



# Halbjahresbericht

zum 31. Dezember 2023

## Lampe SICAV

Eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital als Umbrella ("société d'investissement à capital variable") gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung  
R.C.S. B216030



HAUCK  
AUFHÄUSER  
FUND SERVICES



HAUCK  
AUFHÄUSER  
LAMPE

Zentralverwaltungsstelle

Verwahrstelle

## Inhalt

Management und Verwaltung	3
Erläuterungen zu den Vermögensübersichten (Anhang)	5
Lampe SICAV - Liquid Return	6
Lampe SICAV - Stable Return	11
Lampe SICAV - Dynamic Return	16
Lampe SICAV - AIR <sup>2</sup>	21
Lampe SICAV Zusammenfassung	24



# Management und Verwaltung

## Sitz der Gesellschaft

1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Verwaltungsrat

### Vorsitzender

**Sebastian Napiralla**  
LAM Asset Management GmbH

### Mitglieder

**Ansgar Billen**  
Hauck & Aufhäuser Alternative Investment Services S.A.

### Stefan Molter

## Zentralverwaltungsstelle

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Verwahrstelle

**Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung  
Luxemburg**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Zahl- und Kontaktstellen

### *Großherzogtum Luxemburg*

**Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung  
Luxemburg**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

### *Bundesrepublik Deutschland*

**Kontaktstelle Deutschland:**  
**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

## Fondsmanager

**Lampe Asset Management GmbH**  
Schwannstraße 10, D-40476 Düsseldorf

## Abschlussprüfer

**PricewaterhouseCoopers, Société coopérative**  
2, rue Gerhard Mercator, L-2182 Luxemburg

## Register- und Transferstelle

**Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach



## Sehr geehrte Damen und Herren,

der vorliegende Bericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung des Investmentfonds Lampe SICAV mit ihren Teilfonds Lampe SICAV - Liquid Return, Lampe SICAV - Stable Return, Lampe SICAV - Dynamic Return und Lampe SICAV - AIR<sup>2</sup>.

Lampe SICAV (die "Gesellschaft") ist eine Investmentgesellschaft, die in Luxemburg als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital ("société d'investissement à capital variable" oder "SICAV") auf der Grundlage des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (SICAV Teil I Gesetz von 2010) in Form eines Umbrellafonds in seiner jeweils gültigen Fassung am 3. Juli 2017 gegründet wurde.

Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, des Basisinformationsblattes für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP) zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht erfolgen.

Sonstige wichtige Informationen an die Aktionäre werden grundsätzlich auf der Internetseite der Zentralverwaltungsstelle ([www.hal-privatbank.com](http://www.hal-privatbank.com)) veröffentlicht. Hier finden Sie ebenfalls aktuelle Fondspreise und Fakten zu Ihren Fonds. Daneben wird, in gesetzlich vorgeschriebenen Fällen, in Luxemburg außerdem eine Veröffentlichung in einer Luxemburger Tageszeitung geschaltet.

Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023.

### Wertentwicklung des Netto-Fondsvermögens im Berichtszeitraum (nach BVI-Methode exkl. Verkaufsprovision)

Lampe SICAV - Liquid Return A acc. EUR / LU1642490699 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	2,34 %
Lampe SICAV - Liquid Return X acc. EUR / LU1642490772 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	2,45 %
Lampe SICAV - Liquid Return D dist. EUR / LU1753044525 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	2,34 %
Lampe SICAV - Stable Return A acc. EUR / LU1642490855 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	3,97 %
Lampe SICAV - Stable Return X acc. EUR / LU1642490939 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	4,24 %
Lampe SICAV - Stable Return D dist. EUR / LU1753044798 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	3,95 %
Lampe SICAV - Dynamic Return A acc. EUR / LU1642491077 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	6,09 %
Lampe SICAV - Dynamic Return X acc. EUR / LU1642491150 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	6,53 %
Lampe SICAV - Dynamic Return D dist. EUR / LU1753044871 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	6,09 %
Lampe SICAV - AIR <sup>2</sup> I acc. EUR / LU1737648557 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	3,05 %
Lampe SICAV - AIR <sup>2</sup> X acc. EUR / LU1737648631 (vom 1. Juli 2023 bis 31. Dezember 2023)	3,06 %

Die Wertentwicklung ist die prozentuale Veränderung zwischen dem angelegten Vermögen am Anfang des Anlagezeitraumes und seinem Wert am Ende des Anlagezeitraumes und beruht auf der Annahme, dass etwaige Ausschüttungen wieder angelegt wurden. Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu.



zum 31. Dezember 2023

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften nach Lux GAAP erstellt.

Der Wert einer Aktie ("Aktienwert") lautet auf die in der Übersicht der jeweiligen Teilfonds der Gesellschaft festgelegten Währung der Aktienklasse ("Aktienklassenwährung"). Er wird unter Aufsicht der Verwahrstelle von der Zentralverwaltungsstelle oder einem von ihr beauftragten Dritten an jedem im Verkaufsprospekt des jeweiligen Teilfonds der Gesellschaft festgelegten Tag ("Bewertungstag") berechnet. Die Berechnung der jeweiligen Teilfonds der Gesellschaft und ihrer Aktienklassen erfolgt durch Teilung des Vermögens je Aktienklasse durch die Zahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Aktien dieser Aktienklasse. Soweit in Jahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften Auskunft über die Situation des Vermögens der Gesellschaft insgesamt gegeben werden muss, erfolgen diese Angaben in Währung der Aktienklasse bzw. Währung der Finanzstatistik ("Referenzwährung"), und die Vermögenswerte werden in die Referenzwährung umgerechnet.

Das Netto-Gesellschaftsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Die im Gesellschaftsvermögen enthaltenen Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Anteilwert bzw. Rücknahmepreis bewertet.
- b) Der Wert von Kassenbeständen oder Bankguthaben, Einlagenzertifikaten und ausstehenden Forderungen, vorausbezahlten Auslagen, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen und noch nicht erhaltenen Zinsen entspricht dem jeweiligen vollen Betrag, es sei denn, dass dieser wahrscheinlich nicht voll bezahlt oder erhalten werden kann, in welchem Falle der Wert unter Einschluss eines angemessenen Abschlages ermittelt wird, um den tatsächlichen Wert zu erhalten.
- c) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, sofern nachfolgend nichts anderes geregelt ist.
- d) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in c) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, wird der Wert solcher Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.
- e) Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, entspricht dem jeweiligen Nettoliquidationswert, wie er gemäß den Richtlinien des Verwaltungsrates auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt wird. Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures, Forwards oder Optionen von der Gesellschaft gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettovermögenswert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Verwaltungsrat in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- f) Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet. Es wird darauf geachtet, dass Swap-Kontrakte zu marktüblichen Bedingungen im exklusiven Interesse der Gesellschaft abgeschlossen werden.
- g) Geldmarktinstrumente können zu ihrem jeweiligen Verkehrswert, wie ihn die Investmentgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbar festgelegten Bewertungsregeln bewertet werden.
- h) Sämtliche sonstige Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Marktwert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben und entsprechend dem der Investmentgesellschaft auszustellenden Verfahren zu bestimmen ist.
- i) Die auf Wertpapiere entfallenden anteiligen Zinsen werden mit einbezogen, soweit diese nicht im Kurswert berücksichtigt wurden (Dirty-Pricing).
- j) Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung der Teilfonds der Gesellschaft ausgedrückt sind, wird in diese Währung zu den zuletzt bei einer Großbank verfügbaren Devisenkursen umgerechnet. Wenn solche Kurse nicht verfügbar sind, wird der Wechselkurs nach Treu und Glauben und nach dem vom Verwaltungsrat aufgestellten Verfahren bestimmt.

Die Investmentgesellschaft kann, in Abstimmung mit der Zentralverwaltungsstelle, nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes der Gesellschaft für angebracht hält.

Wenn die Investmentgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Aktienwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Aktien der Teilfonds der Gesellschaft nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Aktienwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Investmentgesellschaft, in Abstimmung mit der Zentralverwaltungsstelle, beschließen, den Aktienwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Aktienwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Im Berichtszeitraum kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ("SFTR") zum Einsatz. Somit sind im Halbjahresbericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.

**Risikohinweise zum Ukraine-Konflikt:** Die Auswirkungen der Ukraine-Krise für den Fonds sind derzeit nicht abschließend zu beurteilen. Auch wenn keine direkten Wertpapierbestände in der Ukraine oder Russland vorhanden sind, besteht die Gefahr, dass indirekte Risiken aus den verhängten Sanktionen, entstehender Marktvolatilität oder steigenden Energiepreisen Einfluss auf die Entwicklung des Fonds oder von Geschäftspartnern nehmen.



# Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

## Lampe SICAV - Liquid Return

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>331.368.227,50</b>	<b>97,39</b>	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026)		DE000A14JZU2	Nominal	50.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,86	51.428.000,00	15,11
Bayerische Landesbank FLR-Hyp.Pfbr.v.21(24)		DE000BLB9P76	Nominal	30.500.000,00	0,00	0,00	EUR	100,02	30.506.100,00	8,97
Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2027)A.523		DE000A289K97	Nominal	14.500.000,00	0,00	0,00	EUR	102,34	14.839.662,50	4,36
Berlin, Land FLR-Landessch.v.21(2026)A.534		DE000A3H2Y40	Nominal	29.000.000,00	0,00	-3.000.000,00	EUR	102,19	29.634.665,00	8,71
Berlin, Land FLR-Landessch.v.21(2028)A.536		DE000A3H2Y65	Nominal	50.000.000,00	0,00	0,00	EUR	103,13	51.567.250,00	15,16
Berlin, Land FLR-Landessch.v.22(2028)A.540		DE000A3MQYH8	Nominal	20.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,58	20.515.100,00	6,03
Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.212 v.21(25)		DE000A2YN090	Nominal	20.500.000,00	0,00	0,00	EUR	102,94	21.101.880,00	6,20
Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.225 v.23(28)		DE000A289KR2	Nominal	18.000.000,00	0,00	0,00	EUR	104,23	18.762.030,00	5,51
L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3215 v.22(26)		DE000A3MQP83	Nominal	15.000.000,00	0,00	0,00	EUR	103,66	15.548.250,00	4,57
Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2021(2024)		DE000RLP1296	Nominal	4.500.000,00	4.500.000,00	0,00	EUR	100,83	4.537.305,00	1,33
Saarland, Land FLR-Landesschatz.R.4 v. 20(26)		DE000A289J82	Nominal	30.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,00	30.599.850,00	8,99
<b>Organisierter Markt</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.16 v.20(25)		DE000A2TR158	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	101,33	10.132.600,00	2,98
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.18 v.21(26)		DE000A2TR174	Nominal	13.000.000,00	0,00	0,00	EUR	101,47	13.191.165,00	3,88
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.25 v.23(26)		DE000A30VNR5	Nominal	19.000.000,00	19.000.000,00	0,00	EUR	100,02	19.004.370,00	5,59
<b>Derivate</b>								<b>2.303.777,83</b>	<b>0,68</b>	
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>										
Euro BOBL Future (EURX) Mar.2024	XEUR			75,00			EUR		76.340,00	0,02
Euro Bund Future (EURX) Mar.2024	XEUR			50,00			EUR		100.930,00	0,03
10Y Canadian Govt. Bond Future (ME) Mar.2024	XMOD			59,00			CAD		152.205,41	0,04
Long Term Euro OAT Futures (EURX) Mar.2024	XEUR			26,00			EUR		53.480,00	0,02
10Y Long Gilt Future (ICE) Mar.2024	IFUS			102,00			GBP		494.265,61	0,15
ITALIEN,REP.GOV.BD. (EURX) Mar.2024	XEUR			29,00			EUR		59.150,00	0,02
10Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024	XCBT			113,00			USD		241.411,69	0,07
5Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024	XCBT			174,00			USD		245.571,21	0,07



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate auf Index-Derivate</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices</b>										
SPI 200 Index Future (SFE) Mar.2024	XSFE			24,00			AUD		140.082,15	0,04
Euro Stoxx 50 Future (EURX) Mar.2024	XEUR			136,00			EUR		-46.240,00	-0,01
FTSE 100 Index Future (ICE) Mar.2024	IFUS			23,00			GBP		45.379,02	0,01
Topix Index Future (OSE) Mar.2024	XMOD			70,00			JPY		80.883,29	0,02
SMI Index Future (EURX_CHF) Mar.2024	XEUR			17,00			CHF		-3.291,57	0,00
E-Mini MSCI Em.Marktes Ind.Fut (NYB) Mar.2024	XNYM			177,00			USD		376.825,47	0,11
E-Mini Nasdaq 100 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			9,00			USD		93.837,24	0,03
E-Mini S&P 500 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			30,00			USD		192.948,31	0,06
<b>Bankguthaben</b>									<b>5.993.049,09</b>	<b>1,76</b>
<b>EUR - Guthaben</b>										
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				837.630,79			EUR		837.630,79	0,25
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
AUD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				703.662,01			AUD		434.614,13	0,13
CAD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				372.316,09			CAD		255.597,49	0,08
CHF bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				222.740,71			CHF		239.596,31	0,07
GBP bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				857.879,81			GBP		989.823,25	0,29
JPY bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				132.645.074,00			JPY		851.489,75	0,25
USD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				2.633.933,31			USD		2.384.297,37	0,70
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>2.958.120,00</b>	<b>0,87</b>
Forderungen aus Future Variation Margin				3.291,56			EUR		3.291,56	0,00
Zinsansprüche aus Bankguthaben				19.144,16			EUR		19.144,16	0,01
Zinsansprüche aus Wertpapieren				2.935.684,28			EUR		2.935.684,28	0,86
<b>Gesamtkтива</b>									<b>342.623.174,42</b>	<b>100,69</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>									<b>-2.364.418,28</b>	<b>-0,69</b>
<b>aus</b>										
Fondsmanagementvergütung				-10.823,64			EUR		-10.823,64	0,00
Future Variation Margin				-2.307.068,80			EUR		-2.307.068,80	-0,68
Prüfungskosten				-6.468,33			EUR		-6.468,33	0,00
Risikomanagementvergütung				-800,00			EUR		-800,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten				-1.414,93			EUR		-1.414,93	0,00



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Taxe d'abonnement				-14.646,43			EUR		-14.646,43	0,00
Transfer- und Registerstellenvergütung				-330,00			EUR		-330,00	0,00
Verwahrstellenvergütung				-8.175,83			EUR		-8.175,83	0,00
Verwaltungsvergütung				-14.198,68			EUR		-14.198,68	0,00
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-491,64			EUR		-491,64	0,00
<b>Gesamtpassiva</b>									<b>-2.364.418,28</b>	<b>-0,69</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>340.258.756,14</b>	<b>100,00**</b>
<b>Umlaufende Aktien A acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>535.386,000</b>	
<b>Umlaufende Aktien X acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>2.712.892,698</b>	
<b>Umlaufende Aktien D dist. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>71.417,000</b>	
<b>Inventarwert je Aktie A acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>101,33</b>	
<b>Inventarwert je Aktie X acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>102,79</b>	
<b>Inventarwert je Aktie D dist. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>99,95</b>	

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Fonds, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar	AUD	1,6191	per 29.12.2023 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,8667	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	155,7800	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,4567	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,9297	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,1047	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminhandel

IFUS	ICE Futures U.S.
XCBT	Chicago Board Of Trade
XCME	Chicago Mercantile Exchange
XEUR	Eurex Deutschland
XMOD	The Montreal Exchange / Bourse De Montreal
XNYM	New York Mercantile Exchange
XSFE	ASX - Trade24



Fondsvermögen, umlaufende Aktien und Aktienwert  
Lampe SICAV - Liquid Return

	Aktienklasse A acc. EUR in EUR	Aktienklasse X acc. EUR in EUR	Aktienklasse D dist. EUR in EUR
<b>zum 31.12.2023</b>			
Fondsvermögen	54.250.275,36	278.870.523,47	7.137.957,31
Umlaufende Aktien	535.386,000	2.712.892,698	71.417,000
Inventarwert je Aktie	101,33	102,79	99,95



# Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

## Lampe SICAV - Stable Return

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Wertpapiervermögen</b>									<b>163.415.145,00</b>	<b>95,31</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026)		DE000A14JZT4	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,51	10.250.800,00	5,98
Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026)		DE000A14JZU2	Nominal	6.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,86	6.171.360,00	3,60
Bayerische Landesbank FLR-Hyp.Pfbr.v.21(24)		DE000BLB9P76	Nominal	6.500.000,00	0,00	0,00	EUR	100,02	6.501.300,00	3,79
Berlin, Land FLR-Landessch.v.21(2026)A.534		DE000A3H2Y40	Nominal	16.000.000,00	0,00	-2.000.000,00	EUR	102,19	16.350.160,00	9,54
Berlin, Land FLR-Landessch.v.21(2028)A.536		DE000A3H2Y65	Nominal	10.000.000,00	0,00	-5.000.000,00	EUR	103,13	10.313.450,00	6,02
Berlin, Land FLR-Landessch.v.22(2028)A.540		DE000A3MQYH8	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,58	10.257.550,00	5,98
Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.21(25)		DE000A3E5SH3	Nominal	5.000.000,00	0,00	0,00	EUR	101,30	5.065.175,00	2,95
Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.23(28)		DE000A3E5SR2	Nominal	20.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,61	20.122.800,00	11,74
Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.225 v.23(28)		DE000A289KR2	Nominal	20.000.000,00	0,00	0,00	EUR	104,23	20.846.700,00	12,16
L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3215 v.22(26)		DE000A3MQP83	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	103,66	10.365.500,00	6,05
Saarland, Land FLR-Landesschatz.R.3 v. 20(25)		DE000A289J74	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,86	10.085.900,00	5,88
<b>Supranational</b>										
Europäische Union EO-Bills Tr. 5.4.2024		EU000A3K4EK1	Nominal	5.000.000,00	10.000.000,00	-5.000.000,00	EUR	99,04	4.952.050,00	2,89
<b>Organisierter Markt</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.18 v.21(26)		DE000A2TR174	Nominal	10.000.000,00	0,00	0,00	EUR	101,47	10.147.050,00	5,92
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.22 v.23(27)		DE000A30VNN4	Nominal	9.000.000,00	0,00	0,00	EUR	99,80	8.982.360,00	5,24
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.25 v.23(26)		DE000A30VNR5	Nominal	13.000.000,00	20.000.000,00	-7.000.000,00	EUR	100,02	13.002.990,00	7,58
<b>Derivate</b>									<b>4.059.082,09</b>	<b>2,37</b>
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>										
Euro BOBL Future (EURX) Mar.2024	XEUR			85,00			EUR		101.520,00	0,06
Euro Bund Future (EURX) Mar.2024	XEUR			57,00			EUR		141.580,00	0,08
10Y Canadian Govt. Bond Future (ME) Mar.2024	XMOD			67,00			CAD		203.961,14	0,12
Long Term Euro OAT Futures (EURX) Mar.2024	XEUR			30,00			EUR		77.580,00	0,05
10Y Long Gilt Future (ICE) Mar.2024	IFUS			115,00			GBP		645.148,27	0,38
ITALIEN,REP.GOV.BD. (EURX) Mar.2024	XEUR			33,00			EUR		85.230,00	0,05
10Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024	XCBT			127,00			USD		322.853,48	0,19
5Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024	XCBT			196,00			USD		328.461,72	0,19



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate auf Index-Derivate</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices</b>										
SPI 200 Index Future (SFE) Mar.2024	XSFE			60,00			AUD		351.131,84	0,20
Euro Stoxx 50 Future (EURX) Mar.2024	XEUR			334,00			EUR		-118.570,00	-0,07
FTSE 100 Index Future (ICE) Mar.2024	IFUS			56,00			GBP		111.457,25	0,07
Topix Index Future (OSE) Mar.2024	XMOD			172,00			JPY		198.741,81	0,12
SMI Index Future (EURX_CHF) Mar.2024	XEUR			43,00			CHF		-8.788,26	-0,01
E-Mini MSCI Em.Marktes Ind.Fut (NYB) Mar.2024	XNYM			428,00			USD		926.318,96	0,54
E-Mini Nasdaq 100 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			22,00			USD		229.379,93	0,13
E-Mini S&P 500 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			72,00			USD		463.075,95	0,27
<b>Bankguthaben</b>									<b>6.734.160,86</b>	<b>3,93</b>
<b>EUR - Guthaben</b>										
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				713.705,82			EUR		713.705,82	0,42
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
AUD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				585.375,86			AUD		361.555,15	0,21
CAD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				590.238,50			CAD		405.202,69	0,24
CHF bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				469.267,39			CHF		504.778,56	0,29
GBP bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				943.095,42			GBP		1.088.145,17	0,63
JPY bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				166.768.955,00			JPY		1.070.541,50	0,62
USD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				2.861.429,26			USD		2.590.231,97	1,51
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>1.389.526,43</b>	<b>0,81</b>
Forderungen aus Future Variation Margin				8.788,25			EUR		8.788,25	0,01
Zinsansprüche aus Bankguthaben				19.609,52			EUR		19.609,52	0,01
Zinsansprüche aus Wertpapieren				1.361.128,66			EUR		1.361.128,66	0,79
<b>Gesamtkтива</b>									<b>175.597.914,38</b>	<b>102,42</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>									<b>-4.147.673,17</b>	<b>-2,42</b>
<b>aus</b>										
Fondsmanagementvergütung				-44.481,08			EUR		-44.481,08	-0,03
Future Variation Margin				-4.067.871,49			EUR		-4.067.871,49	-2,37
Prüfungskosten				-6.468,33			EUR		-6.468,33	0,00
Risikomanagementvergütung				-800,00			EUR		-800,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten				-1.414,93			EUR		-1.414,93	0,00



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Taxe d'abonnement				-14.249,88			EUR		-14.249,88	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung				-330,00			EUR		-330,00	0,00
Verwahrstellenvergütung				-4.206,53			EUR		-4.206,53	0,00
Verwaltungsvergütung				-7.305,27			EUR		-7.305,27	0,00
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-545,66			EUR		-545,66	0,00
<b>Gesamtpassiva</b>									<b>-4.147.673,17</b>	<b>-2,42</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>171.450.241,21</b>	<b>100,00**</b>
<b>Umlaufende Aktien A acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>804.806,000</b>	
<b>Umlaufende Aktien X acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>640.292,000</b>	
<b>Umlaufende Aktien D dist. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>136.309,000</b>	
<b>Inventarwert je Aktie A acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>108,51</b>	
<b>Inventarwert je Aktie X acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>112,18</b>	
<b>Inventarwert je Aktie D dist. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>90,19</b>	

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Fonds, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar	AUD	1,6191	per 29.12.2023 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,8667	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	155,7800	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,4567	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,9297	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,1047	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminhandel

IFUS	ICE Futures U.S.
XCBT	Chicago Board Of Trade
XCME	Chicago Mercantile Exchange
XEUR	Eurex Deutschland
XMOD	The Montreal Exchange / Bourse De Montreal
XNYM	New York Mercantile Exchange
XSFE	ASX - Trade24



Fondsvermögen, umlaufende Aktien und Aktienwert  
Lampe SICAV - Stable Return

	Aktienklasse A acc. EUR in EUR	Aktienklasse X acc. EUR in EUR	Aktienklasse D dist. EUR in EUR
<b>zum 31.12.2023</b>			
Fondsvermögen	87.326.137,99	71.829.959,45	12.294.143,77
Umlaufende Aktien	804.806,000	640.292,000	136.309,000
Inventarwert je Aktie	108,51	112,18	90,19



# Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

## Lampe SICAV - Dynamic Return

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>31.975.270,00</b>	<b>84,00</b>	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026)		DE000A14JZU2	Nominal	6.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,86	6.171.360,00	16,21
Bayerische Landesbank FLR-Hyp.Pfbr.v.21(24)		DE000BLB9P76	Nominal	3.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,02	3.000.600,00	7,88
Berlin, Land FLR-Landessch.v.18(2026)A.499		DE000A2AAPS4	Nominal	3.500.000,00	0,00	-1.500.000,00	EUR	100,77	3.526.915,00	9,27
Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2027)A.523		DE000A289K97	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,34	1.023.425,00	2,69
Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.21(25)		DE000A3E5SH3	Nominal	2.000.000,00	0,00	0,00	EUR	101,30	2.026.070,00	5,32
Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.23(28)		DE000A3E5SR2	Nominal	4.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,61	4.024.560,00	10,57
Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.212 v.21(25)		DE000A2YN090	Nominal	6.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,94	6.176.160,00	16,23
Niedersachsen, Land FLR-Landessch.v.14(24) Aus.583		DE000A12T9W9	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,05	1.000.450,00	2,63
Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2021(2024)		DE000RLP1296	Nominal	3.000.000,00	3.000.000,00	0,00	EUR	100,83	3.024.870,00	7,95
<b>Organisierter Markt</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.24 v.23(25)		DE000A30VNI7	Nominal	2.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,04	2.000.860,00	5,26
<b>Derivate</b>								<b>1.662.269,89</b>	<b>4,37</b>	
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>										
Euro BOBL Future (EURX) Mar.2024		XEUR		37,00			EUR		45.900,00	0,12
Euro Bund Future (EURX) Mar.2024		XEUR		25,00			EUR		64.140,00	0,17
10Y Canadian Govt. Bond Future (ME) Mar.2024		XMOD		29,00			CAD		87.337,39	0,23
Long Term Euro OAT Futures (EURX) Mar.2024		XEUR		13,00			EUR		34.420,00	0,09
10Y Long Gilt Future (ICE) Mar.2024		IFUS		50,00			GBP		285.104,42	0,75
ITALIEN,REP.GOV.BD. (EURX) Mar.2024		XEUR		14,00			EUR		39.150,00	0,10
10Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024		XCBT		56,00			USD		138.739,58	0,36
5Y Treasury Notes Future (CBT) Mar.2024		XCBT		86,00			USD		141.228,98	0,37
<b>Derivate auf Index-Derivate</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices</b>										
SPI 200 Index Future (SFE) Mar.2024		XSFE		23,00			AUD		134.245,39	0,35
Euro Stoxx 50 Future (EURX) Mar.2024		XEUR		129,00			EUR		-44.505,00	-0,12



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
FTSE 100 Index Future (ICE) Mar.2024	IFUS			21,00			GBP		41.433,02	0,11
Topix Index Future (OSE) Mar.2024	XMOD			68,00			JPY		78.572,35	0,21
SMI Index Future (EURX_CHF) Mar.2024	XEUR			16,00			CHF		-3.097,94	-0,01
E-Mini MSCI Em.Marktes Ind.Fut (NYB) Mar.2024	XNYM			173,00			USD		362.537,34	0,95
E-Mini Nasdaq 100 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			8,00			USD		83.410,88	0,22
E-Mini S&P 500 Index Future (CME) Mar.2024	XCME			27,00			USD		173.653,48	0,46
<b>Bankguthaben</b>									<b>5.862.446,46</b>	<b>15,40</b>
<b>EUR - Guthaben</b>										
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				1.259.824,35			EUR		1.259.824,35	3,31
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
AUD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				592.298,41			AUD		365.830,83	0,96
CAD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				224.718,49			CAD		154.270,75	0,41
CHF bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				163.475,06			CHF		175.845,81	0,46
GBP bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				502.655,23			GBP		579.964,50	1,52
JPY bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				151.731.120,00			JPY		974.008,99	2,56
USD bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg				2.599.029,05			USD		2.352.701,23	6,18
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>269.275,97</b>	<b>0,71</b>
Forderungen aus Future Variation Margin				3.097,94			EUR		3.097,94	0,01
Zinsansprüche aus Bankguthaben				13.676,57			EUR		13.676,57	0,04
Zinsansprüche aus Wertpapieren				252.501,46			EUR		252.501,46	0,66
<b>Gesamttaktiva</b>									<b>39.769.262,32</b>	<b>104,48</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>									<b>-1.705.219,66</b>	<b>-4,48</b>
<b>aus</b>										
Fondsmanagementvergütung				-23.367,97			EUR		-23.367,97	-0,06
Future Variation Margin				-1.665.368,08			EUR		-1.665.368,08	-4,38
Prüfungskosten				-6.468,32			EUR		-6.468,32	-0,02
Risikomanagementvergütung				-800,00			EUR		-800,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten				-1.414,93			EUR		-1.414,93	0,00
Taxe d'abonnement				-4.455,30			EUR		-4.455,30	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung				-330,00			EUR		-330,00	0,00



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verwahrstellenvergütung				-895,10			EUR		-895,10	0,00
Verwaltungsvergütung				-1.554,47			EUR		-1.554,47	0,00
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-565,49			EUR		-565,49	0,00
<b>Gesamtpassiva</b>									<b>-1.705.219,66</b>	<b>-4,48</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>38.064.042,66</b>	<b>100,00**</b>
<b>Umlaufende Aktien A acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>290.454,707</b>	
<b>Umlaufende Aktien X acc. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>25.084,000</b>	
<b>Umlaufende Aktien D dist. EUR</b>			<b>STK</b>						<b>19.153,000</b>	
<b>Inventarwert je Aktie A acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>114,85</b>	
<b>Inventarwert je Aktie X acc. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>120,89</b>	
<b>Inventarwert je Aktie D dist. EUR</b>			<b>EUR</b>						<b>87,37</b>	

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Fonds, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar	AUD	1,6191	per 29.12.2023 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,8667	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	155,7800	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,4567	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,9297	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,1047	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminhandel

IFUS	ICE Futures U.S.
XCBT	Chicago Board Of Trade
XCME	Chicago Mercantile Exchange
XEUR	Eurex Deutschland
XMOD	The Montreal Exchange / Bourse De Montreal
XNYM	New York Mercantile Exchange
XSFE	ASX - Trade24



Fondsvermögen, umlaufende Aktien und Aktienwert  
Lampe SICAV - Dynamic Return

	Aktienklasse A acc. EUR in EUR	Aktienklasse X acc. EUR in EUR	Aktienklasse D dist. EUR in EUR
<b>zum 31.12.2023</b>			
Fondsvermögen	33.358.243,56	3.032.495,72	1.673.303,38
Umlaufende Aktien	290.454,707	25.084,000	19.153,000
Inventarwert je Aktie	114,85	120,89	87,37



# Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

## Lampe SICAV - AIR<sup>2</sup>

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Investmentanteile*</b>								<b>78.661.644,23</b>	<b>97,65</b>
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
<b>Bundesrep. Deutschland</b>									
ansa-gl Q equity market neutr. Inhaber-Anteile S	DE000A3DEBZ3	Anteile	20.000,00	5.000,00	0,00	EUR	107,16	2.143.200,00	2,66
Empureon Volatility One Fund Inhaber-Anteile I	DE000A3D9GL3	Anteile	1.900,00	1.900,00	0,00	EUR	1.034,67	1.965.873,00	2,44
First Private Wealth Inhaber-Anteile A	DE000A0KFUX6	Anteile	60.000,00	13.000,00	-20.000,00	EUR	84,05	5.043.000,00	6,26
FP Artellium Evolution EUR Inhaber-Anteile S	DE000A0Q95M1	Anteile	36.000,00	0,00	-4.000,00	EUR	110,76	3.987.360,00	4,95
Mainberg Special Situations Fd Inhaber-Anteile HI I	DE000A2JQH97	Anteile	9.000,00	9.000,00	0,00	EUR	128,85	1.159.650,00	1,44
ProfitlichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse SI	DE000A2H7PB6	Anteile	400,00	0,00	-500,00	EUR	1.435,21	574.084,00	0,71
TBF ATTILA GLOBAL OPPORTUNITY Inhaber-Anteile EUR I	DE000A0YJMM9	Anteile	2.300,00	0,00	0,00	EUR	1.244,41	2.862.143,00	3,55
<b>Irland</b>									
Amundi Alt.IV-A.Met.Eps.Gl.Tr. Registered Shares I EUR o.N.	IE00B643RZ01	Anteile	14.000,00	0,00	-3.000,00	EUR	152,44	2.134.165,60	2,65
JMS ICAV - AlphaCore One Registered Shares D EUR o.N.	IE00BF0W0P57	Anteile	9.000,00	0,00	-7.000,00	EUR	287,52	2.587.680,00	3,21
Lafa.-Dalton Asia Pacific Reg. Shs B2 EUR Acc. o.N.	IE00BFXZM884	Anteile	1.900,00	0,00	-200,00	EUR	2.133,04	4.052.776,00	5,03
Man Fds VI-GLG Event Driv.Alt. Reg. Shs INF Hgd EUR Acc. o.N.	IE00BJBLGJ52	Anteile	18.000,00	18.000,00	0,00	EUR	126,59	2.278.620,00	2,83
Man VI-Man GLG Alpha Sel.Alt. Regist.Acc.Shares IN H EUR o.N.	IE00BJQ2XG97	Anteile	38.000,00	0,00	-2.500,00	EUR	126,91	4.822.580,00	5,99
ML-Coop.Creek Part.N.A.L.S.Eq. Reg. Shs INST PLD EUR Acc. o.N.	IE00BG08P667	Anteile	6.000,00	6.000,00	0,00	EUR	167,83	1.006.974,60	1,25
OAKS EM.U.-OAKS Em.a.Fr.Opp.Fd Reg.Shs A EUR Acc.Ser.1 o.N.	IE00B95L3899	Anteile	165.000,00	0,00	-15.000,00	EUR	21,53	3.552.119,98	4,41
Strate.I.F.U.-Alpine Merg.Arb. Registered Shares EI EUR o.N.	IE00BG7PPT32	Anteile	21.000,00	0,00	-19.000,00	EUR	107,77	2.263.170,00	2,81
<b>Liechtenstein</b>									
Incrmntm Umbr.Fd-I.Crypto Gold Nam.-Ant. I EUR Acc. o.N.	LI1100044570	Anteile	5.000,00	5.000,00	0,00	EUR	98,07	490.350,00	0,61
<b>Luxemburg</b>									
A.P.-A.P.Quant.Managed Futures Act.au Port. I4C-E EUR Acc. o.N.	LU1869436193	Anteile	900,00	0,00	-300,00	EUR	1.338,36	1.204.524,00	1,50
Allspring(L)WW-Gl.L/S Equ.Fd Namens-Ant. IP Acc. EUR-H. o.N.	LU1755418701	Anteile	34.911,00	3.000,00	0,00	EUR	98,38	3.434.544,18	4,26
AlmaPlat.IV-DLD Conv.Arb. Act. Nom. I2C EUR Acc. o.N.	LU2334539942	Anteile	18.000,00	0,00	-4.000,00	EUR	88,61	1.594.980,00	1,98
Assenagon Alpha Volatility Namens-Anteile I o.N.	LU0575255335	Anteile	1.100,00	0,00	-300,00	EUR	1.101,30	1.211.430,00	1,50
BlueBalance-Global Opport.Fd Act. Nom. EB EUR Acc. o.N.	LU2022233972	Anteile	24.000,00	0,00	-6.000,00	EUR	114,26	2.742.312,00	3,40
BSF-BkRk Syst.US Eq.Abs.Rtn Fd Act. Nom. D2 EUR Hed. o.N.	LU0725892383	Anteile	27.000,00	5.000,00	-6.000,00	EUR	141,39	3.817.530,00	4,74
CT (Lux) Credit Opportunities Act. Nom. 2E EUR Acc. o.N.	LU1849560120	Anteile	230.000,00	30.000,00	0,00	EUR	10,01	2.302.898,00	2,86
Fundsolution-alphatrend Fund Act. au Port. EUR Dis. o.N.	LU2406613492	Anteile	17.000,00	0,00	0,00	EUR	105,08	1.786.360,00	2,22
JPMorg.I.-Global Macro Opp.Fd Namens-Anteile C Acc.EUR o.N.	LU0095623541	Anteile	18.000,00	0,00	-1.000,00	EUR	166,12	2.990.160,00	3,71
LUMYNA-MY Asian Ev.-Dr.UCITS Reg. Shares B Acc.EUR o.N.	LU0532510137	Anteile	5.000,00	3.000,00	-13.000,00	EUR	141,81	709.050,00	0,88

\* Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich.



Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.12.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Lupus alpha Fds-All Opps.Fund Inhaber-Anteile C o.N.	LU0329425713	Anteile	20.000,00	3.964,00	-4.028,00	EUR	134,58	2.691.599,87	3,34
Schroder GAIA-Sirios US Equity Reg.Acc.Shs C EUR Hed.o.N.	LU0885728401	Anteile	30.000,00	0,00	0,00	EUR	154,93	4.647.900,00	5,77
Schroder ISF-EO Cr.Conv.Sh.Dur Namens-Anteile C Acc.EUR o.N.	LU1293074800	Anteile	33.000,00	5.000,00	0,00	EUR	113,57	3.747.810,00	4,65
<b>KVG-eigene Investmentanteile</b>									
<b>Luxemburg</b>									
Tungsten TRYCON AI GI Markets Inh.-Ant. C (inst.) o.N.	LU0451958309	Anteile	40.000,00	10.000,00	-13.000,00	EUR	121,42	4.856.800,00	6,03
<b>Bankguthaben</b>								<b>1.901.909,97</b>	<b>2,36</b>
<b>EUR - Guthaben</b>									
EUR bei Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Niederlassung Luxemburg			1.901.909,97			EUR		1.901.909,97	2,36
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>3.816,41</b>	<b>0,00</b>
Zinsansprüche aus Bankguthaben			3.816,41			EUR		3.816,41	0,00
<b>Gesamtaktiva</b>								<b>80.567.370,61</b>	<b>100,02</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>								<b>-15.994,21</b>	<b>-0,02</b>
<b>aus</b>									
Prüfungskosten			-6.468,32			EUR		-6.468,32	-0,01
Risikomanagementvergütung			-800,00			EUR		-800,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten			-1.414,93			EUR		-1.414,93	0,00
Taxe d'abonnement			-1.070,36			EUR		-1.070,35	0,00
Transfer- und Registerstellenvergütung			-330,00			EUR		-330,00	0,00
Verwahrstellenvergütung			-1.928,37			EUR		-1.928,37	0,00
Verwaltungsvergütung			-3.348,91			EUR		-3.348,91	0,00
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben			-633,33			EUR		-633,33	0,00
<b>Gesamtpassiva</b>								<b>-15.994,21</b>	<b>-0,02</b>
<b>Fondsvermögen</b>								<b>80.551.376,40</b>	<b>100,00**</b>
Umlaufende Aktien I acc. EUR		STK						1,000	
Umlaufende Aktien X acc. EUR		STK						758.339,000	
Inventarwert je Aktie I acc. EUR		EUR						101,74	
Inventarwert je Aktie X acc. EUR		EUR						106,22	

\*\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



Fondsvermögen, umlaufende Aktien und Aktienwert  
Lampe SICAV - AIR<sup>2</sup>

	Aktienklasse I acc. EUR in EUR	Aktienklasse X acc. EUR in EUR
<b>zum 31.12.2023</b>		
Fondsvermögen	101,74	80.551.274,66
Umlaufende Aktien	1,000	758.339,000
Inventarwert je Aktie	101,74	106,22



# Lampe SICAV Zusammenfassung

## Zusammengefasste Vermögensübersicht Lampe SICAV

zum 31. Dezember 2023

	in EUR	in %
<b>Aktiva</b>		
Wertpapiervermögen zum Kurswert	526.758.642,50	83,57
Investmentanteile	78.661.644,23	12,48
Derivate	8.025.129,81	1,27
Bankguthaben	20.491.566,38	3,25
Zinsansprüche aus Bankguthaben	56.246,66	0,01
Zinsansprüche aus Wertpapieren	4.549.314,40	0,72
Forderungen Future Variation Margin	15.177,75	0,00
<b>Gesamtaktiva</b>	<b>638.557.721,73</b>	<b>101,31</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus		
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben	-1.602,75	0,00
Prüfungskosten	-25.873,30	0,00
Verwahrstellenvergütung	-15.205,83	0,00
Risikomanagementvergütung	-3.200,00	0,00
Taxe d'abonnement	-34.421,96	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung	-1.320,00	0,00
Verwaltungsvergütung	-26.407,33	0,00
Future Variation Margin	-8.040.308,37	-1,28
Sonstige Verbindlichkeiten	-5.659,72	0,00
Fondsmanagementvergütung	-78.672,69	-0,01
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben	-633,37	0,00
<b>Gesamtpassiva</b>	<b>-8.233.305,32</b>	<b>-1,31</b>
<b>Zusammengefasstes Fondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>630.324.416,41</b>	<b>100,00*</b>

\*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

