

Halbjahresbericht

Value Intelligence ESG Fonds AMI

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Vermögensübersicht zum 30.06.2023

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Aktien	120.440.343,35	52,34
Australien	1.983.961,11	0,86
Belgien	1.389.390,00	0,60
Deutschland	7.545.593,40	3,28
Großbritannien	269.001,24	0,12
Japan	40.031.851,43	17,40
Kanada	12.203.578,86	5,30
Mexiko	9.069.832,39	3,94
Schweiz	63.024,38	0,03
Singapur	8.235.472,72	3,58
Südkorea	12.425.119,41	5,40
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	27.223.518,41	11,83
Verzinsliche Wertpapiere	69.083.311,82	30,02
Australien	4.897.956,08	2,13
Deutschland	14.747.834,00	6,41
Großbritannien	3.844.074,02	1,67
Norwegen	12.155.159,30	5,28
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)	33.438.288,42	14,53
Zertifikate	20.676.349,31	8,98
Deutschland	4.174.471,72	1,81
Großbritannien	5.108.066,71	2,22
Jersey	11.393.810,88	4,95
Bankguthaben	19.975.893,35	8,68
Sonstige Vermögensgegenstände	302.730,24	0,13
Verbindlichkeiten	-355.900,57	-0,15
Fondsvermögen	230.122.727,50	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände								
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	205.935.350,95	89,49
Aktien						EUR	120.440.343,35	52,34
Australien						EUR	1.983.961,11	0,86
Newcrest Mining Ltd.	AU000000NCM7	STK	123.626	0	132.374	AUD 26,3500	1.983.961,11	0,86
Belgien						EUR	1.389.390,00	0,60
D'leteren SA	BE0974259880	STK	8.700	0	0	EUR 159,7000	1.389.390,00	0,60
Deutschland						EUR	7.545.593,40	3,28
Draegerwerk AG St.	DE0005550602	STK	45.776	7.847	0	EUR 38,0000	1.739.488,00	0,76
Draegerwerk AG Vz.	DE0005550636	STK	17.292	0	0	EUR 43,4500	751.337,40	0,33
Knorr-Bremse AG	DE000KBX1006	STK	73.300	15.300	11.321	EUR 68,9600	5.054.768,00	2,20
Großbritannien						EUR	269.001,24	0,12
Berkeley Group Holdings Or	GB00BLJNXL82	STK	6.000	0	0	GBP 38,6900	269.001,24	0,12
Japan						EUR	40.031.851,43	17,40
DTS Corp	JP3548500002	STK	158.600	75.400	0	JPY 3.395,0000	3.419.362,42	1,49
Daito Trust Construction Co Ltd.	JP3486800000	STK	26.000	26.000	0	JPY 14.625,0000	2.414.745,67	1,05
Mediceo Paltac Holdings Co Ltd.	JP3268950007	STK	253.500	117.000	0	JPY 2.387,5000	3.843.470,18	1,67
Nagaileben Co. Ltd.	JP3647000003	STK	35.800	35.800	0	JPY 2.284,0000	519.255,73	0,23
Oracle Corp. Japan	JP3689500001	STK	45.000	0	4.900	JPY 10.715,0000	3.062.011,81	1,33
Pasona Group Inc	JP3781490002	STK	112.445	5.000	0	JPY 1.671,0000	1.193.215,18	0,52
Secom Co. Ltd.	JP3421800008	STK	102.900	8.800	0	JPY 9.771,0000	6.384.936,18	2,77

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Suzuken Co Ltd.	JP3398000004	STK	139.500	13.000	0	JPY 3.898,0000	3.453.172,03	1,50
T Hasegawa Co Ltd.	JP3768500005	STK	244.400	25.600	0	JPY 3.560,0000	5.525.268,31	2,40
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	JP3613400005	STK	305.000	91.700	0	JPY 2.119,0000	4.104.242,08	1,78
Trend Micro Inc.	JP3637300009	STK	91.800	116.600	24.800	JPY 7.004,0000	4.083.109,16	1,77
Yuasa Trading Co Ltd	JP3945200008	STK	72.700	11.600	0	JPY 4.395,0000	2.029.062,68	0,88
Kanada						EUR	12.203.578,86	5,30
Agnico-Eagle Mines Ltd.	CA0084741085	STK	114.500	6.500	0	CAD 65,1900	5.174.526,86	2,25
NovaGold Resources Inc.	CA66987E2069	STK	300.000	0	0	USD 3,8900	1.071.772,97	0,47
Wheaton Precious Metals	CA9628791027	STK	152.500	16.900	0	CAD 56,3500	5.957.279,03	2,59
Mexiko						EUR	9.069.832,39	3,94
Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	US3444191064	STK	89.300	0	19.058	USD 110,5900	9.069.832,39	3,94
Schweiz						EUR	63.024,38	0,03
APG SGA SA	CH0019107025	STK	331	0	2.666	CHF 186,0000	63.024,38	0,03
Singapur						EUR	8.235.472,72	3,58
Singapore Telecommunications Ltd.	SG1T75931496	STK	4.822.000	1.337.000	0	SGD 2,5200	8.235.472,72	3,58
Südkorea						EUR	12.425.119,41	5,40
AmorePacific Corp. -Pref.-	KR7002791002	STK	47.383	14.719	0	KRW 10,5000	346.716,96	0,15
KT Corporation ADR	US48268K1016	STK	696.000	260.300	0	USD 11,2900	7.216.641,41	3,14
LG H&H Co Ltd -Pref.-	KR7051901007	STK	13.157	13.157	0	KRW 188,0000	1.723.764,59	0,75
LG Household & Health Care Ltd.	KR7051900009	STK	3.000	3.000	0	KRW 461,5000	964.841,98	0,42
S-1 Corp	KR7012750006	STK	59.060	10.100	0	KRW 52,8000	2.173.154,47	0,94
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)						EUR	27.223.518,41	11,83
Adobe Systems Inc.	US00724F1012	STK	6.600	3.500	0	USD 483,7700	2.932.343,30	1,27
Advance Auto Parts Inc.	US00751Y1064	STK	17.600	17.600	0	USD 68,2300	1.102.858,98	0,48
Ally Financial Inc.	US02005N1000	STK	54.000	54.000	0	USD 26,9200	1.335.059,93	0,58
Amerco Ser.N. O.N.	US0235865062	STK	167.900	41.200	0	USD 49,3100	7.603.571,66	3,30
Healthcare Services Group Inc	US4219061086	STK	145.000	145.000	0	USD 14,8900	1.982.871,84	0,86
Kroger Co.	US5010441013	STK	64.000	0	29.000	USD 46,3200	2.722.578,87	1,18
Newmont Corp.	US6516391066	STK	178.100	26.200	0	USD 41,9500	6.861.638,43	2,98
Oracle Corp.	US68389X1054	STK	24.800	0	0	USD 117,7800	2.682.595,40	1,17
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	64.818.658,29	28,17
0,2500 % Australia S.159 2019/2024	AU0000083768	AUD	3.800	3.800	0	% 94,6900	2.191.444,27	0,95
2,7500 % Australia S.137 2012/2024	AU3TB0000143	AUD	4.500	4.500	0	% 98,7540	2.706.511,81	1,18
2,5130 % Apple MC 2017/2024	CA037833CY47	CAD	8.500	2.000	0	% 96,9580	5.713.296,36	2,48
0,0000 % Bundesobligation 2023/2023	DE000BU0E006	EUR	3.300	3.300	0	% 98,4450	3.248.685,00	1,41
0,0000 % Bundesobligation 2023/2024	DE000BU0E014	EUR	2.800	2.800	0	% 98,1230	2.747.444,00	1,19
0,0000 % Bundesobligation 2023/2024	DE000BU0E030	EUR	3.000	3.000	0	% 97,5050	2.925.150,00	1,27
0,0000 % Bundesobligation 2023/2024	DE000BU0E048	EUR	3.300	3.300	0	% 97,2330	3.208.689,00	1,39
0,0000 % Bundesobligation S.364D 2023/2024	DE000BU0E055	EUR	2.700	2.700	0	% 96,9580	2.617.866,00	1,14
0,0000 % Norway S.60 2022/2023	NO0012697723	NOK	35.000	0	0	% 99,2100	2.959.675,08	1,29
0,0000 % Norway S.61 2022/2023	NO0012779471	NOK	30.000	30.000	0	% 98,2360	2.511.958,54	1,09
1,7500 % Norway 2015/2025	NO0010732555	NOK	33.000	33.000	0	% 96,1720	2.705.098,79	1,18
3,0000 % Norway S.476 2014/2024	NO0010705536	NOK	47.000	0	0	% 99,3100	3.978.426,89	1,73
0,6250 % salesforce.com MC 2021/2024	US79466LAG95	USD	5.400	5.400	0	% 95,1340	4.718.038,30	2,05
0,7500 % Merck & Co. MC 2020/2026	US58933YAY14	USD	3.600	3.600	0	% 90,3390	2.986.824,63	1,30
1,9000 % Adobe Systems MC 2020/2025	US00724PAB58	USD	5.800	5.800	0	% 95,0240	5.061.663,22	2,20
2,7500 % Eli Lilly & Co. MC 2015/2025	US532457BH00	USD	3.135	3.135	0	% 96,1160	2.767.356,94	1,20
2,7500 % Reckitt Benckiser Treas. Serv. MC 2017/2024	US75625QAD16	USD	4.300	1.500	0	% 97,3400	3.844.074,02	1,67
3,6250 % Cisco Systems 2014/2024	US17275RAN26	USD	2.000	0	0	% 98,8710	1.816.062,82	0,79
3,6250 % Microsoft MC 2013/2023	US594918AW47	USD	6.700	2.500	0	% 99,3030	6.110.392,62	2,66
Zertifikate						EUR	20.676.349,31	8,98
Deutsche Börse XETRA Gold ETC	DE000A0S9GB0	STK	73.963	0	0	EUR 56,4400	4.174.471,72	1,81
ETFS Physical Gold	JE00B1V53770	STK	38.300	5.656	0	USD 179,4550	6.312.280,39	2,74
Royal Mint Physical Gold ETC Securities	XS2115336336	STK	294.768	14.636	0	USD 18,8688	5.108.066,71	2,22

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
db Gold Bullion Securities	GB00B00FHZ82	STK	19.783	3.000	0	USD 176,7350	3.211.046,99	1,40
db Physical Silver ETC (EUR)	DE000A1E0HS6	STK	9.519	0	0	EUR 196,5000	1.870.483,50	0,81
Nicht notierte Wertpapiere						EUR	4.264.653,53	1,85
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	4.264.653,53	1,85
0,4500 % Roche Holdings S.144A MC 2021/2024	US771196BQ41	USD	4.800	4.800	0	% 96,7410	4.264.653,53	1,85
Summe Wertpapiervermögen							210.200.004,48	91,34
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	19.975.893,35	8,68
Bankguthaben						EUR	19.975.893,35	8,68
EUR - Guthaben bei						EUR	2.379,22	0,00
Kreissparkasse Köln		EUR	521,70				521,70	0,00
Landesbank Baden-Württemberg		EUR	1.857,52				1.857,52	0,00
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen						EUR	318.234,73	0,14
Verwahrstelle		DKK	16.493,07				2.214,73	0,00
Verwahrstelle		NOK	3.607.944,71				307.524,99	0,13
Verwahrstelle		GBP	7.330,94				8.495,01	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	19.655.279,40	8,54
Verwahrstelle		SGD	18.520.386,75				12.551.939,51	5,45
Verwahrstelle		CAD	432.395,57				299.754,29	0,13
Verwahrstelle		AUD	7.796.265,33				4.748.203,55	2,06
Verwahrstelle		JPY	41.427.094,00				263.079,28	0,11
Verwahrstelle		CHF	109.163,37				111.749,25	0,05
Verwahrstelle		USD	1.829.870,70				1.680.553,52	0,73
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	302.730,24	0,13
Dividendenansprüche		EUR					64.545,60	0,03
Quellensteuerrück- stattungsansprüche		EUR					7.393,50	0,00
Zinsansprüche		EUR					230.791,14	0,10
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR	-102.724,24	-0,04
EUR - Kredite						EUR	-102.724,24	-0,04
Verwahrstelle		EUR	-102.724,24				-102.724,24	-0,04
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-253.176,33	-0,11
Fondsvermögen						EUR	230.122.727,50	100,00²⁾
Anteilwert Klasse I (a)						EUR	131,50	
Anteilwert Klasse P (a)						EUR	127,57	
Umlaufende Anteile Klasse I (a)						STK	1.022.505,504	
Umlaufende Anteile Klasse P (a)						STK	749.874,541	
Fondsvermögen Anteilklasse I (a)						EUR	134.462.347,19	
Fondsvermögen Anteilklasse P (a)						EUR	95.660.380,31	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								91,34
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.

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. Juni 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.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.06.2023

Australien, Dollar	(AUD)	1,64194	= 1 (EUR)
Kanada, Dollar	(CAD)	1,44250	= 1 (EUR)
Schweiz, Franken	(CHF)	0,97686	= 1 (EUR)
Dänemark, Kronen	(DKK)	7,44700	= 1 (EUR)
Vereinigtes Königreich, Pfund	(GBP)	0,86297	= 1 (EUR)
Japan, Yen	(JPY)	157,47000	= 1 (EUR)
Südkorea, Won	(KRW)	1.434,95000	= 1 (EUR)
Norwegen, Kronen	(NOK)	11,73220	= 1 (EUR)
Singapur, Dollar	(SGD)	1,47550	= 1 (EUR)
Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,08885	= 1 (EUR)

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte per 29.06.2023 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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
Kanada				
Wheaton Precious Metals	CA9628791027	STK	0	5.000
Schweiz				
Swisscom AG	CH0008742519	STK	0	3.500
USA (Vereinigte Staaten von Amerika)				
Amerco	US0235861004	STK	0	13.500
Ball Corp.	US0584981064	STK	0	11.600
Bunge Ltd.	BMG169621056	STK	3.500	3.500
Disney (Walt) Co.	US2546871060	STK	0	4.500
Flowserve Corp.	US34354P1057	STK	0	146.600
HP Inc	US40434L1052	STK	0	79.400
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Norway S.59 2022/2023	NO0012539073	NOK	30.000	30.000
2,0000 % Norway 2012/2023	NO0010646813	NOK	0	36.300
1,7500 % Coca-Cola MC 2019/2024	US191216CL26	USD	0	4.300
1,9500 % Colgate-Palmolive 2012/2023	US19416QEA40	USD	0	2.060
2,4000 % Apple 2013/2023	US037833AK68	USD	0	3.520
2,4000 % Oracle MC 2016/2023	US68389XBL82	USD	0	3.000
2,5000 % Oracle MC 2020/2025	US68389XBT19	USD	2.000	2.000
2,6000 % Cisco Systems 2016/2023	US17275RBE18	USD	0	1.800
2,6250 % Oracle MC 2017/2023	US68389XBR52	USD	0	3.100
2,8500 % Apple MC 2016/2023	US037833BU32	USD	0	2.290
3,8500 % Kroger Co. MC 2013/2023	US501044CS84	USD	0	3.300
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,0000 % Norway S.58 2022/2023	NO0012460023	NOK	0	26.300

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
Nicht notierte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
2,1500 % PepsiCo MC 2017/2024	CA713448DQ80	CAD	0	5.500
2,7000 % John Deere Canada Funding 2018/2023	CA47787ZBV37	CAD	0	4.590

Köln, im Juli 2023

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Dr. Thomas Mann



Dr. Dirk Erdmann

Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Kapitalverwaltungsgesellschaft

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

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.06.2023)
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

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

State Street Bank International GmbH
Brienner Straße 59
80333 München
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).

Anlageberater

Value Intelligence Advisors GmbH
Rauchstr. 4
81679 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