

# Halbjahresbericht

## I-AM ETFs-Portfolio Select

1. Juni 2022 bis 30. November 2022

OGAW-Sondervermögen





## Vermögensübersicht zum 30.11.2022

|                             | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|-----------------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Vermögensgegenstände</b> |                      |                              |
| <b>Investmentanteile</b>    | <b>48.625.078,06</b> | <b>95,40</b>                 |
| Geldmarktnahe Fonds         | 2.155.359,00         | 4,23                         |
| Aktienfonds                 | 46.469.719,06        | 91,17                        |
| <b>Derivate</b>             | <b>545.745,45</b>    | <b>1,07</b>                  |
| Devisen-Derivate            | 545.745,45           | 1,07                         |
| <b>Bankguthaben</b>         | <b>1.895.535,13</b>  | <b>3,72</b>                  |
| <b>Verbindlichkeiten</b>    | <b>-94.621,37</b>    | <b>-0,19</b>                 |
| <b>Fondsvermögen</b>        | <b>50.971.737,27</b> | <b>100,00<sup>1)</sup></b>   |

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

## Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

| Gattungsbezeichnung  | ISIN         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.11.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |       |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------|----------------------|------------------------------|-------|
| <b>Vermögensgegenstände</b>  |              |       |   |                       |   |                       |      |                      |                              |       |
| <b>Investmentanteile</b>   |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>48.625.078,06</b> | <b>95,40</b>                 |       |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>   |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>48.625.078,06</b> | <b>95,40</b>                 |       |
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC  | LU1602144906 |       | ANT   | 6.622                 | 2.069                                     | 3.829                 | EUR  | 585,3000             | 3.875.856,60                 | 7,60  |
| Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I   | FR0007435920 |       | ANT   | 10                    | 0   | 7                     | EUR  | 215.535,9000         | 2.155.359,00                 | 4,23  |
| Amundi Index MSCI World SRI UCITS ETF  | LU1861134382 |       | ANT   | 82.665                | 0   | 0                     | EUR  | 77,0210              | 6.366.940,97                 | 12,49 |
| BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Blue Economy UCIT   | LU2194447293 |       | ANT   | 263.024               | 0   | 0                     | EUR  | 13,6510              | 3.590.540,62                 | 7,04  |
| Lyxor ETF New Energy A   | FR0010524777 |       | ANT   | 33.044                | 33.044                                    | 0                     | EUR  | 39,4310              | 1.302.957,96                 | 2,56  |
| Lyxor ETF World Water  | FR0010527275 |       | ANT   | 47.586                | 47.586                                    | 0                     | EUR  | 53,0150              | 2.522.771,79                 | 4,95  |
| UBS Ireland ETF PLC - S&P 500 ESG UCITS ETF  | IE00BHXMHK04 |       | ANT   | 209.263               | 0   | 0                     | EUR  | 25,7850              | 5.395.846,46                 | 10,59 |
| iShares Dow Jones Europe Sust. Screened UCITS ETF  | IE00B52VJ196 |       | ANT   | 54.226                | 0   | 0                     | EUR  | 56,6300              | 3.070.818,38                 | 6,02  |
| iShares MSCI World Health Care Sector ESG UCITS ET   | IE0009Q57W62 |       | ANT   | 796.149               | 796.149                                   | 0                     | EUR  | 4,7621               | 3.791.341,15                 | 7,44  |
| iShares MSCI World SRI UCITS ETF   | IE00BYX2JD69 |       | ANT   | 724.252               | 0   | 0                     | EUR  | 8,8380               | 6.400.939,18                 | 12,56 |
| iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF  | IE000H1H16W5 |       | ANT   | 1.136.762             | 547.559                                   | 0                     | EUR  | 4,4870               | 5.100.651,09                 | 10,01 |
| iShares Sustainable MSCI USA SRI UCITS ETF   | IE00BYVJRR92 |       | ANT   | 442.454               | 216.786                                   | 259.310               | EUR  | 11,4160              | 5.051.054,86                 | 9,91  |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>  |              |       |   |                       |   |                       |      | <b>48.625.078,06</b> | <b>95,40</b>                 |       |
| <b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b> |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>545.745,45</b>    | <b>1,07</b>                  |       |
| <b>Devisen-Derivate</b>  |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>545.745,45</b>    | <b>1,07</b>                  |       |
| <b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>   |              |       |   |                       |   |                       |      |                      |                              |       |
| <b>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>   |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>545.745,45</b>    | <b>1,07</b>                  |       |
| <b>Offene Positionen</b>   |              |       |   |                       |   |                       |      |                      |                              |       |
| CZK/EUR 529,07 Mio.  |              | OTC   |   |                       |   |                       |      | 537.460,67           | 1,05                         |       |
| <b>Geschlossene Positionen</b>   |              |       |   |                       |   |                       |      |                      |                              |       |
| CZK/EUR 26,05 Mio.   |              | OTC   |   |                       |   |                       |      | 8.284,78             | 0,02                         |       |
| <b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>                          |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>1.895.535,13</b>  | <b>3,72</b>                  |       |
| <b>Bankguthaben</b>  |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>1.895.535,13</b>  | <b>3,72</b>                  |       |
| <b>EUR - Guthaben bei</b>  |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>1.253.928,72</b>  | <b>2,46</b>                  |       |
| Verwahrstelle  |              |       | EUR   | 1.253.928,72          |   |                       |      | 1.253.928,72         | 2,46                         |       |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>  |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>640.958,73</b>    | <b>1,26</b>                  |       |
| Verwahrstelle  |              |       | CZK   | 15.611.551,59         |   |                       |      | 640.958,73           | 1,26                         |       |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>  |              |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>647,68</b>        | <b>0,00</b>                  |       |
| Verwahrstelle  |              |       | USD   | 670,87                |   |                       |      | 647,68               | 0,00                         |       |

## Vermögensaufstellung zum 30.11.2022

| Gattungsbezeichnung                             | ISIN | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.11.2022 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|---|------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------|----------------------|------------------------------|
| Sonstige Verbindlichkeiten <sup>1)</sup>        |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | -94.621,37           | -0,19                        |
| <b>Fondsvermögen</b>                            |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | <b>50.971.737,27</b> | <b>100,00<sup>2)</sup></b>   |
| Anteilwert Klasse EUR (t)                       |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | 63,78                |                              |
| Anteilwert Klasse CZK (t)                       |      |       |   |                       |   |                       | CZK  | 1.441,18             |                              |
| Anteilwert Klasse EUR P1                        |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | 64,94                |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse EUR (t)               |      |       |   |                       |   |                       | STK  | 306.395,578          |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse CZK (t)               |      |       |   |                       |   |                       | STK  | 383.552,049          |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse EUR P1                |      |       |   |                       |   |                       | STK  | 134.520,562          |                              |
| Fondsvermögen Anteilklasse EUR (t)              |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | 19.542.149,15        |                              |
| Fondsvermögen Anteilklasse CZK (t)              |      |       |   |                       |   |                       | CZK  | 552.742.859,80       |                              |
| Fondsvermögen Anteilklasse EUR P1               |      |       |   |                       |   |                       | EUR  | 8.735.792,62         |                              |
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) |      |       |   |                       |   |                       |      |                      | 95,40                        |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)    |      |       |   |                       |   |                       |      |                      | 1,07                         |

<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.

### Zusätzliche Angaben nach § 16 Absatz 1 Nummer 2 KARBV – Angaben zum Bewertungsverfahren

Alle Wertpapiere, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt.

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen. Anteile an Investmentvermögen werden zum letzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände werden zum Nennwert, Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet.

Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis des Vortages.

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung.

Das bisherige Vorgehen bei der Bewertung der Assets des Sondervermögens findet auch vor dem Hintergrund der Auswirkungen durch Covid-19 Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen in diesem Zusammenhang waren bisher nicht notwendig.

Zum Stichtag 30. November 2022 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 98,93 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 1,07 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

### Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.11.2022

|                               |       |          |           |
|-------------------------------|-------|----------|-----------|
| Tschechische Republik, Kronen | (CZK) | 24,35656 | = 1 (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar    | (USD) | 1,03580  | = 1 (EUR) |

### Marktschlüssel

|     |                  |
|-----|------------------|
| OTC | Over-the-Counter |
|-----|------------------|

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

|                     |                                   |
|---------------------|-----------------------------------|
| Alle Vermögenswerte | per 29.11.2022 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.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|--|--------------|---|--------------------|-----------------------|
| <b>Investmentanteile</b>                           |              |   |                    |                       |
| <b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>             |              |   |                    |                       |
| Deutsche Institutional-ESG Money Plus IC           | LU0099730524 | ANT   | 144                | 258                   |
| iShares Refinitiv Inclusion and Diversity UCITS ET | IE00BD0B9B76 | ANT   | 0                  | 580.974               |

| Gattungsbezeichnung  | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge | Volumen<br>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>Devisenterminkontrakte (Kauf)</b>   |   |                    |                       |                     |
| Kauf von Devisen auf Termin  |   | EUR                |                       | 24.400              |
| CZK/EUR  |   | EUR                |                       | 24.400              |

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

Verwaltungsvergütung der im I-AM ETFs-Portfolio Select enthaltenen % p.a.

| Investmentanteile:                                 | % p.a.  |
|--|---------|
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC                          | k.A.    |
| Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I           | 0,17060 |
| Amundi Index MSCI World SRI UCITS ETF              | k.A.    |
| BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Blue Economy UCIT | k.A.    |
| Deutsche Institutional-ESG Money Plus IC           | 0,16000 |
| Lyxor ETF New Energy A                             | 1,20000 |
| Lyxor ETF World Water                              | 1,20000 |
| UBS Ireland ETF PLC - S&P 500 ESG UCITS ETF        | k.A.    |
| iShares Dow Jones Europe Sust. Screened UCITS ETF  | k.A.    |
| iShares MSCI World Health Care Sector ESG UCITS ET | k.A.    |
| iShares MSCI World SRI UCITS ETF                   | k.A.    |
| iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF      | k.A.    |
| iShares Refinitiv Inclusion and Diversity UCITS ET | k.A.    |
| iShares Sustainable MSCI USA SRI UCITS ETF         | k.A.    |

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im Dezember 2022

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Jürgen Meyer

# Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

## Kapitalverwaltungsgesellschaft

Ampega Investment GmbH  
Charles-de-Gaulle-Platz 1  
50679 Köln  
Postfach 10 16 65  
50456 Köln  
Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799  
Fax +49 (221) 790 799-729  
Email [fonds@ampega.com](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)

Amtsgericht Köln: HRB 3495  
USt-Id-Nr. DE 115658034

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.11.2022)  
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

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).

## **Auslagerung Portfoliomanagement**

Impact Asset Management GmbH  
Schottenfeldgasse 20  
1070 Wien  
Österreich

## **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)