

# Halbjahresbericht

## FAROS Listed Real Assets AMI

1. April 2023 bis 30. September 2023

OGAW-Sondervermögen





## Vermögensübersicht zum 30.09.2023

|                                      | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|--------------------------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Vermögensgegenstände</b>          |                      |                              |
| <b>Aktien</b>                        | <b>15.100.801,43</b> | <b>98,90</b>                 |
| Australien                           | 528.098,54           | 3,46                         |
| Belgien                              | 429.051,40           | 2,81                         |
| China                                | 287.161,57           | 1,88                         |
| Deutschland                          | 719.311,50           | 4,71                         |
| Dänemark                             | 287.899,44           | 1,89                         |
| Frankreich                           | 196.319,90           | 1,29                         |
| Großbritannien                       | 919.408,80           | 6,02                         |
| Guernsey                             | 300.605,14           | 1,97                         |
| Hongkong                             | 1.444.866,92         | 9,46                         |
| Italien                              | 490.272,52           | 3,21                         |
| Japan                                | 1.150.121,06         | 7,53                         |
| Kanada                               | 1.379.746,05         | 9,04                         |
| Mexiko                               | 192.107,47           | 1,26                         |
| Neuseeland                           | 912.058,64           | 5,97                         |
| Niederlande                          | 193.578,35           | 1,27                         |
| Norwegen                             | 286.842,67           | 1,88                         |
| Philippinen                          | 299.332,08           | 1,96                         |
| Schweiz                              | 246.633,54           | 1,62                         |
| Singapur                             | 835.784,73           | 5,47                         |
| Spanien                              | 374.920,22           | 2,46                         |
| Südafrika                            | 233.028,05           | 1,53                         |
| Thailand                             | 286.403,77           | 1,88                         |
| USA (Vereinigte Staaten von Amerika) | 3.107.249,07         | 20,35                        |
| <b>Derivate</b>                      | <b>-82.723,76</b>    | <b>-0,54</b>                 |
| Aktienindex-Derivate                 | 57.018,93            | 0,37                         |
| Devisen-Derivate                     | -139.742,69          | -0,92                        |
| <b>Bankguthaben</b>                  | <b>174.020,12</b>    | <b>1,14</b>                  |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b> | <b>90.838,95</b>     | <b>0,59</b>                  |
| <b>Verbindlichkeiten</b>             | <b>-14.665,39</b>    | <b>-0,10</b>                 |
| <b>Fondsvermögen</b>                 | <b>15.268.271,35</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 30.09.2023

| Gattungsbezeichnung                    | ISIN         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.09.2023 | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |      |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|--------------------|-----------------------|------|----------------------|------------------------------|------|
| <b>Vermögensgegenstände</b>            |              |       |   |                       |                    |                       |      |                      |                              |      |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>    |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>15.100.801,43</b> | <b>98,90</b>                 |      |
| <b>Aktien</b>                          |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>15.100.801,43</b> | <b>98,90</b>                 |      |
| <b>Australien</b>                      |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>528.098,54</b>    | <b>3,46</b>                  |      |
| APA Group                              | AU000000APA1 |       | STK   | 51.849                | 57.941             | 6.092                 | AUD  | 8,3000               | 261.235,74                   | 1,71 |
| Atlas Arteria (Stapled Securities)     | AU0000013559 |       | STK   | 78.363                | 87.166             | 8.803                 | AUD  | 5,6100               | 266.862,80                   | 1,75 |
| <b>Belgien</b>                         |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>429.051,40</b>    | <b>2,81</b>                  |      |
| Aedifica SA REIT                       | BE0003851681 |       | STK   | 4.232                 | 2.201              | 557                   | EUR  | 52,6000              | 222.603,20                   | 1,46 |
| TINC Comm VA                           | BE0974282148 |       | STK   | 17.276                | 0                  | 7.591                 | EUR  | 11,9500              | 206.448,20                   | 1,35 |
| <b>China</b>                           |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>287.161,57</b>    | <b>1,88</b>                  |      |
| Jiangsu Expressway Co Ltd -Class H-    | CNE1000003J5 |       | STK   | 334.000               | 0                  | 40.000                | HKD  | 7,1100               | 287.161,57                   | 1,88 |
| <b>Deutschland</b>                     |              |       |   |                       |                    |                       |      | <b>719.311,50</b>    | <b>4,71</b>                  |      |
| Encavis AG                             | DE0006095003 |       | STK   | 22.888                | 6.617              | 6.452                 | EUR  | 12,9150              | 295.598,52                   | 1,94 |
| Hamburger Hafen und Logistik AG (HHLA) | DE000A058488 |       | STK   | 12.061                | 0                  | 19.628                | EUR  | 16,7400              | 201.901,14                   | 1,32 |

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

| Gattungsbezeichnung                           | ISIN         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.09.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in EUR  | % des<br>Fonds-<br>vermögens |      |
|---|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|---------------------|------------------------------|------|
| LEG Immobilien AG                             | DE000LEG1110 |       | STK   | 3.573                 | 2.161                                     | 1.835                 | EUR        | 62,0800             | 221.811,84                   | 1,45 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>287.899,44</b>   | <b>1,89</b>                  |      |
| <b>Dänemark</b>                               |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| ORSTED A/S                                    | DK0060094928 |       | STK   | 5.609                 | 1.311                                     | 1.105                 | DKK        | 382,8000            | 287.899,44                   | 1,89 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>196.319,90</b>   | <b>1,29</b>                  |      |
| <b>Frankreich</b>                             |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Eutelsat Com-<br>munications SA               | FR0010221234 |       | STK   | 36.188                | 0   | 15.309                | EUR        | 5,4250              | 196.319,90                   | 1,29 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>919.408,80</b>   | <b>6,02</b>                  |      |
| <b>Großbritannien</b>                         |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Atlantica Yield PLC                           | GB00BLP5YB54 |       | STK   | 15.300                | 0   | 2.200                 | USD        | 18,6900             | 270.690,08                   | 1,77 |
| National Grid PLC                             | GB00BDR05C01 |       | STK   | 19.467                | 0   | 8.382                 | GBP        | 9,6640              | 217.246,66                   | 1,42 |
| SSE PLC                                       | GB0007908733 |       | STK   | 10.956                | 0   | 4.429                 | GBP        | 16,0200             | 202.680,37                   | 1,33 |
| Segro PLC                                     | GB00B5Z1N188 |       | STK   | 28.151                | 0   | 6.006                 | GBP        | 7,0380              | 228.791,69                   | 1,50 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>300.605,14</b>   | <b>1,97</b>                  |      |
| <b>Guernsey</b>                               |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| NextEnergy Solar Fund REIT                    | GG00BJ0JVY01 |       | STK   | 299.557               | 0   | 51.826                | GBP        | 0,8690              | 300.605,14                   | 1,97 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>1.444.866,92</b> | <b>9,46</b>                  |      |
| <b>Hongkong</b>                               |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| CK Infrastructure<br>Holdings Ltd.            | BMG2178K1009 |       | STK   | 60.500                | 0   | 7.000                 | HKD        | 37,2500             | 272.515,93                   | 1,78 |
| China Gas Holdings Ltd                        | BMG2109G1033 |       | STK   | 327.400               | 327.400                                   | 0                     | HKD        | 7,2900              | 288.613,37                   | 1,89 |
| China Resources<br>Gas Group Ltd              | BMG2113B1081 |       | STK   | 98.400                | 110.000                                   | 11.600                | HKD        | 22,6500             | 269.509,17                   | 1,77 |
| Link REIT                                     | HK0823032773 |       | STK   | 68.800                | 21.400                                    | 0                     | HKD        | 36,9500             | 307.406,56                   | 2,01 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd                   | HK0016000132 |       | STK   | 31.500                | 3.500                                     | 0                     | HKD        | 80,5500             | 306.821,89                   | 2,01 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>490.272,52</b>   | <b>3,21</b>                  |      |
| <b>Italien</b>                                |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| ERG SpA                                       | IT0001157020 |       | STK   | 12.421                | 0   | 2.154                 | EUR        | 22,5400             | 279.969,34                   | 1,83 |
| Infrastrutture Wirel-<br>ess Italiane SpA     | IT0005090300 |       | STK   | 18.989                | 0   | 12.049                | EUR        | 11,0750             | 210.303,18                   | 1,38 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>1.150.121,06</b> | <b>7,53</b>                  |      |
| <b>Japan</b>                                  |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Daiwa House Invest-<br>ment Corp REIT         | JP3046390005 |       | STK   | 175                   | 52  | 28                    | JPY        | 258.500,0000        | 286.730,68                   | 1,88 |
| East Japan Railway Co.                        | JP3783600004 |       | STK   | 5.100                 | 0   | 2.000                 | JPY        | 8.593,0000          | 277.773,34                   | 1,82 |
| Mitsui Fudosan Co. Ltd.                       | JP3893200000 |       | STK   | 13.700                | 16.300                                    | 2.600                 | JPY        | 3.324,0000          | 288.640,43                   | 1,89 |
| Nippon Prologis Inc. REIT                     | JP3047550003 |       | STK   | 171                   | 49  | 34                    | JPY        | 274.000,0000        | 296.976,61                   | 1,95 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>1.379.746,05</b> | <b>9,04</b>                  |      |
| <b>Kanada</b>                                 |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Brookfield Infrastruc-<br>ture Corp -Class A- | CA11275Q1072 |       | STK   | 5.200                 | 0   | 1.000                 | CAD        | 48,7700             | 177.870,36                   | 1,16 |
| Brookfield Renewable Corp.                    | CA11284V1058 |       | STK   | 12.319                | 0   | 3.200                 | CAD        | 33,2800             | 287.545,29                   | 1,88 |
| Canadian Natio-<br>nal Railway Co.            | CA1363751027 |       | STK   | 1.700                 | 0   | 300                   | CAD        | 147,9600            | 176.417,12                   | 1,16 |
| Hydro One Ltd                                 | CA4488112083 |       | STK   | 6.800                 | 0   | 0                     | CAD        | 34,7500             | 165.733,84                   | 1,09 |
| Innervex Renewable Energy                     | CA45790B1040 |       | STK   | 37.200                | 10.400                                    | 11.000                | CAD        | 10,3300             | 269.519,84                   | 1,77 |
| TransAlta Renewables Inc.                     | CA8934631091 |       | STK   | 35.400                | 0   | 8.300                 | CAD        | 12,1900             | 302.659,60                   | 1,98 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>192.107,47</b>   | <b>1,26</b>                  |      |
| <b>Mexiko</b>                                 |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| GMexico Trans-<br>portes SAB de CV            | MX01GM1Z0019 |       | STK   | 87.800                | 43.200                                    | 29.600                | MXN        | 40,7200             | 192.107,47                   | 1,26 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>912.058,64</b>   | <b>5,97</b>                  |      |
| <b>Neuseeland</b>                             |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Auckland Interna-<br>tional Airport Ltd.      | NZAIAE000256 |       | STK   | 70.020                | 70.020                                    | 0                     | NZD        | 7,8600              | 310.392,65                   | 2,03 |
| Meridian Energy Ltd                           | NZMELE000257 |       | STK   | 108.317               | 0   | 0                     | NZD        | 5,1100              | 312.165,06                   | 2,04 |
| Vector Ltd.                                   | NZVCTE000157 |       | STK   | 131.619               | 0   | 0                     | NZD        | 3,9000              | 289.500,93                   | 1,90 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>193.578,35</b>   | <b>1,27</b>                  |      |
| <b>Niederlande</b>                            |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Vopak (Koninklijke) NV                        | NL0009432491 |       | STK   | 6.055                 | 0   | 5.955                 | EUR        | 31,9700             | 193.578,35                   | 1,27 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>286.842,67</b>   | <b>1,88</b>                  |      |
| <b>Norwegen</b>                               |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Scatec ASA                                    | NO0010715139 |       | STK   | 52.740                | 0   | 17.428                | NOK        | 61,7000             | 286.842,67                   | 1,88 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>299.332,08</b>   | <b>1,96</b>                  |      |
| <b>Philippinen</b>                            |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Manila Electric Co.                           | PHY5764J1483 |       | STK   | 48.430                | 0   | 14.630                | PHP        | 372,0000            | 299.332,08                   | 1,96 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>246.633,54</b>   | <b>1,62</b>                  |      |
| <b>Schweiz</b>                                |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Swiss Prime Site AG                           | CH0008038389 |       | STK   | 2.868                 | 0   | 568                   | CHF        | 83,2500             | 246.633,54                   | 1,62 |
|   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>835.784,73</b>   | <b>5,47</b>                  |      |
| <b>Singapur</b>                               |              |       |   |                       |   |                       |            |                     |                              |      |
| Ascendas Real Estate<br>Investment Trust REIT | SG1M77906915 |       | STK   | 150.800               | 0   | 43.500                | SGD        | 2,7100              | 283.050,28                   | 1,85 |

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

| Gattungsbezeichnung  | ISIN         | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.09.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs       | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |       |
|--|--------------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|----------------------|------------------------------|-------|
| Frasers Logistics & Commercial Trust REIT  | SG1CI9000006 |       | STK   | 378.300               | 378.300                                   | 0                     | SGD        | 1,0600               | 277.737,91                   | 1,82  |
| Mapletree Commercial Trust REIT  | SG2D18969584 |       | STK   | 283.600               | 0   | 57.900                | SGD        | 1,4000               | 274.996,54                   | 1,80  |
|  |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>374.920,22</b>    | <b>2,46</b>                  |       |
| Aena SA  | ES0105046009 |       | STK   | 1.350                 | 0   | 942                   | EUR        | 140,4500             | 189.607,50                   | 1,24  |
| Cellnex Telecom SAU  | ES0105066007 |       | STK   | 5.716                 | 0   | 2.470                 | EUR        | 32,4200              | 185.312,72                   | 1,21  |
|  |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>233.028,05</b>    | <b>1,53</b>                  |       |
| Growthpoint Properties Ltd REIT  | ZAE000179420 |       | STK   | 454.037               | 162.592                                   | 72.094                | ZAR        | 10,3300              | 233.028,05                   | 1,53  |
|  |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>286.403,77</b>    | <b>1,88</b>                  |       |
| Airports of Thailand PCL   | TH0765010Z16 |       | STK   | 160.200               | 0   | 46.400                | THB        | 69,2500              | 286.403,77                   | 1,88  |
|  |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>3.107.249,07</b>  | <b>20,35</b>                 |       |
| <b>USA (Vereinigte Staaten von Amerika)</b>  |              |       |   |                       |   |                       |            |                      |                              |       |
| American Tower Corp.   | US03027X1000 |       | STK   | 1.300                 | 0   | 0                     | USD        | 162,3200             | 199.750,09                   | 1,31  |
| American Water Works Co. Inc.  | US0304201033 |       | STK   | 1.400                 | 700                                       | 300                   | USD        | 123,5800             | 163.775,09                   | 1,07  |
| AvalonBay Communities Inc. REIT  | US0534841012 |       | STK   | 1.000                 | 0   | 200                   | USD        | 171,2900             | 162.145,02                   | 1,06  |
| CSX Corp.  | US1264081035 |       | STK   | 6.700                 | 0   | 1.900                 | USD        | 30,5700              | 193.883,95                   | 1,27  |
| Crown Castle International Corp. REIT  | US22822V1017 |       | STK   | 2.200                 | 900                                       | 400                   | USD        | 92,0800              | 191.760,70                   | 1,26  |
| Digital Realty Trust Inc.  | US2538681030 |       | STK   | 1.500                 | 0   | 600                   | USD        | 118,5400             | 168.316,93                   | 1,10  |
| Eversource Energy  | US30040W1080 |       | STK   | 3.700                 | 600                                       | 0                     | USD        | 57,3600              | 200.901,17                   | 1,32  |
| Extra Space Storage Inc. REIT  | US30225T1025 |       | STK   | 1.600                 | 0   | 0                     | USD        | 120,8200             | 182.991,29                   | 1,20  |
| Mid-America Apartment Communities Inc. REIT  | US59522J1034 |       | STK   | 1.400                 | 700                                       | 0                     | USD        | 128,9400             | 170.878,46                   | 1,12  |
| Oneok Inc.   | US6826801036 |       | STK   | 3.100                 | 0   | 900                   | USD        | 64,8900              | 190.419,35                   | 1,25  |
| Potlatchdeltic Corp. REIT  | US7376301039 |       | STK   | 9.735                 | 800                                       | 3.700                 | USD        | 45,1400              | 415.976,81                   | 2,72  |
| Prologis Inc. REIT   | US74340W1036 |       | STK   | 1.600                 | 0   | 300                   | USD        | 112,1300             | 169.829,61                   | 1,11  |
| Rayonier Inc. REIT   | US7549071030 |       | STK   | 14.700                | 0   | 2.600                 | USD        | 28,2400              | 392.964,79                   | 2,57  |
| SBA Communications Corp REIT   | US78410G1040 |       | STK   | 900                   | 0   | 0                     | USD        | 198,4600             | 169.078,00                   | 1,11  |
| WP Carey Inc REIT  | US92936U1097 |       | STK   | 2.600                 | 0   | 0                     | USD        | 54,6800              | 134.577,81                   | 0,88  |
| <b>Summe Wertpapiervermögen</b>  |              |       |   |                       |   |                       |            | <b>15.100.801,43</b> | <b>98,90</b>                 |       |
| <b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b> |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>-82.723,76</b>    | <b>-0,54</b>                 |       |
| <b>Aktienindex-Derivate</b>  |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>57.018,93</b>     | <b>0,37</b>                  |       |
| <b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>   |              |       |   |                       |   |                       |            |                      |                              |       |
| <b>Optionsrechte</b>   |              |       |   |                       |   |                       | <b>EUR</b> | <b>57.018,93</b>     | <b>0,37</b>                  |       |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindizes</b>   |              |       |   |                       |   |                       |            |                      |                              |       |
| Option Euro Stoxx 50 Put 3800 Dezember 2023  |              | EUREX | STK   | 230                   |   |                       | EUR        | 34,1000              | 7.843,00                     | 0,05  |
| Option Euro Stoxx 50 Put 3875 November 2023  |              | EUREX | STK   | 200                   |   |                       | EUR        | 27,1000              | 5.420,00                     | 0,04  |
| Option Euro Stoxx 50 Put 3950 Oktober 2023   |              | EUREX | STK   | 260                   |   |                       | EUR        | 15,2000              | 3.952,00                     | 0,03  |
| Option FTSE Put 6.800 Dezember 2023  |              | IFLO  | STK   | 40                    |   |                       | GBP        | 25,5000              | 1.177,87                     | 0,01  |
| Option FTSE Put 670000 November 2023   |              | IFLO  | STK   | 20                    |   |                       | GBP        | 10,0000              | 230,95                       | 0,00  |
| Option FTSE Put 680000 Oktober 2023  |              | IFLO  | STK   | 30                    |   |                       | GBP        | 3,5000               | 121,25                       | 0,00  |
| Option Hang Seng Index Put 16.200 Dezember 2023  |              | HKFE  | STK   | 150                   |   |                       | HKD        | 339,0000             | 1.759,44                     | 0,01  |
| Option Hang Seng Index Put 16800 November 2023   |              | HKFE  | STK   | 150                   |   |                       | HKD        | 405,0000             | 2.049,65                     | 0,01  |
| Option Hang Seng Index Put 17000 Oktober 2023  |              | HKFE  | STK   | 150                   |   |                       | HKD        | 290,0000             | 761,82                       | 0,00  |
| Option Hang Seng Index Put 17400 September 2023  |              | HKFE  | STK   | 100                   |   |                       | HKD        | 1,0000               | -2.865,88                    | -0,02 |
| Option Nikkei 225 Put 29.500 Dezember 2023   |              | OSE   | STK   | 3.000                 |   |                       | JPY        | 305,0000             | 5.799,58                     | 0,04  |
| Option Nikkei 225 Put 29000 November 2023  |              | OSE   | STK   | 3.000                 |   |                       | JPY        | 105,0000             | 1.996,58                     | 0,01  |

## Vermögensaufstellung zum 30.09.2023

| Gattungsbezeichnung   | ISIN | Markt | Stück bzw.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Bestand<br>30.09.2023 | Käufe /<br>Zugänge<br>im Berichtszeitraum | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs    | Kurswert<br>in EUR   | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|---|------|-------|---|-----------------------|---|-----------------------|---------|----------------------|------------------------------|
| Option Nikkei 225 Put<br>29500 Oktober 2023                                   | OSE  |       | STK   | 3.000                 |   | JPY                   | 28,0000 | 532,42               | 0,00                         |
| Option S&P 500 Index<br>Put 4.025 Dezember 2023                               | CBOE |       | STK   | 400                   |   | USD                   | 40,1900 | 15.217,72            | 0,10                         |
| Option S&P 500 Index<br>Put 4050 November 2023                                | CBOE |       | STK   | 300                   |   | USD                   | 27,3900 | 7.778,30             | 0,05                         |
| Option S&P 500 Index<br>Put 4100 Oktober 2023                                 | CBOE |       | STK   | 400                   |   | USD                   | 13,8500 | 5.244,23             | 0,03                         |
| <b>Devisen-Derivate</b>   |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>-139.742,69</b>   | <b>-0,92</b>                 |
| <b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>  |      |       |   |                       |   |                       |         |                      |                              |
| <b>Futures auf Devisen</b>  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>-139.742,69</b>   | <b>-0,92</b>                 |
| EUR/AUD FX Currency<br>Future Dezember 2023                                   | CME  |       | AUD   | 1.000                 |   |                       |         | -18.757,40           | -0,12                        |
| EUR/CAD FX Currency<br>Future Dezember 2023                                   | CME  |       | CAD   | 1.250                 |   |                       |         | -27.441,12           | -0,18                        |
| EUR/GBP FX Currency<br>Future Dezember 2023                                   | CME  |       | GBP   | 750                   |   |                       |         | 3.247,80             | 0,02                         |
| EUR/JPY Currency<br>Future Dezember 2023                                      | CME  |       | JPY   | 1.000                 |   |                       |         | -2.218,42            | -0,01                        |
| EUR/USD FX Currency<br>Future Dezember 2023                                   | CME  |       | USD   | 5.250                 |   |                       |         | -94.573,55           | -0,62                        |
| <b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b> |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>174.020,12</b>    | <b>1,14</b>                  |
| <b>Bankguthaben</b>   |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>174.020,12</b>    | <b>1,14</b>                  |
| <b>EUR - Guthaben bei</b>   |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>6.611,28</b>      | <b>0,04</b>                  |
| Verwahrstelle   |      |       | EUR   | 6.611,28              |   |                       |         | 6.611,28             | 0,04                         |
| <b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                                 |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>295,04</b>        | <b>0,00</b>                  |
| Verwahrstelle   |      |       | SEK   | 3.413,74              |   |                       |         | 295,04               | 0,00                         |
| <b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>                                     |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>167.113,80</b>    | <b>1,09</b>                  |
| Verwahrstelle   |      |       | JPY   | 6.548.614,00          |   |                       |         | 41.507,36            | 0,27                         |
| Verwahrstelle   |      |       | USD   | 68.579,75             |   |                       |         | 64.918,35            | 0,43                         |
| Verwahrstelle   |      |       | SGD   | 4.864,48              |   |                       |         | 3.369,22             | 0,02                         |
| Verwahrstelle   |      |       | AUD   | 25.256,52             |   |                       |         | 15.331,61            | 0,10                         |
| Verwahrstelle   |      |       | NZD   | 12.532,52             |   |                       |         | 7.068,14             | 0,05                         |
| Verwahrstelle   |      |       | CAD   | 48.075,81             |   |                       |         | 33.718,95            | 0,22                         |
| Verwahrstelle   |      |       | HKD   | 9.925,07              |   |                       |         | 1.200,17             | 0,01                         |
| <b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>90.838,95</b>     | <b>0,59</b>                  |
| Dividendenansprüche   |      |       | EUR   |                       |   |                       |         | 83.825,83            | 0,55                         |
| Quellensteuerrück-<br>stattungsansprüche                                      |      |       | EUR   |                       |   |                       |         | 7.013,12             | 0,05                         |
| <b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>                                   |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>-359,42</b>       | <b>-0,00</b>                 |
| <b>Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>                                  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>-359,42</b>       | <b>-0,00</b>                 |
| Verwahrstelle   |      |       | GBP   | -311,25               |   |                       |         | -359,42              | -0,00                        |
| <b>Sonstige Verbindlichkeiten<sup>1)</sup></b>                                |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>-14.305,97</b>    | <b>-0,09</b>                 |
| <b>Fondsvermögen</b>  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>15.268.271,35</b> | <b>100,00<sup>2)</sup></b>   |
| <b>Anteilwert Klasse A (a)</b>  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>290,73</b>        |                              |
| <b>Anteilwert Klasse C (a)</b>  |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>253,89</b>        |                              |
| <b>Umlaufende Anteile Klasse A (a)</b>  |      |       |   |                       |   | <b>STK</b>            |         | <b>48.550</b>        |                              |
| <b>Umlaufende Anteile Klasse C (a)</b>  |      |       |   |                       |   | <b>STK</b>            |         | <b>4.542,351</b>     |                              |
| <b>Fondsvermögen Anteilklasse A (a)</b>                                       |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>14.115.012,09</b> |                              |
| <b>Fondsvermögen Anteilklasse C (a)</b>                                       |      |       |   |                       |   | <b>EUR</b>            |         | <b>1.153.259,26</b>  |                              |
| <b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>                        |      |       |   |                       |   |                       |         |                      | <b>98,90</b>                 |
| <b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>                           |      |       |   |                       |   |                       |         |                      | <b>-0,54</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.

**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. September 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 28.09.2023**

|                               |       |           |           |
|-------------------------------|-------|-----------|-----------|
| Australien, Dollar            | (AUD) | 1,64735   | = 1 (EUR) |
| Kanada, Dollar                | (CAD) | 1,42578   | = 1 (EUR) |
| Schweiz, Franken              | (CHF) | 0,96808   | = 1 (EUR) |
| Dänemark, Kronen              | (DKK) | 7,45790   | = 1 (EUR) |
| Vereinigtes Königreich, Pfund | (GBP) | 0,86597   | = 1 (EUR) |
| Hongkong, Dollar              | (HKD) | 8,26970   | = 1 (EUR) |
| Japan, Yen                    | (JPY) | 157,77000 | = 1 (EUR) |
| Mexiko, Peso                  | (MXN) | 18,61050  | = 1 (EUR) |
| Norwegen, Kronen              | (NOK) | 11,34440  | = 1 (EUR) |
| Neuseeland, Dollar            | (NZD) | 1,77310   | = 1 (EUR) |
| Philippinen, Peso             | (PHP) | 60,18720  | = 1 (EUR) |
| Schweden, Kronen              | (SEK) | 11,57060  | = 1 (EUR) |
| Singapur, Dollar              | (SGD) | 1,44380   | = 1 (EUR) |
| Thailand, Baht                | (THB) | 38,73500  | = 1 (EUR) |
| Vereinigte Staaten, Dollar    | (USD) | 1,05640   | = 1 (EUR) |
| Südafrika, Rand               | (ZAR) | 20,12720  | = 1 (EUR) |

**Marktschlüssel****Terminbörsen**

|       |   |
|-------|---|
| CBOE  | Chicago Board Options Exchange                |
| CME   | Chicago Mercantile Exchange                   |
| EUREX | European Exchange Deutschland                 |
| HKFE  | Hong Kong Futures Exchange                    |
| IFLO  | London - ICE Futures Europe - Equity Products |
| OSE   | Osaka Exchange                                |

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze****Die Vermögensgegenstände sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:**

Alle Vermögenswerte per 28.09.2023 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.<br>Anteile bzw.<br>Whg. in 1.000 | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |                     |
| <b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>  |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Aktien</b>  |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Australien</b>  |              |   |                    |                       |                     |
| Mirvac Group REIT  | AU000000MGR9 | STK   | 0                  | 265.843               |                     |
| Transurban Group   | AU000000TCL6 | STK   | 0                  | 44.490                |                     |
| <b>Belgien</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| Aedifica S.A. Anr.   | BE0970183860 | STK   | 2.588              | 2.588                 |                     |
| Warehouses de Pauw SCA -REIT-  | BE0974349814 | STK   | 0                  | 8.306                 |                     |
| <b>China</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| Enn Energy Holdings Ltd.   | KYG3066L1014 | STK   | 0                  | 26.600                |                     |
| <b>Japan</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| Toho Gas Co Ltd  | JP3600200004 | STK   | 0                  | 17.400                |                     |
| <b>Philippinen</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| International Container Terminal Services Inc  | PHY411571011 | STK   | 0                  | 95.490                |                     |
| Metro Pacific Investments Corp   | PHY603051020 | STK   | 0                  | 5.592.000             |                     |
| <b>USA (Vereinigte Staaten von Amerika)</b>  |              |   |                    |                       |                     |
| Centerpoint Energy Inc.  | US15189T1079 | STK   | 0                  | 8.600                 |                     |
| 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>Optionsrechte</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>  |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Optionsrechte auf Aktienindizes</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| Gekaufte Verkaufsoptionen (Put)  |              | EUR   |                    |                       | 8.922               |
| (Basiswert(e): Euro Stoxx 50, FTSE 100, Hang Seng, Nikkei, Standard & Poor's 500)  |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Terminkontrakte</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| <b>Futures auf Devisen</b>   |              |   |                    |                       |                     |
| Gekaufte Kontrakte   |              | EUR   |                    |                       | 9.753               |
| (Basiswert(e): Spot EUR gegen AUD, Spot EUR gegen CAD, Spot EUR gegen GBP, Spot EUR gegen JPY, Spot EUR gegen USD)                               |              |   |                    |                       |                     |

Köln, im Oktober 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](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 30.09.2023)  
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

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).

## Anlageberater

FAROS Fiduciary Management AG  
Franklinstr. 56  
60486 Frankfurt am Main  
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](http://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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)