den Börsenhandel im Falle von ETFs ist davon auszugehen, dass jederzeit ausreichend Vermögenswerte des Sondervermögens zu einem angemessenen Verkaufserlös veräußert werden können. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung liegen keine Informationen vor, die auf eine begrenzte Liquiditätssituation einzelner Zielfonds hindeuten.

### **Operationelle Risiken**

Für die Überwachung und Steuerung der operationellen Risiken des Sondervermögens sind entsprechende Maßnahmen getroffen worden.

### **Nachhaltigkeitsrisiken**

Für die Gesellschaft ist eine systematische Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken bei Investitionsentscheidungen ein wesentlicher Teil der strategischen Ausrichtung. Nachhaltigkeitsrisiken sind Ereignisse oder Bedingungen aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, deren Eintreten tatsächlich oder potenziell erhebliche negative Auswirkungen auf die Vermögens-, Finanz- und Ertragslage sowie auf die Reputation der Investitionsempfänger haben können. Nachhaltigkeitsrisiken wirken sich grundsätzlich auf alle bestehenden Risikoarten und somit auf die Renditeerwartungen einer Investition aus.

Die Gesellschaft hat einen grundsätzlichen Filterkatalog entwickelt, welcher auf alle getätigten Investitionen angewendet wird und der damit auch negative Wertentwicklungen, die auf Nachhaltigkeitsrisiken zurückzuführen sind, mindern soll. Dieser beinhaltet den Ausschluss kontroverser Waffenhersteller und die Berücksichtigung der UN Global Compact Kriterien. Durch diesen Filterkatalog wurden Titel im Rahmen der Investitionsentscheidung in Bezug auf Nachhaltigkeitsrisiken bewertet und damit in der Allokationsentscheidung berücksichtigt.

### **Risiken infolge exogener Faktoren**

Für das kommende Geschäftsjahr sind Belastungen durch volatile Marktverhältnisse und exogene Faktoren (z. B. Russland/Ukraine-Krieg, Corona-Pandemie, Inflation, Zinsanstieg, Energieverteuerung und -verknappung, Lieferkettenprob-

leme, geopolitische Unsicherheit) und damit Auswirkungen unterschiedlicher Intensität auf die Wertentwicklung des Fonds nicht auszuschließen.

#### **Ergänzende Angaben nach ARUGII**

Der Fonds strebt als Anlageziel die Erwirtschaftung einer attraktiven risikoadjustierten Wertentwicklung an.

Die Anlagepolitik des Fonds ist darauf ausgerichtet, eine risikoadjustierte Investition über alle Assetklassen hinweg an den weltweiten Kapitalmärkten umzusetzen. Das Sondervermögen investiert dabei in ein breit diversifiziertes Portfolio. Zusätzlich strebt das Sondervermögen eine aktive Steuerung über ein jährliches Risikobudget (Value at Risk) von 5 % an. In bestimmten Marktphasen kann das Verlustrisiko auch deutlich über dieses Niveau hinausgehen. Das Verlustrisiko stellt keine vertragliche Obergrenze, sondern lediglich eine Zielgröße im Rahmen der Risikosteuerung dar. Bis zu 100 % können in Geldmarktinstrumente und Bankguthaben investiert werden.

Derivate dürfen zum Zwecke der Absicherung, der effizienten Portfoliosteuerung und der Erzielung von Zusatzerträgen eingesetzt werden.

Aus den für das Sondervermögen erworbenen Aktien erwachsen Abstimmungsrechte in den Hauptversammlungen der Portfoliogesellschaften (Emittenten) und teilweise andere Mitwirkungsrechte. Die Engagement Policy der Ampega Investment GmbH enthält allgemeine Informationen über die verantwortungsvolle Ausübung dieser Rechte, auch zum Umgang mit Interessenkonflikten im Rahmen der Mitwirkung in den Portfoliogesellschaften.

Liegen der Talanx Investment Group keine unternehmensspezifischen Informationen vor, die eine Teilnahme an der Hauptversammlung notwendig machen, so nimmt die Talanx Investment Group in aller Regel Abstand von der persönlichen Teilnahme durch Vertretungsberechtigte. Die Talanx Investment Group unterhält ein hausinternes Komitee zur Prüfung und Entscheidungsfindung zur Stimmrechtsausübung in allen signifikanten Portfolio-Gesellschaften. Das sogenannte Proxy-Voting-Komitee folgt bei der Stimmrechtsausübung maßgeblich den in der Anlagestrategie festgelegten Zielen und berücksichtigt bei der Analyse von Beschlussvorschlägen für Hauptversammlungen diverse Faktoren.

Die Talanx Investment Group hat den externen Dienstleister ISS-ESG mit der Analyse der Hauptversammlungs-Unterlagen sowie der Umsetzung des Abstimmungsverhaltens gemäß den „Continental Europe Proxy Voting Guidelines“ beauftragt. Vorschläge für das Abstimmungsverhalten auf Basis der Analysen werden in angemessenem Umfang überprüft, insbesondere ob im konkreten Fall für die Hauptversammlung ergänzende oder von der Stimmrechtspolitik der Talanx Investment Group abweichende Vorgaben erteilt werden sollten. Soweit dies in Ergänzung oder Abweichung von der Stimmrechtspolitik notwendig ist, erteilt die Talanx Investment Group konkrete Weisungen zu einzelnen Tagesordnungspunkten.

Um das Risiko des Entstehens von Interessenkonflikten zu reduzieren und gleichzeitig ihrer treuhänderischen Vermögensverwaltung neutral nachkommen zu können, unterhält die Talanx Investment Group in aller Regel keine Dienstleistungsbeziehungen mit Portfolio-Gesellschaften. Unabhängig davon hat die Talanx Investment Group etablierte Prozesse zur Identifizierung, Meldung sowie zum Umgang mit Interessenkonflikten eingerichtet. Alle potenziellen und tatsächlichen Interessenskonflikte sind in einem Register erfasst und werden kontinuierlich überprüft. Teil der Überprüfung ist dabei auch die Einschätzung hinsichtlich der Angemessenheit der eingeführten Maßnahmen zur Vermeidung von negativen Auswirkungen aus den identifizierten Interessenkonflikten.

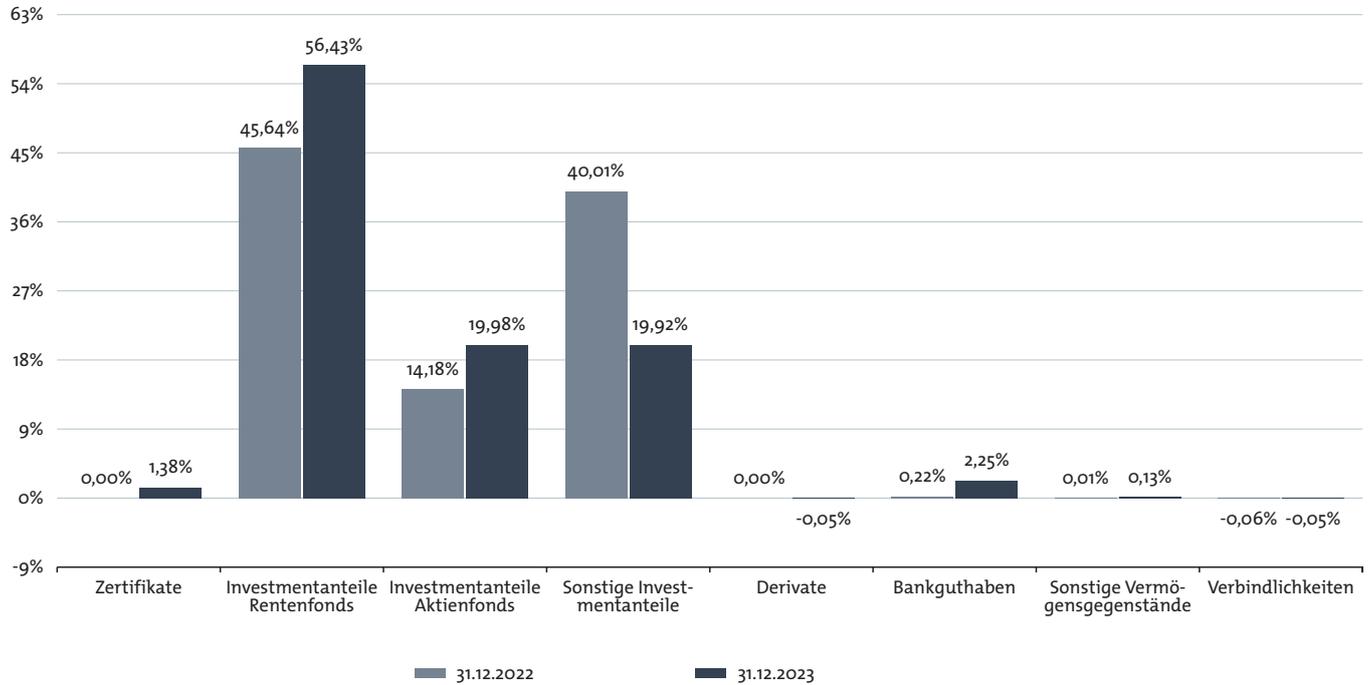
Insbesondere die Struktur des Vergütungssystems und die damit verbundenen variablen Bestandteile sind langfristig orientiert und stärken so eine dauerhafte und langfristig erfolgreiche Anlagestrategie im Sinne der Investoren.

Für Fonds- und Vermögensverwaltung in Aktien erfolgt die Vergütung der Talanx Investment Group nicht performanceabhängig, sondern aufwandsbezogen und marktgerecht in Basispunkten vom jeweils verwalteten Vermögen.

## Wesentliche Grundlagen des realisierten Ergebnisses

Gewinne und Verluste wurden während des Berichtszeitraumes aus der Veräußerung von Investmentanteilen realisiert.

### Struktur des Sondervermögens



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

**Vermögensübersicht zum 31.12.2023**

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Vermögensgegenstände</b>		
<b>Zertifikate</b>	<b>1.476.468,00</b>	<b>1,38</b>
Jersey	1.476.468,00	1,38
<b>Investmentanteile</b>	<b>102.853.559,11</b>	<b>96,33</b>
Geldmarktfonds	7.263.572,75	6,80
Geldmarktnahe Fonds	6.374.093,44	5,97
Aktienfonds	21.333.097,03	19,98
Gemischte Fonds	4.271.820,97	4,00
Rentenfonds	60.249.824,80	56,43
Alternative Investments <sup>1)</sup>	3.361.150,12	3,15
<b>Derivate</b>	<b>-48.887,08</b>	<b>-0,05</b>
Aktienindex-Derivate	-48.887,08	-0,05
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.404.780,30</b>	<b>2,25</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>141.803,35</b>	<b>0,13</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>	<b>-56.615,39</b>	<b>-0,05</b>
<b>Fondsvermögen</b>	<b>106.771.108,29</b>	<b>100,00<sup>2)</sup></b>

<sup>1)</sup> Z. B. Rohstoff-Fonds, Private-Equity-Fonds etc.

<sup>2)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

**Vermögensaufstellung zum 31.12.2023**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Vermögensgegenstände</b>									
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>							EUR	<b>1.476.468,00</b>	<b>1,38</b>
<b>Zertifikate</b>							EUR	<b>1.476.468,00</b>	<b>1,38</b>
Invesco Physical Gold ETC	IE00B579F325		STK	8.189	8.189	0	USD 200,2400	1.476.468,00	1,38
<b>Investmentanteile</b>							EUR	<b>95.589.986,36</b>	<b>89,53</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>							EUR	<b>95.589.986,36</b>	<b>89,53</b>
AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCITS ETF DR	LU2439113387		ANT	48.093	48.093	0	EUR 45,1840	2.173.034,11	2,04
AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB ETF	LU1602145036		ANT	752	1.255	503	USD 653,2000	442.289,21	0,41
Amundi BBG EW Commodity ex Ag UCITS ETF	LU1829218749		ANT	158.644	158.646	2	USD 23,5300	3.361.150,12	3,15
Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I	FR0007435920		ANT	572	862	312	EUR 11.143,5200	6.374.093,44	5,97
Amundi FTSE EPRA Nareit Global UCITS ETF-DR	LU1437018838		ANT	21.061	24.619	3.558	EUR 61,2140	1.289.228,05	1,21
Amundi Floating Rate Euro Corp 1-3 U ETF-C	LU1681041114		ANT	31.044	31.044	0	EUR 103,7200	3.219.883,68	3,02
Amundi Global Corp SRI 1-5Y UCITS ETF DR	LU1525418726		ANT	72.139	72.139	0	USD 56,3870	3.662.616,41	3,43
Amundi Index MSCI Japan SRI PAB ETF	LU2233156749		ANT	9.648	16.096	6.448	JPY 6.851,0810	422.602,32	0,40
Amundi Index MSCI World SRI UCITS ETF	LU1861134382		ANT	2.307	2.307	0	USD 97,0860	201.672,43	0,19
Amundi Index US Corp SRI ETF DR H Inc	LU2297533809		ANT	79.072	156.599	77.527	EUR 40,2120	3.179.643,26	2,98
Amundi S&P 500 Climate Net Z	IE000O5FBC47		ANT	55.066	55.066	0	USD 31,1700	1.545.477,42	1,45
Amundi-Index Barclays Euro AGG Ucits ETF	LU1437018168		ANT	63.481	82.634	19.153	EUR 50,4600	3.203.251,26	3,00
Anima-Star High Potential Europe-I	IE0032464921		ANT	338.408	183.183	0	EUR 9,4277	3.190.409,10	2,99
BNP PARIBAS EASY JPM ESG EMU Gov Bond IG UCITS ETF	LU1481202692		ANT	469.060	618.723	149.663	EUR 9,3601	4.390.448,51	4,11
BNP Paribas Easy FTSE EPRA Nareit Developed Europe	LU2008763935		ANT	375.349	642.295	266.946	EUR 7,4088	2.780.885,67	2,60
BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainabi	LU2365458814		ANT	150.895	150.895	0	EUR 8,1164	1.224.724,18	1,15

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
BNP Paribas Easy MSCI EMU ESG Filtered Min TE UCIT	LU1291098827		ANT	42.481	42.481	0 EUR	13,5060	573.748,39	0,54
BNP Paribas Easy MSCI Emerging SRI S-Series 5% Cap	LU1291098314		ANT	5.653	5.653	0 USD	137,1200	697.946,48	0,65
BNP Paribas Easy MSCI Japan ESG Filtered Min TE ET	LU1291102447		ANT	30.715	57.818	27.103 EUR	13,2674	407.508,19	0,38
BNY Mellon Global Funds - BNY Mellon US Municipal	IE00BDCJZ889		ANT	1.612.277	449.077	1.775.226 EUR	1,0071	1.623.724,17	1,52
Candriam SRI Bond Emerging Markets	LU1434519762		ANT	1.753	1.753	0 USD	852,3200	1.345.324,11	1,26
Fidelity Sustainable Research Enhanced Europe Equi	IE00BKSBGT50		ANT	71.882	0	161.268 EUR	7,8620	565.136,28	0,53
Fidelity Sustainable Research Enhanced Pacific EX-	IE00BNGFMY78		ANT	91.088	151.963	60.875 USD	5,5170	452.487,39	0,42
HSBC Discountstrukturen	DE000A0NA4K9		ANT	15.337	15.337	0 EUR	70,5100	1.081.411,87	1,01
Invesco MSCI Europe ESG Universal Screened UCITS E	IE00BJQRDL90		ANT	10.112	10.112	0 EUR	56,8500	574.867,20	0,54
Invesco MSCI USA ESG Climate Paris Aligned UCITS E	IE000RLUE8E9		ANT	357.430	476.658	119.228 USD	4,8770	1.569.589,51	1,47
Lyxor Euro Government Green Bond DR UCITS ETF	LU2356220926		ANT	578.656	663.089	84.433 EUR	7,6960	4.453.336,58	4,17
Mirova Funds - Mirova Global Green Bond Fund	LU1472740502		ANT	2.980	9.714	6.734 EUR	744,7200	2.219.265,60	2,08
PIMCO GIS Global Low Duration Real Return Fund	IE00BHZKQB61		ANT	164.041	189.800	131.216 EUR	10,5800	1.735.553,78	1,63
SPDR Refinitiv Global Convertible Bond UCITS ETF	IE00BNH72088		ANT	104.177	132.471	28.294 USD	45,7300	4.289.586,00	4,02
SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF	IE00BH4GPZ28		ANT	50.030	67.282	17.252 USD	33,8400	1.524.414,91	1,43
UBS Iri ETF plc - MSCI United Kingdom IMI Socially	IE00BMP3HN93		ANT	58.871	60.109	1.238 GBP	15,5130	1.049.972,20	0,98
UBS Iri ETF plc - S&P 500 ESG UCITS ETF	IE00BHXMH11		ANT	48.771	65.681	16.910 USD	34,6300	1.520.745,30	1,42
UBS Lux - Global Gender Equality UCITS ETF-A	IE00BDR5GV14		ANT	9.591	9.591	0 USD	18,5200	159.936,36	0,15
UBS Lux Fund Solutions - J.P. Morgan Global Govern	LU1974694553		ANT	153.523	264.877	111.354 EUR	10,5280	1.616.290,14	1,51
UBS Lux Fund Solutions - J.P. Morgan USD EM IG ESG	LU1974695790		ANT	116.158	192.142	75.984 USD	12,7320	1.331.643,85	1,25
UBS Lux Fund Solutions - Sustainable Develop. Bank	LU1852211215		ANT	524.349	656.204	131.855 USD	11,3970	5.380.880,20	5,04
UBS-MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	LU0629460675		ANT	5.054	5.054	0 EUR	109,1600	551.694,64	0,52
VanEck Vectors Global Real Estate UCITS ETF	NL0009690239		ANT	34.791	40.481	5.690 EUR	36,9270	1.284.727,26	1,20
Vanguard ESG Emerging Markets All Cap Equity Index	IE00BKV0W359		ANT	7.165	7.165	0 USD	109,4781	706.294,43	0,66
iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF	IE00BKM4GZ66		ANT	149	26.311	100.662 USD	31,8200	4.269,03	0,00
iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	IE00BJK55C48		ANT	534.002	960.952	426.950 EUR	5,1798	2.766.023,56	2,59
iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF	IE00BJP26D89		ANT	1.325.888	1.600.271	274.383 EUR	5,0090	6.641.372,99	6,22
iShares Euro Corp. Bond Int. Rate Hedged UCITS ETF	IE00B6X2VY59		ANT	25.204	25.204	0 EUR	95,1400	2.397.908,56	2,25
iShares Global Clean Energy UCITS ETF	IE00B1XNHC34		ANT	14.774	14.774	0 USD	9,0500	120.389,61	0,11
iShares Global Inflation Linked Govt Bond UCITS ET	IE00BKPT2S34		ANT	377.189	377.189	0 EUR	4,5509	1.716.549,42	1,61
iShares MSCI EM SRI UCITS ETF USD	IE00BYVJRP78		ANT	107.202	107.202	0 USD	6,9450	670.374,47	0,63
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF	IE00BHZPJ783		ANT	83.568	83.568	0 EUR	6,8820	575.114,98	0,54
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	IE00BHZPJ908		ANT	192.262	204.836	95.283 USD	8,6940	1.505.065,58	1,41

**Vermögensaufstellung zum 31.12.2023**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
iShares S&P Global Water 50 ETF	IE00B1TXK627		ANT	2.428	2.743	315 USD	62,5100	136.659,72	0,13
iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	IE00BJK55B31		ANT	334.608	761.216	426.608 USD	5,5720	1.678.764,43	1,57
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>97.066.454,36</b>	<b>90,91</b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>							EUR	<b>-48.887,08</b>	<b>-0,05</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>							EUR	<b>-48.887,08</b>	<b>-0,05</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>							EUR	<b>-48.887,08</b>	<b>-0,05</b>
Euro Stoxx 50 Future März 2024		EUREX	STK	-55				15.425,00	0,01
S&P 500 E-mini Future März 2024		CME	STK	-21				-64.312,08	-0,06
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							EUR	<b>9.668.353,05</b>	<b>9,06</b>
<b>Bankguthaben</b>							EUR	<b>2.404.780,30</b>	<b>2,25</b>
<b>EUR - Guthaben bei</b>							EUR	<b>673.881,77</b>	<b>0,63</b>
Verwahrstelle			EUR	673.881,77				673.881,77	0,63
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>							EUR	<b>20.740,45</b>	<b>0,02</b>
Verwahrstelle			GBP	18.040,04				20.740,45	0,02
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							EUR	<b>1.710.158,08</b>	<b>1,60</b>
Verwahrstelle			USD	1.486.265,51				1.338.254,55	1,25
Verwahrstelle			JPY	58.169.431,00				371.903,53	0,35
<b>Geldmarktfonds</b>							EUR	<b>7.263.572,75</b>	<b>6,80</b>
<b>Gruppenfremde Geldmarktfonds</b>							EUR	<b>7.263.572,75</b>	<b>6,80</b>
Institutional Cash Series - Euro Liquidity Fund	IE00B3L10570		ANT	71.591	71.591	0 EUR	101,4593	7.263.572,75	6,80
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	<b>141.803,35</b>	<b>0,13</b>
Forderungen aus Zielfonds ausschüttungen			EUR					141.803,35	0,13
<b>Sonstige Verbindlichkeiten<sup>1)</sup></b>							EUR	<b>-56.615,39</b>	<b>-0,05</b>
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	<b>106.771.108,29</b>	<b>100,00<sup>2)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>							EUR	<b>107,83</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							STK	<b>990.146</b>	
<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>97,71</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>									<b>-0,05</b>

<sup>1)</sup> Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren und Verwahrstellenvergütung

<sup>2)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

**Devisenkurse (in Mengennotiz) per 28.12.2023**

Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86980	= 1 (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	156,41000	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,11060	= 1 (EUR)

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

CME	Chicago Mercantile Exchange
EUREX	European Exchange Deutschland

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

Alle Vermögenswerte	per 28.12.2023 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>Investmentanteile</b>				
<b>Gruppeneigene Investmentanteile</b>				
Ampega BasisPlus Rentenfonds P (a)	DE000A2P2358	ANT	0	22.008
Ampega Reserve Rentenfonds I (a)	DE000A2H9A43	ANT	0	3.030
Tresides Commodity One A (a)	DE000A1W1MH5	ANT	0	5.633
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
Amundi Funds - Global Aggregate Bond	LU1883317858	ANT	0	2.079
Amundi Index MSCI Emerging Markets SRI UCITS ETF D	LU1861138961	ANT	14.262	14.262
BNP Easy Low Carbon 100 Europe UCITS ETF	LU1377382368	ANT	798	798
BNP Paribas Easy ECPI Circular Economy Leaders UCI	LU1953136527	ANT	9.058	9.058
CS Lux AgaNola Global Convertible Bond Fund	LU1732803868	ANT	0	1.789
ComStage ETFCommod ex-Agri. EW Index TR UCITS ETF	LU0419741177	ANT	0	17.873
EdR SICAV - Financial Bonds	FR0013233707	ANT	0	17.219
Franklin Templeton Investment Funds - Franklin Eur	LU0195952774	ANT	0	179.124
GS-US Real Estate Balanced Portfolio-IHA EUR	LU0883503087	ANT	15.089	18.008
Goldman Sachs - SICAV I - GS Global Credit Ptf Hed	LU0234688595	ANT	0	59.578
HMT Euro Aktien Seasonal	DE000A2QSGL6	ANT	0	3.859
HSBC Rendite Substanz IC	DE000A0NA4J1	ANT	3.896	26.049
INVESCO FTSE RAFI US 1000 ETF	IE00B23D8539	ANT	0	82.524
Invesco S&P 500 Invesco ETF	IE00B3YCGJ38	ANT	0	2.867
Janus Henderson Horizon Global HY Bond Fund H	LU1963063828	ANT	9.203	35.853
Loomis Sayles Sh. Term Em. Markets Bond H-I/A EUR	LU0980584436	ANT	5.129	52.777
Lyxor FTSE 100 UCITS ETF C	LU1650492173	ANT	0	53.949
Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB DR UCITS E	LU2198883410	ANT	73.435	73.435
Ninety One GSF - EM Investment Grade Corp Debt I	LU1275256334	ANT	6.719	56.015
Nordea 1 SICAV - Flexible Fixed Income Fund BI	LU0915363070	ANT	0	15.096
Nordea 1-Danish Covered Bond Fund BP	LU0173779223	ANT	0	28.313
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	LU0733665771	ANT	0	112.289
Quoniam Funds Selection SICAV - Euro Credit	LU0374936515	ANT	0	7.896
UBS Irl ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible U	IE00BDR55471	ANT	9.358	9.358
UBS Lux Fund Solutions - MSCI Japan Socially Respo	LU1230561679	ANT	34.631	34.631
Vanguard EUR Eurozone Government Bond UCITS ETF	IE00BH04GL39	ANT	0	139.149
Wellington Opportunistic Fixed Income Fund S	IE00BD960324	ANT	0	224.464
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF	LU0292107645	ANT	0	5.065
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	IE00B4L5YX21	ANT	18.103	31.922
iShares Core MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF	IE00B52MJY50	ANT	1.895	3.345
iShares DJ EURO STOXX 50 ETF	DE0005933956	ANT	0	23.215
iShares Euro Corporate Bond Large Cap UCITS ETF	IE0032523478	ANT	0	15.200
iShares Euro Government Bond 1-3Y ETF	IE00B14X4Q57	ANT	0	34.886
iShares European Property Yield UCITS ETF	IE00B0M63284	ANT	153.990	181.932
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	IE00BFM6TB42	ANT	216.625	1.010.476
iShares Global Infrastructure Ucits ETF	IE00B1FZ5467	ANT	0	7.147
iShares MSCI EMU UCITS ETF	IE00B53QG562	ANT	0	6.622
iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF	IE00BYXPS02	ANT	0	462.878
<b>Geldmarktfonds</b>				
<b>Gruppenfremde Geldmarktfonds</b>				
Lyxor Smart Overnight Return ETF Class C	LU1190417599	ANT	0	89.811
iShares eb.rexx Money Market (DE) ETF	DE000A0Q4RZ9	ANT	50.417	192.515

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>18.689</b>
(Basiswert(e): Euro Stoxx 50, Standard & Poor's 500)				

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

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 31.12.2023

	EUR	EUR
<b>I. Erträge</b>		
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		35.719,92
2. Erträge aus Investmentanteilen (vor Quellensteuer)		509.354,99
3. Abzug ausländischer Quellensteuer		-6.662,74
4. Sonstige Erträge		6.160,03
davon Erträge aus Bestandsprovisionen	6.160,03	
<b>Summe der Erträge</b>		<b>544.572,20</b>
<b>II. Aufwendungen</b>		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen		-7.811,95
2. Verwaltungsvergütung		-514.798,44
3. Verwahrstellenvergütung		-61.261,06
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten		-23.040,31
5. Sonstige Aufwendungen		-25.976,60
davon Depotgebühren	-23.457,63	
davon Negativzinsen Liquiditätsanlagen	-105,51	
davon Kosten Quellensteuerdienstleistungen	-1.164,81	
davon Kosten der Aufsicht	-1.248,65	
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-632.888,36</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>-88.316,16</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>		
1. Realisierte Gewinne		2.496.992,60
2. Realisierte Verluste		-4.201.212,93
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-1.704.220,33</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-1.792.536,49</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		3.529.431,95
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.711.353,78
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>6.240.785,73</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>4.448.249,24</b>

**Entwicklung des Sondervermögens**

für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 31.12.2023

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>91.488.087,47</b>
1. Ausschüttung für das Vorjahr		-176.540,00
2. Zwischenausschüttungen		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		10.763.277,53
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinkäufen	14.887.218,02	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	-4.123.940,49	
4. Ertragsausgleich / Aufwandsausgleich		248.034,05
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		4.448.249,24
davon nicht realisierte Gewinne	3.529.431,95	
davon nicht realisierte Verluste	2.711.353,78	
<b>II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>106.771.108,29</b>

**Verwendung der Erträge**

Berechnung der Ausschüttung

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
<b>I. Für Ausschüttung verfügbar</b>		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	2.420.731,07	2,4448223
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.792.536,49	-1,8103759
3. Zuführung aus dem Sondervermögen	0,00	0,0000000
<b>II. Nicht für Ausschüttung verwendet</b>		
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,0000000
2. Vortrag auf neue Rechnung	331.150,78	0,3344464
<b>III. Gesamtausschüttung</b>	<b>297.043,80</b>	<b>0,3000000</b>

(auf einen Anteilumlauf von 990.146 Stück)

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Fondsvermögen EUR	Anteilwert EUR
31.12.2023	106.771.108,29	107,83
31.12.2022	91.488.087,47	103,21
31.12.2021	38.453.550,95	112,80
31.12.2020	36.790.735,19	105,68

## Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivatverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	-48.887,08
Vertragspartner der Derivate-Geschäfte	Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Frankfurt am Main	

### Gesamtbetrag der im Zusammenhang mit Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten

davon:		
Bankguthaben	EUR	0,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	97,71
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,05

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz mit einem absoluten Value-at-Risk ermittelt.

### Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gemäß § 37 Absatz 4 DerivateVO

Kleinster potenzieller Risikobetrag	1,57 %
Größter potenzieller Risikobetrag	3,27 %
Durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	2,14 %

### Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateVO verwendet wurde

Multi-Faktor-Modell mit Monte Carlo Simulation

### Parameter, die gemäß § 11 DerivateVO verwendet wurden

Konfidenzniveau	99,00 %
Unterstellte Haltedauer	10 Tage
Länge der historischen Zeitreihe	504 Tagesrenditen
Exponentielle Gewichtung, Gewichtungsfaktor (entsprechend einer effektiven Historie von einem Jahr)	0,993

### Zusammensetzung des Vergleichsvermögens gemäß § 37 Absatz 5 DerivateVO

Absoluter VaR-Ansatz	100 %
----------------------	-------

### Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage

Leverage nach der Brutto-Methode gemäß Artikel 7 der Level II VO Nr. 231/2013.	102,82 %
--	----------

### Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	107,83
Umlaufende Anteile	STK	990.146

### 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 31. Dezember 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.

### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio [TER]) beträgt:

Ampega ISP Komfort	0,82 %
--------------------	--------

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Geschäftsjahr getragenen Kosten (ohne Transaktionskosten und ohne Performance Fee) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der über WM-Datenservice bzw. Basisinformationsblatt veröffentlichten TER oder Verwaltungskosten) der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

Der Anteil der erfolgsabhängigen Vergütung am durchschnittlichen Fondsvermögen beträgt:

Ampega ISP Komfort	0 %
--------------------	-----

Dieser Anteil berücksichtigt die vom Sondervermögen im Geschäftsjahr angefallene Performance-Fee im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens sowie die Performance-Fee der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

Die Ampega Investment GmbH gewährt sogenannte Vermittlungsprovision an Vermittler aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Im Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023 erhielt die Kapitalverwaltungsgesellschaft Ampega Investment GmbH für das Sondervermögen Ampega ISP Komfort keine Rückvergütung der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die wesentlichen sonstigen Erträge und sonstigen Aufwendungen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung dargestellt.

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände) im Geschäftsjahr gesamt: 42.237,83 EUR.

Bei einigen Geschäftsarten (u.a. Renten- und Devisengeschäfte) sind die Transaktionskosten als Kursbestandteil nicht individuell ermittelbar und daher in obiger Angabe nicht enthalten.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen: Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR Transaktionen.

#### Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

##### Verwaltungsvergütung der im Ampega ISP Komfort enthaltenen Investmentanteile:

Investmentanteile:	% p.a.
AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCITS ETF DR	0,16000
AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB ETF	0,20000
Ampega BasisPlus Rentenfonds P (a)	0,30000
Ampega Reserve Rentenfonds I (a)	0,20000
Amundi BBG EW Commodity ex Ag UCITS ETF	0,30000
Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I	0,17057
Amundi FTSE EPRA Nareit Global UCITS ETF-DR	0,24000
Amundi Floating Rate Euro Corp 1-3 U ETF-C	0,25000
Amundi Funds - Global Aggregate Bond	0,55000
Amundi Global Corp SRI 1-5Y UCITS ETF DR	0,20000
Amundi Index MSCI Emerging Markets SRI UCITS ETF D	0,25000
Amundi Index MSCI Japan SRI PAB ETF	0,18000
Amundi Index MSCI World SRI UCITS ETF	0,18000
Amundi Index US Corp SRI ETF DR H Inc	0,18000
Amundi S&P 500 Climate Net Z	0,07000
Amundi-Index Barclays Euro AGG Ucits ETF	0,14000
Anima-Star High Potential Europe-I	0,60000
BNP Easy Low Carbon 100 Europe UCITS ETF	0,18000
BNP PARIBAS EASY JPM ESG EMU Gov Bond IG UCITS ETF	0,03000
BNP Paribas Easy ECPI Circular Economy Leaders UCI	0,18000
BNP Paribas Easy FTSE EPRA Nareit Developed Europe	0,28000
BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainabi	0,13000
BNP Paribas Easy MSCI EMU ESG Filtered Min TE UCIT	0,03000
BNP Paribas Easy MSCI Emerging SRI S-Series 5% Cap	0,18000
BNP Paribas Easy MSCI Japan ESG Filtered Min TE ET	0,03000
BNY Mellon Global Funds - BNY Mellon US Municipal	k.A.
CS Lux AgaNola Global Convertible Bond Fund	0,34000
Candriam SRI Bond Emerging Markets	0,83000
ComStage ETFCommod ex-Agri. EW Index TR UCITS ETF	0,30000
EdR SICAV - Financial Bonds	1,10000
Fidelity Sustainable Research Enhanced Europe Equi	0,30000
Fidelity Sustainable Research Enhanced Pacific EX-	0,30000
Franklin Templeton Investment Funds - Franklin Eur	0,90000
GS-US Real Estate Balanced Portfolio-IHA EUR	0,55000
Goldman Sachs - SICAV I - GS Global Credit Ptf Hed	0,40000
HMT Euro Aktien Seasonal	1,60000
HSBC Discountstrukturen	0,37500
HSBC Rendite Substanz IC	0,30000
INVE스코 FTSE RAFI US 1000 ETF	0,39000
Institutional Cash Series - Euro Liquidity Fund	0,10000
Invesco MSCI Europe ESG Universal Screened UCITS E	0,16000
Invesco MSCI USA ESG Climate Paris Aligned UCITS E	0,09000
Invesco S&P 500 Invesco ETF	0,05000
Janus Henderson Horizon Global HY Bond Fund H	k.A.
Loomis Sayles Sh. Term Em. Markets Bond H-I/A EUR	k.A.
Lyxor Euro Government Green Bond DR UCITS ETF	0,20000

#### Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV

##### Verwaltungsvergütung der im Ampega ISP Komfort enthaltenen Investmentanteile:

Investmentanteile:	% p.a.
Lyxor FTSE 100 UCITS ETF C	0,14000
Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB DR UCITS E	0,07000
Lyxor Smart Overnight Return ETF Class C	0,05000
Mirova Funds - Mirova Global Green Bond Fund	0,50169
Ninety One GSF - EM Investment Grade Corp Debt I	k.A.
Nordea 1 SICAV - Flexible Fixed Income Fund BI	0,40000
Nordea 1-Danish Covered Bond Fund BP	0,60000
Nordea 1-European Covered Bond Fund AI EUR	0,30000
PIMCO GIS Global Low Duration Real Return Fund	0,49000
Quoniam Funds Selection SICAV - Euro Credit	0,35000
SPDR Refinitiv Global Convertible Bond UCITS ETF	0,50000
SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF	0,03000
Tresides Commodity One A (a)	1,50000
UBS Irl ETF plc - MSCI ACWI Socially Responsible U	0,25000
UBS Irl ETF plc - MSCI United Kingdom IMI Socially	0,51000
UBS Irl ETF plc - S&P 500 ESG UCITS ETF	0,10000
UBS Lux - Global Gender Equality UCITS ETF-A	0,20000
UBS Lux Fund Solutions - J.P. Morgan Global Govern	0,18000
UBS Lux Fund Solutions - J.P. Morgan USD EM IG ESG	0,40000
UBS Lux Fund Solutions - MSCI Japan Socially Respo	0,59000
UBS Lux Fund Solutions - Sustainable Develop. Bank	0,15000
UBS-MSCI EMU Socially Responsible UCITS ETF	0,48000
VanEck Vectors Global Real Estate UCITS ETF	0,25000
Vanguard ESG Emerging Markets All Cap Equity Index	0,25000
Vanguard EUR Eurozone Government Bond UCITS ETF	0,07000
Wellington Opportunistic Fixed Income Fund S	0,75000
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF	0,94000
iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF	0,43000
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	0,15000
iShares Core MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF	0,20000
iShares DJ EURO STOXX 50 ETF	0,09000
iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	0,25000
iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF	0,09000
iShares Euro Corp. Bond Int. Rate Hedged UCITS ETF	0,25000
iShares Euro Corporate Bond Large Cap UCITS ETF	0,20000
iShares Euro Government Bond 1-3Y ETF	0,15000
iShares European Property Yield UCITS ETF	0,40000
iShares Global Clean Energy UCITS ETF	0,65000
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	0,20000
iShares Global Inflation Linked Govt Bond UCITS ET	0,20000
iShares Global Infrastructure Ucits ETF	1,30000
iShares MSCI EM SRI UCITS ETF USD	0,25000
iShares MSCI EMU UCITS ETF	0,12000
iShares MSCI Europe ESG Enhanced UCITS ETF	0,12000
iShares MSCI USA ESG Enhanced UCITS ETF	0,07000
iShares S&P Global Water 50 ETF	1,30000
iShares USD High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	0,25000
iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF	0,07000
iShares eb.rexx Money Market (DE) ETF	0,30000

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeaufschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

**Angaben zur Mitarbeitervergütung**

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)	TEUR	10.426
davon feste Vergütung	TEUR	8.062
davon variable Vergütung	TEUR	2.365
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	TEUR	n.a.
Zahl der Mitarbeiter der KVG (ohne Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)		84
Höhe des gezahlten Carried Interest	TEUR	n.a.
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütungen an Risikoträger	TEUR	4.160
davon Geschäftsleiter	TEUR	1.526
davon andere Führungskräfte	TEUR	2.204
davon andere Risikoträger	TEUR	n.a.
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	TEUR	430
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe	TEUR	n.a.

Die Angaben zu den Vergütungen sind dem Jahresabschluss zum 31.12.2022 der KVG entnommen und werden aus den Entgeltabrechnungsdaten des Jahres 2022 ermittelt. Die Vergütung, die Risikoträger im Jahr von den anderen Gesellschaften des Talanx Konzerns erhielten, wurde bei der Ermittlung der Vergütungen einbezogen.

Gem. § 37 KAGB ist die Ampega Investment GmbH (nachfolgend Ampega) verpflichtet, ein den gesetzlichen Anforderungen entsprechendes Vergütungssystem einzurichten. Aufgrund dessen hat die Gesellschaft eine Vergütungsrichtlinie implementiert, die den verbindlichen Rahmen für die Vergütungspolitik und –praxis bildet, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich ist.

Die Vergütungspolitik orientiert sich an der Größe der KVG und der von ihr verwalteten Sondervermögen, der internen Organisation und der Art, dem Umfang und der Komplexität der von der Gesellschaft getätigten Geschäfte. Sie steht im Einklang mit der Geschäftsstrategie, den Zielen, Werten und Interessen der Ampega, der von ihr verwalteten Sondervermögen sowie der Anleger solcher Sondervermögen und umfasst auch Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten.

Die Vergütungsrichtlinie enthält im Einklang mit den gesetzlichen Regelungen insbesondere detaillierte Vorgaben im Hinblick auf die allgemeine Vergütungspolitik sowie Regelungen für fixe und variable Gehälter und Informationen darüber, welche Mitarbeiter, deren Tätigkeit einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der KVG und der von ihr verwalteten Investmentvermögen haben (Risk Taker) in diese Vergütungsrichtlinie einbezogen sind.

Zur Grundvergütung können Mitarbeiter und Geschäftsleiter eine leistungsorientierte Vergütung zzgl. weiterer Zuwendungen (insbes. Dienstwagen) erhalten. Das Hauptaugenmerk des variablen Vergütungsbestandteils liegt bei der Ampega auf der Erreichung individuell festgelegter, qualitativer und/oder quantitativer Ziele. Zur langfristigen Bindung und Schaffung von Leistungsanreizen wird ein wesentlicher Anteil des variablen Vergütungsbestandteils mit einer Verzögerung von vier Jahren ausbezahlt.

Mit Hilfe der Regelungen wird eine solide und umsichtige Vergütungspolitik betrieben, die zu einer angemessenen Ausrichtung der Risiken führt und einen angemessenen und effektiven Anreiz für die Mitarbeiter schafft.

Die Vergütungsrichtlinie wurde von dem Aufsichtsrat und der Geschäftsführung der Ampega Investment GmbH beschlossen und unterliegt der jährlichen Überprüfung. Zudem hat die Ampega einen Vergütungsausschuss im Aufsichtsrat der Gesellschaft eingerichtet, der sich mit den besonderen Anforderungen an das Vergütungssystem auseinandersetzt und sich mit den entsprechenden Fragen befasst.

Das Vergütungssystem setzt keine Anreize Nachhaltigkeitsrisiken einzugehen.

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik durch die Gesellschaft hat ergeben, dass Änderungen der Vergütungspolitik nicht erforderlich sind.

Wesentliche Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik gem. § 101 KAGB fanden daher im Berichtszeitraum nicht statt.

**Angaben zur Transparenz gemäß Verordnung (EU) 2020/852 bzw. Angaben nach Art. 11 Offenlegungsverordnung**

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen.

Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Weitergehende Informationen zum Umgang mit ökologischen und sozialen Merkmalen sind im Annex „Anhang gemäß Offenlegungsverordnung“ enthalten, der dem Anhang als Anlage beigefügt ist.

Die Verordnung (EU) 2019/2088 und die Verordnung (EU) 2020/852 sowie die diese konkretisierenden Delegierten Rechtsakte der Europäischen Kommission enthalten Formulierungen und Begriffe, die erheblichen Auslegungsunsicherheiten unterliegen und für die noch keine maßgebenden umfassenden Interpretationen veröffentlicht wurden. Da solche Formulierungen und Begriffe unterschiedlich ausgelegt werden können, ist nicht auszuschließen, dass die von uns gewählten Auslegungen durch den Regulator oder Gerichte abweichend beurteilt werden könnten. Darüber hinaus weisen wir darauf hin, dass auch die Quantifizierung nachhaltigkeitsbezogener Angaben, wie z.B. die Angaben zum Umfang nachhaltiger Investments, inhärenten Unsicherheiten unterliegen. Trotz sorgfältigster Auswahl aller von uns verwendeten internen und externen Quellen, kann es zu Abweichungen in der Bewertung der sozialen und ökologischen Merkmale kommen.

## Anhang gemäß Offenlegungsverordnung

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts

Ampega ISP Komfort

Unternehmenskennung (LEI-Code)

unknown

## Ökologische- und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31,83% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieses Finanzprodukt trägt zu keinem Umweltziel im Sinne von Art. 9 der Taxonomieverordnung bei.

Der Fonds wurde unterjährig zum 01.06.2023 von einem Art. 6 Fonds zu einem Art. 8 Fonds umklassifiziert.

Der Ampega ISP Sprint ist ein Mischfonds und strebt als Anlageziel die Erwirtschaftung einer attraktiven, risikoadjustierten Wertentwicklung unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitskriterien an.

Die Auswahl der Vermögensgegenstände erfolgte nach dem sog. Better-than-Average Ansatz. Danach werden Zielfonds ausgewählt, die bei gleichen sonstigen Merkmalen unter Nachhaltigkeitsgesichtspunkten besser abschneiden als der Durchschnitt ihrer Wettbewerber. Für die Beurteilung der Nachhaltigkeit eines Zielfonds werden Daten externer ESG-Datenanbieter genutzt. Diese aggregieren zahlreiche Nachhaltigkeitsmerkmale der vom Zielfonds gehaltenen Investments zu einer Gesamteinstufung, die sich mit derjenigen anderer Zielfonds vergleichen lässt.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft erwarb unter Berücksichtigung der vorstehenden Kriterien keine feststehende Auswahl von Vermögensgegenständen innerhalb einer Branche oder eines Sektors, sondern kann Über- und Untergewichtungen einzelner Branchen oder Sektoren vornehmen. Dies kann dazu führen, dass einzelne Branchen oder Sektoren bei der Auswahl der Vermögensgegenstände nicht berücksichtigt werden, während aus anderen Branchen oder Sektoren bei entsprechend positiver Beurteilung durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft eine Vielzahl von Vermögensgegenständen ausgewählt wird.

Dabei galten Investmentanteile als investierbar, wenn Sie unter Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsmerkmalen verwaltet werden. Hierzu wurde auf Grund von internen Recherchen und Analysen oder unter Verwendung von ESG-Ratings in Zielfonds investiert, die die von der Gesellschaft definierten Nachhaltigkeitsmerkmale erfüllen und die Zielfonds sich an im Verkaufsprospekt genannten Ausschlüssen orientieren.

Konkret folgte die Investition in Zielfonds dem Leitmotiv der Positivkriterien. Das heißt, je niedriger der ESG-Risk-Score für ein Zielfonds ausfällt, desto positiver ist es im Sinne der Nachhaltigkeit. Auf diese Weise können Branchen unabhängig von der Allokation (typischerweise über Negativkriterien determiniert) über eine positive ESG-Selektion angesteuert werden. Dies führt dazu, dass das investierte Portfolio eine positive ESG-Attribution im Vergleich zum Anlageuniversum ausweisen soll. Im Speziellen werden im Sinne einer Quantifizierung im ESG Risk-Score eine Vielzahl an Kriterien der ESG-Güte zugrunde gelegt (von 0 (höchste Ausprägung) bis 100 (niedrigste Ausprägung)). Das Nachhaltigkeits-Profil des investierten Portfolios sollte hierbei unter 30 betragen, d.h. einem ESG Risiko der Kategorien „Negligible Risk“, „Low Risk“ oder „Medium Risk“ entsprechend. Die Einhaltung des Nachhaltigkeits-Profiles wird dabei auf regelmäßiger Basis im ESG-Committee überprüft.

Somit soll sichergestellt werden, dass das investierte Portfolio in Bezug auf die Nachhaltigkeitskriterien überdurchschnittlich aufgestellt ist („Better-than-Average“).

## ● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

### Indikator

ESG Risk Score

### Beschreibung

Das ESG-Risiko-Rating (ESG Risk Score) bewertet Investitionen von Zielfonds in Unternehmen und Staaten sowie branchenspezifische Risiken in den Bereichen Umwelt (Environmental), Soziales (Social) und verantwortungsvolle Unternehmensführung (Governance). Der ESG Risk Score setzt sich dabei sowohl aus dem Corporate und Sovereign Risk Score zusammen. Hierbei werden Unternehmen und Staaten durch einen Drittanbieter bewertet und durch den Score eine Vergleichbarkeit hergestellt.

### Methodik

Die Skala läuft von 0 bis 100 Punkten (Scores): 0 ist dabei die beste Bewertung, 100 die schlechteste. Die Unternehmen werden anhand ihrer Scores in fünf Risikokategorien gruppiert, beginnend beim geringsten Risiko „Negligible“ (0 – 10 Punkte) bis zu „Severe“ (über 40 Punkte), der schlechtesten Bewertung. Zielfonds sind damit auch über unterschiedliche Branchen vergleichbar.

## ● Nachhaltigkeitsindikatoren zum Geschäftsjahresende

Referenzstichtag	31.12.2023
ESG Risk Score	12,33

Bei den **wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

## ● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nachhaltige Investitionen gemäß Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung sind Investitionen in wirtschaftliche Tätigkeiten, die zur Erreichung eines Umwelt- oder Sozialziels beitragen. Die Berechnung der nachhaltigen Investitionen gem. Art.2 Nr.17 der Offenlegungsverordnung erfolgt anhand eines individuellen Ansatzes der Gesellschaft und unterliegt daher inhärenten Unsicherheiten.

Nachhaltige Investitionen, die zur Erreichung eines Umweltziels beitragen, werden beispielsweise gemessen an Schlüsselindikatoren für Ressourceneffizienz bei der Nutzung von Energie, erneuerbarer Energie, Rohstoffen, Wasser und Boden, für die Abfallerzeugung, und Treibhausgasemissionen oder für die Auswirkungen auf die biologische Vielfalt und die Kreislaufwirtschaft.

Unter nachhaltigen Investitionen, die zur Erreichung eines sozialen Zieles beitragen, werden beispielsweise Investitionen, die zur Bekämpfung von Ungleichheiten beitragen oder den sozialen Zusammenhalt, die soziale Integration und die Arbeitsbeziehungen fördern oder Investitionen in Humankapital oder zugunsten wirtschaftlich oder sozial benachteiligter Bevölkerungsgruppen, vorausgesetzt, dass diese Investitionen keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigen und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden, insbesondere bei soliden Managementstrukturen, den Beziehungen zu den Arbeitnehmern, der Vergütung von Mitarbeitern sowie der Einhaltung

der Steuervorschriften.

Zusätzlich können auch taxonomiekonforme Investitionen in Betracht gezogen werden.

Die Bewertung der Investitionen basiert auf Informationen von spezialisierten externen Datenanbietern sowie auf eigenen Analysen.

Zur Bestimmung der Mindestquote an nachhaltigen Investitionen werden die für die Zielfonds definierten Mindestquoten mit den Portfoliogewichten aggregiert und daraus die Gesamtquote berechnet.

**Der Beitrag zu folgenden Zielen wird betrachtet:**

Ökologische Ziele:

Nachhaltige Land- und Forstwirtschaft, Wassereinsparung, Beitrag zur nachhaltigen Energienutzung, Förderung von nachhaltigen Gebäuden, Optimierung des Materialeinsatzes, Abschwächung des Klimawandels, Erhaltung der Meeresökosysteme, Erhalt der terrestrischen Ökosysteme

Soziale Ziele:

Linderung der Armut, Bekämpfung von Hunger und Unterernährung, Sicherstellung der Gesundheit, Bereitstellung von Bildung, Verwirklichung der Gleichstellung der Geschlechter, Bereitstellung von Basisdienstleistungen, Sicherung des Friedens.

**Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Im Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und / oder sozialen Merkmale ergriffen?“ werden Ausschlusskriterien definiert, um die Emittenten von vornherein auszuschließen, die den Grundsätzen zur Nachhaltigkeit („ESG“) nur unzureichend Rechnung tragen. Hierdurch ist sichergestellt, dass keines der in Art. 2 Nr. 17 der Offenlegungsverordnung genannten Umwelt- und Sozialziele bzw. in Art. 9 der Verordnung (EU) 2020/852 („Taxonomieverordnung“) genannten Umweltziele erheblich beeinträchtigt wird.

**Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

Im Rahmen der Auswahl der Vermögensgegenstände wurde geprüft, ob die Gewinnerzielung im Einklang mit der Deklaration der Menschenrechte der Vereinten Nationen stand sowie mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen. Die Gesellschaft ist außerdem Unterzeichner der Principles for Responsible Investment (PRI) und verpflichtet sich damit zum Ausbau nachhaltiger Geldanlagen und zur Einhaltung der sechs, durch die UN aufgestellten Prinzipien für verantwortliches Investieren.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



#### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Steuerung nach den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impact) ist in diesem Fonds kein Bestandteil der Anlagestrategie.



#### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Zu den Hauptinvestitionen zählen die 15 Positionen des Wertpapiervermögens mit dem höchsten Durchschnittswert der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.01.2023 - 31.12.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
iShares eb.rexx Money Market (DE) ETF (DE000A0Q4RZ9)	Treuhand- und sonstige Fonds	4,97%	Deutschland
Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I (FR0007435920)	Treuhand- und sonstige Fonds	4,94%	Frankreich
UBS Lux Fund Solutions - Sustainable Develop. Bank (LU1852211215)	Treuhand- und sonstige Fonds	3,28%	Luxemburg
Lyxor Smart Overnight Return ETF Class C (LU1190417599)	Treuhand- und sonstige Fonds	3,11%	Luxemburg
Institutional Cash Series - Euro Liquidity Fund (IE00B3L10570)	Treuhand- und sonstige Fonds	3,03%	Irland
SPDR Refinitiv Global Convertible Bond UCITS ETF (IE00BNH72088)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,97%	Irland
Amundi BBG EW Commodity ex Ag UCITS ETF (LU1829218749)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,74%	Luxemburg
BNP PARIBAS EASY JPM ESG EMU Gov Bond IG UCITS ETF (LU1481202692)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,57%	Luxemburg

iShares EUR Ultrashort Bond ESG UCITS ETF (IE00BJP26D89)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,56%	Irland
Amundi Index US Corp SRI ETF DR H Inc (LU2297533809)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,43%	Luxemburg
Anima-Star High Potential Europe-I (IE0032464921)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,43%	Irland
Amundi-Index Barclays Euro AGG Ucits ETF (LU1437018168)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,14%	Luxemburg
BNP Paribas Easy FTSE EPRA Nareit Developed Europe (LU2008763935)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,12%	Luxemburg
BNY Mellon Global Funds - BNY Mellon US Municipal (IE00BDCJZ889)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,06%	Irland
Loomis Sayles Sh. Term Em. Markets Bond H-I/ A EUR (LU0980584436)	Treuhand- und sonstige Fonds	2,01%	Luxemburg



### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

#### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

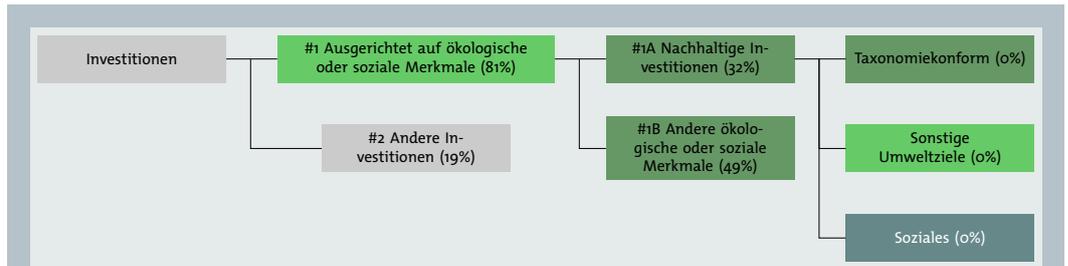
Die Vermögensgegenstände des Fonds werden in nachstehender Grafik in verschiedene Kategorien unterteilt. Der jeweilige Anteil am Fondsvermögen wird in Prozent dargestellt. Mit „Investitionen“ werden alle für den Fonds erwerbbaaren Vermögensgegenstände erfasst.

Die Kategorie „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst diejenigen Vermögensgegenstände, die im Rahmen der Anlagestrategie zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt werden.

Die Kategorie „#2 Andere Investitionen“ umfasst z. B. Derivate, Bankguthaben oder Finanzinstrumente, für die nicht genügend Daten vorliegen, um sie für die nachhaltige Anlagestrategie des Fonds bewerten zu können.

Die Kategorie „#1A Nachhaltige Investitionen“ umfasst nachhaltige Investitionen gemäß Artikel 2 Ziffer 17 der Offenlegungsverordnung. Dies beinhaltet Investitionen, mit denen „Taxonomiekonforme“ Umweltziele, „Sonstige Umweltziele“ und soziale Ziele („Soziales“) angestrebt werden können. Die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst Investitionen, die zwar auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet sind, sich aber nicht als nachhaltige Investition qualifizieren.

Eine Aufteilung der nachhaltigen Investitionen in ökologisch nachhaltige und sozial nachhaltige Investitionen ist uns aktuell nicht möglich.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorie(n):

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Es wird für alle Positionen des Wertpapiervermögens der Durchschnitt der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage je Wirtschaftssektor gebildet. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

Branche	Anteil
Treuhand- und sonstige Fonds	94,12%
Fondsmanagement	1,79%
Nichtlebensversicherungen	1,46%
Erbringung von sonstigen Finanzdienstleistungen	0,90%



### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hat keine nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel nach EU-Taxonomieverordnung getätigt. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.

**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

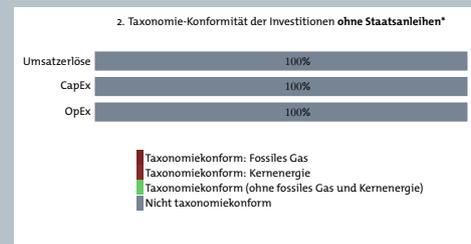
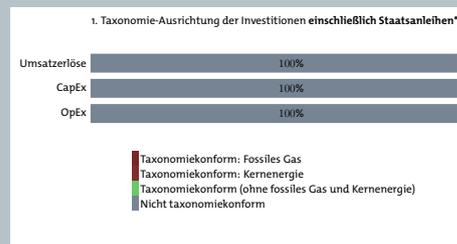
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Für diesen Fonds wurden keine Investitionen getätigt, die in Übergangstätigkeiten oder ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



#### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nachhaltige Investitionen werden als Beitrag zu den 17 Nachhaltigkeitszielen der Vereinten Nationen (SDGs) gemessen. Da diese sowohl ökologische als auch soziale Ziele umfassen, ist die Festlegung von spezifischen Mindestanteilen für jeweils ökologische und soziale Investitionen im Einzelnen nicht möglich. Der Gesamtanteil nachhaltiger Investitionen bezogen auf Umwelt- und Sozialziele des Fonds kann der Grafik unterhalb der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ unter #1A entnommen werden.



#### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nachhaltige Investitionen werden als Beitrag zu den 17 Nachhaltigkeitszielen der Vereinten Nationen (SDGs) gemessen. Da diese sowohl ökologische als auch soziale Ziele umfassen, ist die Festlegung von spezifischen Mindestanteilen für jeweils ökologische und soziale Investitionen im Einzelnen nicht möglich. Der Gesamtanteil nachhaltiger Investitionen bezogen auf Umwelt- und Sozialziele des Fonds kann der Grafik unterhalb der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ unter #1A entnommen werden.



#### Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter #2 „Andere Investitionen“ fielen Investitionen, die nicht zu ökologischen oder sozialen Merkmalen beitragen. Hierunter fallen beispielsweise Derivate, Investitionen zu Diversifikationszwecken, Investitionen, für die keine Daten vorliegen, oder Barmittel zur Liquiditätssteuerung. Beim Erwerb dieser Vermögensgegenstände wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



#### Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Bei der Auswahl von Direktinvestments galt das Folgende:

Investitionen in Unternehmen, die einen Umsatzanteil von mehr als 10% aus der Energiegewinnung oder dem sonstigen Einsatz von fossilen Brennstoffen (exklusive Gas und Atomstrom) generieren, wurden ausgeschlossen. Gleiches galt für Emittenten, die einen Umsatzanteil von mehr als 10% aus der Förderung von Kohle und Erdöl erzielen. In Unternehmen, die mehr als 10% ihrer Umsätze aus dem Abbau, der Exploration und Dienstleistungen für Ölsand und Ölschiefer erzielen, wurde nicht investiert. Unternehmen, die gegen den UN-Global Compact verstoßen, galten als nicht investierbar. Abgedeckt wurden in diesem Zusammenhang auch die Themenbereiche Zwangsarbeit, Kinderarbeit und Diskriminierung. Als Bewertungsrichtlinien für Kontroversen im Bereich der Umweltprobleme werden u.a. das Prinzip der besten verfügbaren Technik (BVT) sowie internationale Umweltgesetzgebungen herangezogen. Investitionen in Unternehmen, die im Zusammenhang mit geächteten Waffen (gemäß „Ottawa-Konvention“, „Oslo Konvention“ und den UN-Konventionen „UN BWC“, „UN CWC“) stehen, wurden nicht getätigt. Bei Investitionen in Staaten wurden Länder mit einer niedrigen Nachhaltigkeitsbewertung (Länder, die in die letzte Kategorie im Ranking externer Datenanbieter fallen) ausgeschlossen. Die Länderrisikobewertung deckt 170 Länder ab und basiert auf mehr als 40 Indikatoren, die unter anderem der Weltbank oder den

Vereinten Nationen entnommen sind. Dimensionen der Bewertung umfassen Umwelt-, Soziale- und Regierungsaktivitäten, die internationalen Konventionen und Normen entsprechen. Hierfür analysiert der Datenanbieter relevante Kontroversen, wie beispielsweise Versammlungs- und Vereinigungsfreiheit, Korruption, Umweltverschmutzung oder Meinungsfreiheit. Außerdem werden der Schutz der Menschenrechte, gesellschaftliches Engagement, Einhaltung der Datenschutzregelungen, Schutz der Minderheiten, Pressefreiheit und Rechtsstaatlichkeit, sowie Grundsätze für Produktsicherheit und die Möglichkeit zur politischen Einflussnahme und Transparenz berücksichtigt. Staaten, die gegen globale Normen wie den „Freedom House Index“ verstoßen, wurden zudem ausgeschlossen.

Bei der Zielfondsauswahl erfolgte eine Beachtung an den genannten Ausschlusskriterien, um darauf hinzuwirken, dass in den Zielfondsinvestments die Emittenten von vornherein ausgeschlossen sind, die den Grundsätzen zur Nachhaltigkeit („ESG“) nur unzureichend Rechnung tragen. Über die Zielfondsdurchschau des ESG-Datenanbieters hinaus erfolgte keine weitere Zielfondsdurchschau durch die Gesellschaft selbst. Es wurde zu mindestens 75 % in Zielfonds investiert, die nach Artikel 2 Nr. 7 der delegierten Verordnung (EU) 2017/565 (geändert durch Delegierte Verordnung 2021/1253) eines der folgenden Kriterien vorweisen oder einer Kombination dessen entsprechen:

(a) Mindestanteil in ökologisch nachhaltige Investitionen im Sinne von Artikel 2 Nummer 1 der Verordnung (EU) 2020/852;

(b) Mindestanteil in nachhaltige Investitionen im Sinne von Artikel 2 Nummer 17 der Verordnung (EU) 2019/2088;

(c) Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

Hierdurch wurde sichergestellt, dass keines der in Art. 2 Nr. 17 der Verordnung (EU) 2019/2088 genannten Umwelt- und Sozialziele bzw. in Art. 9 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Umweltziele erheblich beeinträchtigt wird.

Mit dem Fonds wurden darüber hinaus nachhaltige Investitionen in Höhe von 5% angestrebt. Nachhaltige Investitionen sind gemäß Artikel 2 Ziff. 17 der Offenlegungsverordnung Investitionen in wirtschaftliche Tätigkeiten, die zur Erreichung eines Umwelt- oder Sozialziels beitragen.



**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

- Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

---

Köln, den 18. April 2024

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

## Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die Ampega Investment GmbH, Köln

### Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht nach § 7 KARBV des Sondervermögens Ampega ISP Komfort – bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang – geprüft. Die Angaben gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie gemäß Artikel 5 bis 7 der Verordnung (EU) 2020/852 in Abschnitt „Anhang gemäß Offenlegungsverordnung“ des Anhangs sind im Einklang mit den deutschen gesetzlichen Vorschriften nicht Bestandteil der Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht nach § 7 KARBV in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV erstreckt sich nicht auf den Inhalt der Angaben gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie gemäß Artikel 5 bis 7 der Verordnung (EU) 2020/852 in Abschnitt „Anhang gemäß Offenlegungsverordnung“ des Anhangs.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Ampega Investment GmbH (im Folgenden die

„Kapitalverwaltungsgesellschaft“) unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV zu dienen.

### Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die Angaben gemäß Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie gemäß Artikel 5 bis 7 der Verordnung (EU) 2020/852 in Abschnitt „Anhang gemäß Offenlegungsverordnung“ des Anhangs des Jahresberichts nach § 7 KARBV.

Die sonstigen Informationen umfassen zudem die übrigen Teile der Publikation „Jahresbericht“ – ohne weitergehende Querverweise auf externe Informationen –, mit Ausnahme des geprüften Jahresberichts nach § 7 KARBV sowie unseres Vermerks.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht nach § 7 KARBV oder unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht nach § 7 KARBV

Die gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung dieser Vorschrif-

ten ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts nach § 7 KARBV zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Investmentvermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet unter anderem, dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV die Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

#### *Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV*

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts nach § 7 KARBV getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht nach § 7 KARBV, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Kapitalverwaltungsgesellschaft abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Kapitalverwaltungsgesellschaft bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht nach § 7 KARBV aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts nach § 7 KARBV insgesamt einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.
- Frankfurt am Main, den 18. April 2024  
PricewaterhouseCoopers GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
Anita Dietrich  
Wirtschaftsprüfer
- Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.
- ppa. Felix Schneider  
Wirtschaftsprüfer

# 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 31.12.2023)  
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, Köln

Dr. Dirk Erdmann  
Mitglied der Geschäftsführung der  
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Stefan Kampmeyer  
Mitglied der Geschäftsführung der  
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

## Verwahrstelle

Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG  
Kaiserstr. 24  
60311 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).

## 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.

---

# Besonderheiten für Anleger aus Österreich

## Zahl- und Informationsstelle

(Einrichtung gem. Artikel 92 der OGAW-Richtlinie in der Änderungsfassung auf Grund der Richtlinie (EU) 2019/116)

Schelhammer Capital Bank AG  
Burgring 16  
8010 Graz  
Österreich

## Steuerlicher Vertreter

Deloitte Tax Wirtschaftsprüfungs GmbH  
Renngasse 1/Freyung  
1010 Wien  
Österreich

Der Fonds wird in Österreich ausschließlich über konzessionierte Banken, konzessionierte Wertpapierfirmen und/oder konzessionierte Wertpapierdienstleistungsunternehmen vertrieben. Rücknahmeanträge können bei der österreichischen Zahlstelle eingereicht werden. Die Rückkäufe können elektronisch (bei angebundenen Drittbanken) oder schriftlich erteilt werden. Die Rücknahmeerlöse werden vollautomatisiert den definierten Referenzkonten gutgeschrieben.

Gültige Verkaufsprospekte nebst Fondsanlagebedingungen, Jahres und Halbjahresberichte sowie ggf. weitere Fondsunterlagen sind bei der Zahl- und Informationsstelle erhältlich. Diese Unterlagen sowie weitere Hinweise finden Sie auch auf der Homepage der Gesellschaft ([www.ampega.com](http://www.ampega.com)). Änderungen der Fondsbestimmungen sowie weitere Informationen zu den Anlegerrechten werden von der Gesellschaft anlassbezogen per dauerhaftem Datenträger, unter Einbeziehung der depotführenden Stellen, unmittelbar an die Anleger versandt.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden börsentäglich auf der Homepage der Gesellschaft ([www.ampega.com](http://www.ampega.com)) veröffentlicht. Gerichtsstand für Klagen gegen die Gesellschaft, die auf den Vertrieb der Investmentanteile in Österreich Bezug haben, ist Wien. In Ergänzung zum Hinweis nach § 305 KAGB im Verkaufsprospekt (Widerrufsrechte bei „Haustürgeschäften“) gilt, dass für österreichische Anleger § 3 KSchG anzuwenden ist.

Beschwerden im Zusammenhang mit dem Erwerb der Investmentanteile können direkt bei der Gesellschaft unter der E-Mail-Adresse [fonds@ampega.com](mailto:fonds@ampega.com) platziert werden. Die Gesellschaft fungiert auch als Kontaktstelle für die Kommunikation mit der jeweils zuständigen Behörde.



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)