

Halbjahresbericht

Equity Risk Control AMI

1. Dezember 2023 bis 31. Mai 2024

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 31.05.2024

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	65.768.475,69	97,42
Australien	903.534,19	1,34
Deutschland	2.445.110,07	3,62
Dänemark	737.591,51	1,09
Frankreich	1.927.694,00	2,86
Großbritannien	2.249.584,67	3,33
Irland	2.549.098,49	3,78
Italien	343.530,00	0,51
Japan	1.998.117,94	2,96
Kanada	2.574.097,33	3,81
Niederlande	925.050,00	1,37
Norwegen	928.072,37	1,37
Schweden	491.672,53	0,73
Schweiz	1.339.826,64	1,98
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	46.355.495,95	68,67
Sonstige Beteiligungswertpapiere	582.713,10	0,86
Schweiz	582.713,10	0,86
Bankguthaben	1.124.018,36	1,67
Sonstige Vermögensgegenstände	62.236,34	0,09
Verbindlichkeiten	-29.109,08	-0,04
Fondsvermögen	67.508.334,41	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	66.351.188,79	98,29
Aktien						EUR	65.768.475,69	97,42
Australien						EUR	903.534,19	1,34
Commonwealth Bank of Australia	AU000000CBA7	STK	12.500	0	1.880	AUD 117,9900	903.534,19	1,34
Deutschland						EUR	2.445.110,07	3,62
BASF SE	DE000BASF111	STK	11.729	0	2.000	EUR 48,0800	563.930,32	0,84
Deutsche Telekom AG	DE0005557508	STK	27.157	0	0	EUR 22,0100	597.725,57	0,89
SAP SE	DE0007164600	STK	3.121	0	0	EUR 168,5800	526.138,18	0,78
Siemens AG	DE0007236101	STK	4.300	0	1.700	EUR 176,1200	757.316,00	1,12
Dänemark						EUR	737.591,51	1,09
Novo-Nordisk AS B Shares	DK0062498333	STK	6.000	0	0	DKK 916,9000	737.591,51	1,09
Frankreich						EUR	1.927.694,00	2,86
Hermes International SA	FR0000052292	STK	300	0	0	EUR 2.171,0000	651.300,00	0,96
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	FR0000121014	STK	1.135	0	0	EUR 734,4000	833.544,00	1,23
Sanofi SA	FR0000120578	STK	5.000	5.000	0	EUR 88,5700	442.850,00	0,66
Großbritannien						EUR	2.249.584,67	3,33
AstraZeneca PLC	GB0009895292	STK	3.370	0	0	GBP 120,2800	476.376,03	0,71
Diageo PLC	GB0002374006	STK	12.000	0	0	GBP 26,0200	366.956,95	0,54
GSK PLC	GB00BN75WP63	STK	30.535	0	0	GBP 17,3000	620.827,02	0,92
Prudential PLC	GB0007099541	STK	38.000	0	0	GBP 7,5000	334.943,41	0,50
Unilever PLC	GB00B10RZP78	STK	9.000	2.444	0	GBP 42,5900	450.481,26	0,67
Irland						EUR	2.549.098,49	3,78
Accenture Ltd.	IE00B4BNMY34	STK	2.133	0	0	USD 284,8000	560.301,05	0,83
Aon Plc A	IE00BLP1HW54	STK	2.700	0	0	USD 276,9100	689.593,25	1,02
Linde PLC	IE00059Y5762	STK	2.338	0	0	USD 430,1100	927.501,55	1,37

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Medtronic PLC	IE00BTN1Y115	STK	5.000	1.400	0	USD 80,6000	371.702,64	0,55
Italien						EUR	343.530,00	0,51
Terna SpA	IT0003242622	STK	45.000	0	0	EUR 7,6340	343.530,00	0,51
Japan						EUR	1.998.117,94	2,96
Honda Motor Co Ltd.	JP3854600008	STK	45.402	0	0	JPY 1.730,5000	462.846,31	0,69
Nintendo Co. Ltd.	JP3756600007	STK	11.660	0	0	JPY 8.358,0000	574.104,74	0,85
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	JP3463000004	STK	15.665	0	0	JPY 4.096,0000	377.990,22	0,56
Toyota Motor Corp.	JP3633400001	STK	29.728	0	0	JPY 3.330,0000	583.176,67	0,86
Kanada						EUR	2.574.097,33	3,81
Canadian Imperial Bank of Commerce Ltd.	CA1360691010	STK	19.000	0	1.500	CAD 69,2200	887.609,59	1,31
Royal Bank of Canada	CA7800871021	STK	8.965	0	0	CAD 148,2700	897.098,99	1,33
Toronto Dominion Bank	CA8911605092	STK	15.560	0	0	CAD 75,1700	789.388,75	1,17
Niederlande						EUR	925.050,00	1,37
ASML Holding NV	NL0010273215	STK	1.050	0	210	EUR 881,0000	925.050,00	1,37
Norwegen						EUR	928.072,37	1,37
DNB Bank Asa	NO0010161896	STK	28.000	0	0	NOK 204,1000	500.977,44	0,74
Norsk Hydro ASA	NO0005052605	STK	70.000	0	0	NOK 69,6000	427.094,93	0,63
Schweden						EUR	491.672,53	0,73
Investor B (Fria) O.N.	SE0015811963	STK	20.017	0	0	SEK 282,0000	491.672,53	0,73
Schweiz						EUR	1.339.826,64	1,98
Nestle SA	CH0038863350	STK	5.000	0	0	CHF 94,1400	480.566,02	0,71
Novartis AG	CH0012005267	STK	6.000	0	0	CHF 91,2300	558.853,26	0,83
Swisscom AG	CH0008742519	STK	600	0	0	CHF 490,4000	300.407,36	0,44
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)						EUR	46.355.495,95	68,67
AT&T Inc.	US00206R1023	STK	51.616	0	0	USD 17,6200	838.843,31	1,24
AbbVie Inc.	US00287Y1091	STK	4.000	1.625	0	USD 156,3100	576.683,27	0,85
Abbott Laboratories Inc.	US0028241000	STK	2.999	0	0	USD 101,7400	281.422,49	0,42
Adobe Systems Inc.	US00724F1012	STK	1.472	0	0	USD 445,8700	605.350,16	0,90
Advanced Micro Devices Inc.	US0079031078	STK	5.500	0	0	USD 166,7500	845.900,20	1,25
Air Products & Chemicals Inc.	US0091581068	STK	2.925	0	0	USD 260,5000	702.787,77	1,04
Alphabet Inc -Class A-	US02079K3059	STK	6.000	0	0	USD 172,1100	952.462,65	1,41
Alphabet Inc. -Class C-	US02079K1079	STK	5.505	0	0	USD 173,5600	881.246,82	1,31
Amazon.com Inc.	US0231351067	STK	10.000	0	0	USD 179,3200	1.653.938,39	2,45
Ametek Inc.	US0311001004	STK	2.300	0	0	USD 167,6900	355.734,18	0,53
Amgen Inc.	US0311621009	STK	2.700	2.700	0	USD 301,0000	749.584,95	1,11
Anthem Inc.	US0367521038	STK	1.600	1.600	0	USD 507,3400	748.703,19	1,11
Apple Inc.	US0378331005	STK	14.000	0	0	USD 191,2900	2.470.079,32	3,66
Applied Materials Inc.	US0382221051	STK	2.810	0	0	USD 216,5400	561.222,47	0,83
Bank of America Corp.	US0605051046	STK	25.483	0	0	USD 38,6300	907.958,21	1,34
Boston Scientific Corp.	US1011371077	STK	11.445	0	0	USD 75,0000	791.712,78	1,17
Bristol-Myers Squibb Co.	US1101221083	STK	8.000	2.548	0	USD 40,2500	296.993,17	0,44
Broadcom Ltd.	US11135F1012	STK	700	700	0	USD 1.364,0800	880.700,98	1,30
CVS Health Corp.	US1266501006	STK	15.000	15.000	0	USD 56,0400	775.318,21	1,15
Caterpillar Inc.	US1491231015	STK	3.000	0	0	USD 339,2500	938.710,57	1,39
Cisco Systems Inc.	US17275R1023	STK	8.933	0	0	USD 46,1200	379.994,43	0,56
Coca-Cola Co.	US1912161007	STK	8.001	0	0	USD 61,9700	457.315,97	0,68
Colgate-Palmolive Co.	US1941621039	STK	4.302	0	0	USD 90,9300	360.801,38	0,53
Comcast Corp.	US20030N1019	STK	9.000	0	0	USD 38,8700	322.661,87	0,48
Costco Wholesale Corp.	US22160K1051	STK	1.130	0	0	USD 815,3400	849.782,51	1,26
Danaher Corp.	US2358511028	STK	1.750	452	0	USD 252,7400	407.945,95	0,60
Disney (Walt) Co.	US2546871060	STK	4.409	0	0	USD 101,7000	413.572,50	0,61
Eli Lilly & Co.	US5324571083	STK	1.412	0	0	USD 815,0600	1.061.487,47	1,57
Gilead Sciences Inc.	US3755581036	STK	4.426	0	0	USD 64,0800	261.592,03	0,39
Hewlett Packard Enterprise Co.	US42824C1099	STK	20.000	0	0	USD 18,5200	341.634,38	0,51
Home Depot Inc.	US4370761029	STK	1.906	0	0	USD 329,1800	578.691,27	0,86

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Illinois Tool Works Inc.	US4523081093	STK	3.768	0	0 USD	237,8000	826.443,83	1,22
Intel Corp.	US4581401001	STK	10.000	0	0 USD	30,1900	278.454,16	0,41
Intercontinental Exchange Inc.	US45866F1049	STK	3.000	0	0 USD	133,2400	368.677,37	0,55
International Business Machines Corporation	US4592001014	STK	5.764	0	0 USD	165,6300	880.549,09	1,30
Intuit Inc.	US4612021034	STK	1.400	1.400	0 USD	562,9700	726.948,90	1,08
JP Morgan Chase & Co.	US46625H1005	STK	6.800	0	0 USD	199,3300	1.250.178,93	1,85
Lowe's Companies	US5486611073	STK	3.281	0	0 USD	215,4600	652.023,85	0,97
META PLATFORMS	US30303M1027	STK	3.200	0	0 USD	467,0500	1.378.491,05	2,04
MasterCard Inc.	US57636Q1040	STK	1.004	0	0 USD	442,1000	409.397,16	0,61
McDonald's Corp.	US5801351017	STK	2.800	0	0 USD	252,0700	650.983,21	0,96
Merck & Co Inc	US58933Y1055	STK	3.579	0	0 USD	124,5300	411.079,94	0,61
Microsoft Corp.	US5949181045	STK	6.000	0	0 USD	414,6700	2.294.798,01	3,40
Mondelez International Inc. -Class A-	US6092071058	STK	5.282	0	0 USD	67,8900	330.746,15	0,49
Moody's Corp.	US6153691059	STK	1.154	0	0 USD	395,5000	420.962,00	0,62
NIKE Inc. -Class B-	US6541061031	STK	4.500	1.305	0 USD	93,4500	387.866,63	0,57
NVIDIA Corp.	US67066G1040	STK	3.000	0	200 USD	1.105,0000	3.057.553,96	4,53
Netflix Inc.	US64110L1061	STK	1.507	0	300 USD	647,6600	900.224,70	1,33
Nextera Energy Inc.	US65339F1012	STK	7.547	0	0 USD	78,1900	544.272,21	0,81
Norfolk Southern Corp.	US6558441084	STK	1.305	0	0 USD	220,6800	265.622,03	0,39
Oracle Corp.	US68389X1054	STK	7.000	7.000	0 USD	117,0900	755.976,76	1,12
PPG Industries Inc.	US6935061076	STK	2.500	0	0 USD	129,1200	297.731,05	0,44
PayPal Holdings Inc.	US70450Y1038	STK	6.028	0	0 USD	62,5100	347.546,84	0,51
Pepsico Inc.	US7134481081	STK	5.000	5.000	0 USD	170,4800	786.201,81	1,16
Pfizer Inc.	US7170811035	STK	16.000	4.596	0 USD	28,2000	416.159,38	0,62
Procter & Gamble Co.	US7427181091	STK	2.760	0	0 USD	162,5800	413.872,72	0,61
S&P Global Inc.	US78409V1044	STK	2.000	2.000	0 USD	421,5900	777.697,84	1,15
Salesforce.com Inc.	US79466L3024	STK	3.000	0	542 USD	218,0100	603.237,41	0,89
Starbucks Corp.	US8552441094	STK	5.669	0	0 USD	78,7600	411.815,57	0,61
Texas Instruments Inc.	US8825081040	STK	2.592	0	0 USD	195,6800	467.812,73	0,69
Thermo Fisher Scientific Inc.	US8835561023	STK	1.281	0	0 USD	562,7600	664.910,13	0,98
Union Pacific Corp.	US9078181081	STK	1.606	0	0 USD	229,2400	339.567,83	0,50
UnitedHealth Group Inc.	US91324P1021	STK	1.693	0	0 USD	481,6500	752.106,12	1,11
Verizon Communications Inc.	US92343V1044	STK	11.000	3.000	0 USD	40,3300	409.177,27	0,61
Visa Inc. -Class A-	US92826C8394	STK	2.500	0	0 USD	271,3000	625.576,46	0,93
Sonstige Beteiligungswertpapiere					EUR		582.713,10	0,86
Roche Holding AG G5	CH0012032048	STK	2.500	1.000	0 CHF	228,3000	582.713,10	0,86
Summe Wertpapiervermögen							66.351.188,79	98,29
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds					EUR		1.124.018,36	1,67
Bankguthaben					EUR		1.124.018,36	1,67
EUR - Guthaben bei					EUR		955.092,05	1,41
Verwahrstelle		EUR	955.092,05				955.092,05	1,41
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen					EUR		168.926,31	0,25
Verwahrstelle		USD	183.149,91				168.926,31	0,25
Sonstige Vermögensgegenstände					EUR		62.236,34	0,09
Dividendenansprüche		EUR					59.454,71	0,09
Quellensteuerrücker- stattungsansprüche		EUR					2.781,63	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten³⁾					EUR		-29.109,08	-0,04
Fondsvermögen					EUR		67.508.334,41	100,00³⁾
Anteilwert Klasse I (a)					EUR		140,49	
Anteilwert Klasse S (a)					EUR		123,44	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)					STK		121.874	
Umlaufende Anteile Klasse S (a)					STK		408.189	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)					EUR		17.121.571,01	

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
						EUR	50.386.763,40	
Fondsvermögen Anteilklasse S (a)								
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								98,29
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren und Verwahrstellenvergütung

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 31. Mai 2024 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.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.05.2024

Australien, Dollar	(AUD)	1,63234	= 1 (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,48171	= 1 (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,97947	= 1 (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,45860	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,85089	= 1 (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	169,75000	= 1 (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,40730	= 1 (EUR)
Schweden, Kronen	(SEK)	11,48080	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08420	= 1 (EUR)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte per 30.05.2024 oder letztbekannte

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)				
Veralto Corp.	US92338C1036	STK	0	432

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				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte		EUR		42.602
(Basiswert(e): MSCI World)				

Köln, im Juni 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 31.05.2024)
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

Kreissparkasse Köln
Neumarkt 18 - 24
50667 Köln
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).

Dienstleister für Allokationsberatung

m+c Asset Allocation GmbH
Brienner Str. 53 a
80333 München
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Straße 24 - 28
60439 Frankfurt am Main
Deutschland

Über Änderungen wird in den regelmäßig zu erstellenden Halbjahres- und Jahresberichten sowie auf der Homepage der Ampega Investment GmbH (www.ampega.com) 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