

Halbjahresbericht

1. Juni 2024 bis 30. November 2024

I-AM ETFs-Portfolio Select

OGAW-Sondervermögen

ampega.

Talanx Investment Group

Vermögensübersicht zum 30.11.2024

| | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--------------------------------------|----------------------|------------------------------|
| Vermögensgegenstände | | |
| Investmentanteile | 54.096.645,44 | 94,06 |
| Geldmarktnahe Fonds | 5.156.739,51 | 8,97 |
| Aktienfonds | 48.939.905,93 | 85,10 |
| Derivate | -211.971,16 | -0,37 |
| Devisen-Derivate | -211.971,16 | -0,37 |
| Bankguthaben | 4.028.667,08 | 7,01 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | 100.000,00 | 0,17 |
| Verbindlichkeiten | -502.291,69 | -0,87 |
| Fondsvermögen | 57.511.049,67 | 100,00¹⁾ |

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

Vermögensaufstellung zum 30.11.2024

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.11.2024 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens | |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------|----------------------|------------------------------|--------------------|
| Vermögensgegenstände | | | | | | | | | | |
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 54.096.645,44 | 94,06 | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | | EUR | 54.096.645,44 | 94,06 | |
| Amundi Euro Liquidity Short Term SRI - I | FR0007435920 | | ANT | 447 | 205 | 0 | TEUR | 11,5363 | 5.156.739,51 | 8,97 ¹⁾ |
| Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF | IE00BMDPBZ72 | | ANT | 194.133 | 56.405 | 0 | EUR | 47,6050 | 9.241.701,47 | 16,07 |
| Invesco Quantitative Strategies ESG Global Equity | IE00BJQRDN15 | | ANT | 118.216 | 34.825 | 0 | EUR | 76,3900 | 9.030.520,24 | 15,70 |
| JPMorgan Global Research Enhanced Index Equity ESG | IE00BF4G6Y48 | | ANT | 118.055 | 0 | 48.125 | EUR | 48,9850 | 5.782.924,18 | 10,06 |
| UBS Ireland ETF PLC - S&P 500 ESG UCITS ETF | IE00BHXMHK04 | | ANT | 224.001 | 45.029 | 0 | EUR | 38,6700 | 8.662.118,67 | 15,06 |
| Xtrackers Artificial Intelligence & Big Data UCITS | IE00BGV5VN51 | | ANT | 22.598 | 8.093 | 0 | EUR | 135,2200 | 3.055.701,56 | 5,31 |
| db x-trackers JPX-Nikkei 400 UCITS ETF 3C hedged | IE00BRB36B93 | | ANT | 70.268 | 0 | 38.464 | EUR | 27,9900 | 1.966.801,32 | 3,42 |
| iShares DJ EURO STOXX Sustain.40 ETF | DE000A0F5UG3 | | ANT | 262.189 | 388.901 | 126.712 | EUR | 17,1980 | 4.509.126,42 | 7,84 |
| iShares Digital Security UCITS ETF | IE00BG0J4C88 | | ANT | 233.099 | 233.099 | 0 | EUR | 8,8310 | 2.058.497,27 | 3,58 |
| iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF | IE00BFNM3J75 | | ANT | 472.155 | 472.155 | 0 | USD | 10,3540 | 4.632.514,80 | 8,05 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | 54.096.645,44 | 94,06 | |
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen) | | | | | | | EUR | -211.971,16 | -0,37 | |
| Devisen-Derivate | | | | | | | EUR | -211.971,16 | -0,37 | |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | | | | | | EUR | -211.971,16 | -0,37 | |
| Offene Positionen | | | | | | | | | | |
| CZK/EUR 601,52 Mio. | | OTC | | | | | | -211.971,16 | -0,37 | |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | EUR | 4.028.667,08 | 7,01 | |
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 4.028.667,08 | 7,01 | |
| EUR - Guthaben bei | | | | | | | EUR | 3.998.080,31 | 6,95 | |
| Verwahrstelle | | | EUR | 3.998.080,31 | | | | 3.998.080,31 | 6,95 | |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 29.888,55 | 0,05 | |
| Verwahrstelle | | | CZK | 755.612,34 | | | | 29.888,55 | 0,05 | |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | EUR | 698,22 | 0,00 | |
| Verwahrstelle | | | USD | 736,83 | | | | 698,22 | 0,00 | |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 100.000,00 | 0,17 | |
| Cash Collateral | | | EUR | | | | | 100.000,00 | 0,17 | |
| Sonstige Verbindlichkeiten²⁾ | | | | | | | EUR | -502.291,69 | -0,87 | |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 57.511.049,67 | 100,00³⁾ | |

Vermögensaufstellung zum 30.11.2024

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.11.2024 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------|--------------------|------------------------------|
| Anteilwert Klasse EUR (t) | | | | | | | EUR | 78,34 | |
| Anteilwert Klasse CZK (t) | | | | | | | CZK | 1.856,64 | |
| Anteilwert Klasse EUR P1 | | | | | | | EUR | 80,04 | |
| Umlaufende Anteile Klasse EUR (t) | | | | | | | STK | 298.090,406 | |
| Umlaufende Anteile Klasse CZK (t) | | | | | | | STK | 338.966,425 | |
| Umlaufende Anteile Klasse EUR P1 | | | | | | | STK | 115.791,561 | |
| Fondsvermögen Anteilklasse EUR (t) | | | | | | | EUR | 23.350.950,10 | |
| Fondsvermögen Anteilklasse CZK (t) | | | | | | | CZK | 629.298.553,62 | |
| Fondsvermögen Anteilklasse EUR P1 | | | | | | | EUR | 9.267.945,23 | |
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | | | | | | | | | 94,06 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | | | | | | | | | -0,37 |

¹⁾ TEUR = 1.000 EUR

²⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung und Performance Fee

³⁾ 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 2024 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 100,37 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu -0,37 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 0 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 28.11.2024

| | | | |
|-------------------------------|-------|----------|-----------|
| Tschechische Republik, Kronen | (CZK) | 25,28100 | = 1 (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar | (USD) | 1,05530 | = 1 (EUR) |

Marktschlüssel

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

| | |
|---------------------|-----------------------------------|
| Alle Vermögenswerte | per 28.11.2024 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 |
|---|--------------|---|--------------------|-----------------------|
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | |
| Lyxor ETF World Water | FR0010527275 | ANT | 0 | 61.522 |
| iShares Dow Jones Europe Sust. Screened UCITS ETF | IE00B52VJ196 | ANT | 22.342 | 115.767 |
| iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF | IE000H1H16W5 | ANT | 0 | 1.046.125 |

| 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 | | | | |
| Devisenterminkontrakte (Kauf) | | | | |
| Kauf von Devisen auf Termin | | EUR | | 24.000 |
| CZK/EUR | | EUR | | 24.000 |
| Devisenterminkontrakte (Verkauf) | | | | |
| Verkauf von Devisen auf Termin | | EUR | | 24.200 |
| CZK/EUR | | EUR | | 24.200 |

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 Euro Liquidity Short Term SRI - I | 0,16000 |
| Franklin S&P 500 Paris Aligned Climate UCITS ETF | 0,07000 |
| Invesco Quantitative Strategies ESG Global Equity | 0,30000 |
| JPMorgan Global Research Enhanced Index Equity ESG | 0,25000 |
| Lyxor ETF World Water | 1,20000 |
| UBS Ireland ETF PLC - S&P 500 ESG UCITS ETF | 0,10000 |
| Xtrackers Artificial Intelligence & Big Data UCITS | 0,25000 |
| db x-trackers JPX-Nikkei 400 UCITS ETF 3C hedged | 0,15000 |
| iShares DJ EURO STOXX Sustain.40 ETF | 0,40000 |
| iShares Digital Security UCITS ETF | 0,40000 |
| iShares Dow Jones Europe Sust. Screened UCITS ETF | 0,20000 |
| iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF | 0,20000 |
| iShares MSCI World Value Factor ESG UCITS ETF | 0,25000 |

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Köln, im Dezember 2024

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

Überreicht durch:

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