

Jahresbericht

NV Strategie Quattro Plus AMI

1. Oktober 2017 bis 30. September 2018

Alternativer
Investmentfonds



Inhaltsverzeichnis

Jahresbericht NV Strategie Quattro Plus AMI für den Zeitraum vom 1. Oktober 2017 bis 30. September 2018

Wichtige Information für die Anteilhaber	4
Hinweise zu den Tätigkeiten der Gesellschaft	5
Hinweise zu den Anteilklassen des Sondervermögens	6
Anlageziele, Anlagestrategie, Anlagegrundsätze und Anlagegrenzen	7
Auf einen Blick	8
Bericht des Fondsmanagements	9
Vermögensübersicht	13
Vermögensaufstellung	13
Devisenkurse	14
Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	14
Angaben zu den Kosten gemäß § 16 Absatz 1 Nummer 3 d KARBV	14
Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)	15
Entwicklung des Sondervermögens	15
Berechnung der Wiederanlage	15
Vergleichende Übersicht	15
Angaben nach der Derivateverordnung	16
Sonstige Angaben	16
Zusätzliche Angaben nach § 16 Absatz 1 Nummer 2 KARBV	16
Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote	16
Angaben zur Mitarbeitervergütung	17
Zusätzliche Angaben	17
Angaben zu neuen Regelungen zum Liquiditätsmanagement	17
Angaben zum Risikoprofil	17
Besonderer Vermerk des Abschlussprüfers	18
Steuerliche Hinweise	19
Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft	20

Wichtige Information für die Anteilhaber

Kündigung des Verwaltungsrechts

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

die Ampega Investment GmbH, Köln, hat gemäß § 98 Abs. 2 KAGB in Verbindung mit § 17 Abs. 1 und 4 der Allgemeinen Anlagebedingungen die Ausgabe und Rücknahme der Anteilsscheine des gemischten Sondervermögens **NV Strategie Quattro Plus AMI**, Anteilklasse P seit dem 11.08.2014 bis auf Weiteres ausgesetzt (Veröffentlichung im Bundesanzeiger vom 12.08.2014).

Die Ampega Investment GmbH, Köln, kündigt gemäß § 99 Absatz 1 KAGB in Verbindung mit § 21 Absatz 1 der Allgemeinen Vertragsbedingungen die Verwaltung des gemischten Sondervermögens **NV Strategie Quattro Plus AMI** zum 11.08.2020.

Mit Wirksamwerden der Kündigung geht das Verwaltungsrecht über das Sondervermögen kraft Gesetzes auf die Ver-

wahrstelle, Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA mit Sitz in Frankfurt am Main über.

Die Ampega Investment GmbH geht davon aus, dass das Sondervermögen vor Ablauf der Kündigungsfrist durch die Ampega Investment GmbH abgewickelt sein wird. Der Erlös wird abzüglich der noch durch den Fonds zu tragenden Kosten und der durch die Auflösung verursachten Kosten an die Anteilhaber verteilt.

Die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht ist über den Sachverhalt informiert.

Köln, im April 2016

Ampega Investment GmbH
Die Geschäftsführung

Hinweise zu den Tätigkeiten der Gesellschaft

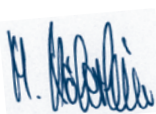
Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

auf den nachfolgenden Seiten informieren wir Sie über die Entwicklung unseres Publikumsfonds **NV Strategie Quattro Plus AMI** innerhalb des Geschäftsjahres vom 1. Oktober 2017 bis 30. September 2018.

Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates, den Gesellschafterkreis sowie über das gezeichnete und eingezahlte Kapital finden Sie im Abschnitt „Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft“.

Köln, im März 2019

Ampega Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Manfred Köberlein



Ralf Pohl

Hinweise zu den Anteilklassen des Sondervermögens

Alle Anteile derselben Anteilklasse haben gleiche Ausgestaltungsmerkmale.

Derzeit hat die Gesellschaft für das Sondervermögen die Anteilklasse P gebildet. Die Bildung von Anteilklassen mit unterschiedlichen Ausgestaltungsmerkmalen und Ausgabe entsprechender Anteile ist zulässig, sie liegt im Ermessen der Gesellschaft. Anteile mit gleichen Ausgestaltungsmerkmalen bilden in diesem Fall jeweils eine Anteilklasse. Über die Einrichtung von unterschiedlichen Anteilklassen wird die Gesellschaft die Anleger auf ihrer Homepage (www.ampega.com) unterrichten.

Alle ausgegebenen Anteile haben bis auf die durch Einrichtung der Anteilklassen bedingten Unterschiede gleiche Rechte.

Für den Fonds können Anteilklassen gebildet werden, die sich hinsichtlich der Ertragsverwendung, des Ausgabeaufschlags, der Währung des Anteilwertes einschließlich des Einsatzes von Währungssicherungsgeschäften, der Verwaltungsvergütung, der Vergütung für die Verwahrstelle, der Vertriebsvergütung, der erfolgsbezogenen Vergütung, der Mindestanlagesumme oder einer Kombination dieser Merkmale unterscheiden.

Nähere Informationen und Einzelheiten insbesondere hinsichtlich der Anteilpreisberechnung bei der Bildung von unterschiedlichen Anteilklassen sind im Verkaufsprospekt beschrieben, den Sie kostenlos bei der Gesellschaft erhalten.

Anlageziele, Anlagestrategie, Anlagegrundsätze und Anlagegrenzen

Der **NV Strategie Quattro Plus AMI** ist ein Mischfonds. Die Anleger sind an den Vermögensgegenständen des Fonds entsprechend der Anzahl ihrer Anteile als Miteigentümer nach Bruchteilen beteiligt.

Der **NV Strategie Quattro Plus AMI** strebt als Anlageziel ein attraktives Kapitalwachstum an. Dieses Ziel soll durch einen Multi-Asset-Class-Investing Ansatz über sämtliche Assetklassen hinweg erreicht werden. Der **NV Strategie Quattro Plus AMI** investiert u. a. in Aktienfonds, Rentenfonds, so genannte Rohstofffonds.

Der Fonds orientiert sich nicht an einem Vergleichsmaßstab.

Je nach Marktlage können danach für den **NV Strategie Quattro Plus AMI** jeweils bis zu 100 % Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile und gemischte Sondervermögen erworben werden. In Wertpapiere und Geldmarktinstrumente besonderer Aussteller darf die Gesellschaft mehr als 35 % des Wertes des Fonds angelegen. Diese Aussteller sind in den Besonderen Anlagebedingungen im Einzelnen genannt. Es handelt sich im Wesentlichen um die Bundesrepublik Deutschland und die Bundesländer, die Europäische

Gemeinschaften, andere Mitgliedstaaten der Europäischen Union, andere Vertragsstaaten des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum, sowie andere Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung, die nicht Mitglied des EWR sind.

Die Gesellschaft darf bis zu 10 % des Wertes des Fonds anlegen in Anteilen an Sonstigen Sondervermögen nach Maßgabe des §§ 220 bis 224 KAGB, Anteilen von ausländischen Investmentvermögen, die diesen Sondervermögen vergleichbar sind sowie Aktien von Investmentaktiengesellschaften nach Maßgabe des §§ 220 bis 224 KAGB, deren Satzung eine vergleichbare Anlageform vorsieht.

Für den Fonds können die nach dem KAGB und den Anlagebedingungen zulässigen Vermögensgegenstände erworben werden. Dabei handelt es sich vor allem um Wertpapiere. Daneben ist auch die Anlage in Finanzinstrumenten und Bankguthaben sowie sonstigen Vermögensgegenständen möglich, die im KAGB und in den Anlagebedingungen genannt sind.

Derivate dürfen zum Zwecke der Absicherung, der effizienten Portfoliosteuerung und der Erzielung von Zusatzerträgen eingesetzt werden. Das Marktrisikopotential beträgt maximal 200 %.

Auf einen Blick (Stand 30.09.2018)

Anteilklasse P

ISIN:	DE000A0HGZZ4
Auflagedatum:	15.12.2005
Währung:	Euro
Geschäftsjahr:	01.10. - 30.09.
Ertragsverwendung:	Thesaurierung
Ausgabeaufschlag (derzeit):	5,00 %
Verwaltungsvergütung (p.a.):	0,49 %
Beratervergütung (p.a.):	0,38 %
Verwahrstellenvergütung (p.a.) zzgl. MwSt.:	0,05 %
Fondsvermögen per 30.09.2018:	3.205.134,34 EUR
Nettomittelaufkommen (01.10.2017 – 30.09.2018):	0,00 EUR
Anteilumlauf per 30.09.2018:	155.881 Stück
Anteilwert (= Rücknahmepreis) per 30.09.2018:	20,56 EUR
Wertentwicklung (im Berichtszeitraum):	-11,93 %
TER (Total Expense Ratio) nach BVI-Methode (01.10.2017 – 30.09.2018):	1,84 %

Bericht des Fondsmanagements

Anlageziel

Das Sondervermögen **NV Strategie Quattro Plus AMI** strebt als Anlageziel ein attraktives Kapitalwachstum an.

Anlagestrategie

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft hat sich nach vorheriger Mitteilung an die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) dazu entschieden, die Ausgabe und Rücknahme der Anteilscheine des Sondervermögens **NV Strategie Quattro Plus AMI** mit Wirkung zum 11. August 2014 mangels ausreichender Liquidität auszusetzen und die Erlöse aus dem Verkauf der Vermögensgegenstände sukzessive an die Anteilseigner auszuschütten. Die Liquiditätsbestände haben nicht mehr ausgereicht, um die Anteilscheinrückgaben der Anleger zu bedienen. Diese Entscheidung hat die Kapitalverwaltungsgesellschaft getroffen, um die Interessen der bestehenden Anleger zu schützen. Auf die Anteilpreisberechnung hat die Aussetzung der Rückgabe von Anteilscheinen zunächst keine Auswirkung. Die Anteilpreisberechnung erfolgt weiterhin auf täglicher Basis. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft hat am 13. April 2016 die Kündigung des Verwaltungsrechts zum 11. August 2020 veröffentlicht.

Im laufenden Berichtszeitraum kam es zu einer Ausschüttung im Februar 2018 in Höhe von 5,08 EUR je Anteil. Auch in Zukunft wird eine weiterhin zügige Rückführung der Gelder an die Anleger angestrebt.

Im aktuellen Geschäftsjahr erzielte der **NV Strategie Quattro Plus AMI** eine Wertentwicklung von -11,93 %. Die Jahresvolatilität des Fonds betrug 8,77 %.

Wesentliche Risiken des Sondervermögens im Berichtszeitraum

1. Marktpreisrisiken

Währungsrisiken

Die Schwerpunktinvestitionen des Fonds liegen in Titeln, die auf Euro lauten. Es bestehen zum Berichtsstichtag keine direkten Investments in Fremdwährungen. Währungsrisiken resultieren jedoch durch indirekte Positionen über die Anlage in Zielfonds, die ihrerseits in Fremdwährungen investieren können. Dadurch trägt der Investor in Teilen die Chancen und Risiken der Wechselkursveränderungen der verschiedenen Währungsräume relativ zum Euro.

Zinsänderungsrisiken

Aufgrund der Ausrichtung des Sondervermögens spielen Zinsänderungsrisiken nur eine untergeordnete Rolle.

Sonstige Kursrisiken

Entsprechend seinem Anlageziel ist der Fonds in unterschiedlichen Anlagesegmenten - auch in offenen Immobilienfonds - investiert. Über diese ist das Sondervermögen den Risiken der internationalen Immobilienmärkte sowie den produktspezifischen Risiken dieser Vehikel ausgesetzt. Aufgrund der weiteren Abwertungen der Wertansätze in den Immobilienfonds war das Sondervermögen im Berichtsjahr entsprechenden Wertschwankungen ausgesetzt.

Die Anlagestrategie des Fonds beinhaltet auch verbriefte Investments in physische Rohstoffe, die neben den für diese Anlageklasse typischen Marktrisiken üblicherweise einer erhöhten Volatilität unterliegen.

2. Adressenausfallrisiken

Adressenausfallrisiken resultieren aus dem möglichen Ausfall von Zins- und Tilgungsleistungen der einzelnen Anleihen und der Investments innerhalb der erworbenen Zielfonds. Insbesondere ergeben sich Adressenausfallrisiken durch die Anlage liquider Mittel bei Banken, die jedoch einem staatlich oder privatwirtschaftlich organisierten Einlagensicherungsmechanismus unterliegen.

3. Liquiditätsrisiken

Aufgrund von nachhaltig erhöhten Anteilscheinrücknahmen sank der liquide Teil des Fondsvermögens fortschreitend, so dass per 11. August 2014 die Ausgabe und Rücknahme von Anteilscheinen ausgesetzt werden musste. Da eine Erholung der Liquiditätssituation derzeit nicht zu erwarten ist, sollen im Zuge der Abwicklung und der zu erwartenden Ausschüttungen aus den offenen Immobilienfonds schrittweise Auszahlungen aus dem dann liquiden Teil des Investmentvermögens erfolgen.

Der Anteil offener Immobilienfonds, bei denen die Anteilscheinrücknahme ausgesetzt ist, betrug zum Berichtsstichtag ca. 35 %. Des Weiteren ist der Handel des Focus Global Forests Zertifikats (Anteil am Sondervermögen: gut 50 % des Fondsvermögens) eingeschränkt.

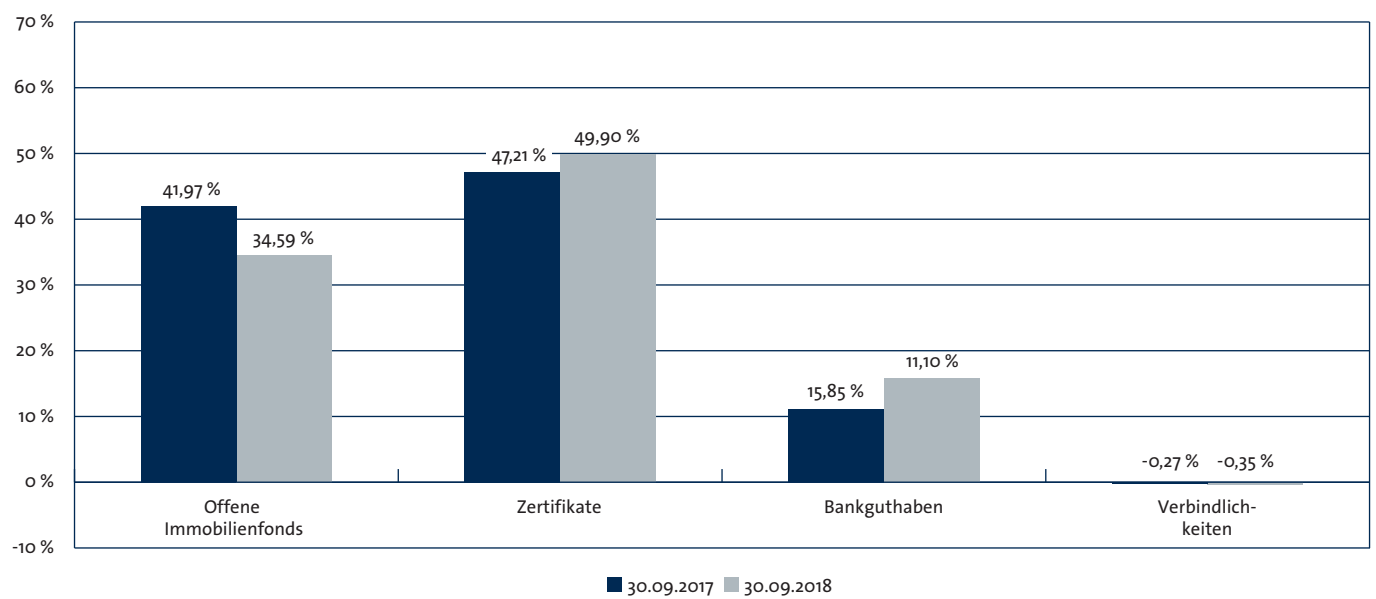
4. Operationelle Risiken

Für die Überwachung und Steuerung der operationellen Risiken des Sondervermögens sind entsprechende Maßnahmen getroffen worden.

Wesentliche Grundlagen des realisierten Ergebnisses

Die realisierten Gewinne und Verluste resultieren aus der Ausschüttung aus Investmentfondsanteilen.

Struktur des Sondervermögens



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

Übersicht über die Anlagegeschäfte

Die im Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2017 bis 30. September 2018 getätigten Anlagegeschäfte sind im Jahresbericht in der Vermögensaufstellung bzw. der Aufstellung über die während des Berichtszeitraumes abgeschlossenen Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, ausgewiesen.

Übersicht über die Wertentwicklung im Berichtszeitraum

Anteilklasse P

Anteilpreis 30.09.2017	29,06 EUR
Anteilpreis 30.09.2018	20,56 EUR
Wertentwicklung* in %	-11,93 %
Tiefstkurs 04.09.2018	20,53 EUR
Höchstkurs 04.10.2017	29,07 EUR

Wesentliche Änderungen von anlegerrelevanten Informationen

Zum 1. August 2018 wurden die aktuell entnommene Verwaltungsvergütung auf 0,49 % p. a. und die derzeitige Beratungsvergütung auf 0,38 % p. a. geändert.

Ampega Investment GmbH, Köln
Die Geschäftsführung

* Die Wertentwicklung im Berichtszeitraum ist nach der BVI-Methode berechnet worden. Diese beruht auf der international anerkannten „time weighted rate of return (TWR)“-Standard-Methode. Die Berechnungs-Methode misst die prozentuale Veränderung des angelegten Vermögens zu Beginn und zum Ende eines Betrachtungszeitraumes. Ausschüttungen werden dabei rechnerisch in neue Fondsanteile investiert und somit wie Thesaurierungen behandelt. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt dabei auf Basis der börsentäglich ermittelten Anteilwerte. Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Jahresbericht

Vermögensübersicht zum 30.09.2018

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Vermögensgegenstände		
Zertifikate	1.599.390,00	49,90
Luxemburg	1.599.390,00	49,90
Immobilien-Sondervermögen	1.108.769,86	34,59
Offene Immobilienfonds	1.108.769,86	34,59
Bankguthaben	508.172,98	15,85
Verbindlichkeiten	-11.198,50	-0,35
Fondsvermögen	3.205.134,34	100,00¹⁾

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

Vermögensaufstellung zum 30.09.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.09.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	1.599.390,00	49,90	
Zertifikate									
Focus Global Forests Zert.	XS0410448459	STK	39.000	0	0	EUR	41,0100	1.599.390,00	49,90
Anteile an Immobilien-Sondervermögen						EUR	1.108.769,86	34,59	
Gruppenfremde Immobilien-Investmentanteile									
Warburg-Deutschland Nr.1	DE0005458061	ANT	41	0	0	EUR	1.594,7800	65.385,98	2,04
UBS (D) 3 Sector Real Estate Europe	DE0009772681	ANT	230.132	0	0	EUR	0,8400	193.310,88	6,03
SEB ImmoPortfolio Target Return Fund	DE0009802314	ANT	7.000	0	0	EUR	15,2900	107.030,00	3,34
TMW Immobilien Weltfonds	DE000A0DJ328	ANT	104.500	0	0	EUR	1,6700	174.515,00	5,44
Focus Nordic Cities	DE000A0MY559	ANT	142.132	0	0	EUR	4,0000	568.528,00	17,74
Summe Wertpapiervermögen							2.708.159,86	84,49	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	508.172,98	15,85	
Bankguthaben						EUR	508.172,98	15,85	
EUR - Guthaben bei									
Verwahrstelle		EUR	324.477,72			EUR	324.477,72	10,12	
Kreissparkasse München Starnberg Ebersberg		EUR	183.537,42			EUR	183.537,42	5,73	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		USD	184,36			EUR	157,84	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten¹⁾						EUR	-11.198,50	-0,35	
Fondsvermögen						EUR	3.205.134,34	100,00²⁾	
Anteilwert						EUR	20,56		
Umlaufende Anteile						STK	155.881		
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)								84,49	
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)								0,00	

¹⁾ Noch nicht abgeführte Verwaltungsvergütung, Prüfungsgebühren, Verwahrstellenvergütung und Beratervergütung

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 27.09.2018

Vereinigte Staaten, Dollar	(USD)	1,16805	= 1 (EUR)
----------------------------	-------	---------	-----------

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

In- und ausländische Investmentanteile	per 27.09.2018, soweit die Verwaltungsgesellschaften den für diesen Tag maßgeblichen Rücknahmepreis rechtzeitig veröffentlicht haben; lag zum Bewertungsstichtag eine Veröffentlichung des Rücknahmepreises für den 27.09.2018 noch nicht vor, so wurde auf den aktuellsten veröffentlichten Kurs zurückgegriffen.
Alle anderen Vermögenswerte	per 27.09.2018

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

Verwaltungsvergütung der im NV Strategie Quattro Plus AMI enthaltenen Investmentanteile:		% p.a.
Focus Nordic Cities		0,60000
SEB ImmoPortfolio Target Return Fund		1,50000
TMW Immobilien Weltfonds		0,75000
UBS (D) 3 Sector Real Estate Europe		0,75000
Warburg-Deutschland Nr.1		1,40000

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge und keine Rücknahmeaufschläge gezahlt.

Quelle: WM Datenservice

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01.10.2017 bis 30.09.2018

	EUR
I. Erträge	
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-1.069,17
2. Erträge aus Investmentanteilen (vor Quellensteuer)	343.380,38
Summe der Erträge	342.311,21
II. Aufwendungen	
1. Verwaltungsvergütung	-18.256,94
2. Beratervergütung	-14.158,53
3. Verwahrstellenvergütung	-2.216,86
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-17.563,76
5. Depotgebühren	-359,84
Summe der Aufwendungen	-52.555,93
III. Ordentlicher Nettoertrag	289.755,28
IV. Veräußerungsgeschäfte	
1. Realisierte Gewinne	23.774,05
2. Realisierte Verluste	0,00
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	23.774,05
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	313.529,33
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-799.187,30
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	0,00
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-799.187,30
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-485.657,97

Entwicklung des Sondervermögens

für den Zeitraum vom 01.10.2017 bis 30.09.2018

	EUR	EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	4.529.434,30	
1. Steuerabschlag 31.12.2017 ¹⁾	-46.764,42	
2. Zwischenausschüttungen	-791.877,57	
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)		0,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinverkäufen	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen	0,00	
4. Ertragsausgleich / Aufwandsausgleich		0,00
5. Ergebnis des Geschäftsjahres		-485.657,97
davon nicht realisierte Gewinne	0,00	
davon nicht realisierte Verluste	-799.187,30	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	3.205.134,34	

¹⁾ Aufgrund der deutschen Investmentsteuerreform wurden die bis zum Kalenderjahresende 2017 aufgelaufenen ordentlichen Erträge zum 31.12.2017 aus steuerrechtlicher Sicht thesauriert. Die daraus resultierende, aus dem Sondervermögen abgeführte Steuerliquidität wird aus Transparenzgründen als „Zwischenausschüttung“ (ohne Ertragsausgleich) dargestellt.

Berechnung der Wiederanlage

	insgesamt EUR	je Anteil EUR
I. Für Wiederanlage verfügbar		
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	313.529,33	2,0113324
2. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁾	0,00	0,0000000
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag 31.12.2017 (inkl. Ertragsausgleich)	-46.764,42	-0,3000000
II. Wiederanlage	266.764,91	1,7113324
(auf einen Anteilumlauf von 155.881 Stück)		
III. Zur Verfügung gestellte Liquidität aus Zielfonds ¹⁾	-791.877,57	-5,0800000
a. Zwischenausschüttung 06.02.2018	-791.877,57	-5,0800000

¹⁾ Aufgrund der Aussetzung der Anteilscheinrücknahme wurden Zwischenausschüttungen durchgeführt, damit den Anlegern die vorhandene Liquidität zur Verfügung gestellt wird.

Vergleichende Übersicht

über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen	Anteilwert
	EUR	EUR
30.09.2018	3.205.134,34	20,56
30.09.2017	4.529.434,30	29,06
30.09.2016	7.409.405,76	47,53
30.09.2015	8.950.468,85	57,42

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Durch Derivate eingegangenes Exposure (Summe der Marktwerte)	EUR	0,00
Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		keine

Gesamtbetrag der im Zusammenhang mit Derivaten von Dritten gewährten Sicherheiten

davon:

Bankguthaben	EUR	0,00
Schuldverschreibungen	EUR	0,00
Aktien	EUR	0,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	84,49
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotenzial wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gemäß § 37 Absatz 4 DerivateVO

Kleinster potenzieller Risikobetrag	1,72 %
Größter potenzieller Risikobetrag	3,79 %
Durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	2,97 %

Risikomodelle, das gemäß § 10 DerivateVO verwendet wurde

Multi-Faktor-Modell mit Monte Carlo Simulation

Parameter, die gemäß § 11 DerivateVO verwendet wurden

Bis 31.05.2018:

Konfidenzniveau	99,00 %
Unterstellte Haltedauer	10 Tage
Länge der historischen Zeitreihe	180 Wochenrenditen
Exponentielle Gewichtung, Gewichtungsfaktor (entsprechend einer effektiven Historie von einem Jahr)	0,96325

Ab 01.06.2018:

Konfidenzniveau	99,00 %
Unterstellte Haltedauer	10 Tage
Länge der historischen Zeitreihe	504 Tagesrenditen
Exponentielle Gewichtung, Gewichtungsfaktor (entsprechend einer effektiven Historie von einem Jahr)	0,993

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens

gemäß § 37 Absatz 5 DerivateVO

40 % STOXX Europe 600 Real Estate + 60 % CRB Spot

Angaben zum im Geschäftsjahr erreichten Umfang des Leverage

Leverage nach der Commitment-Methode gemäß Artikel 8 der Level II VO Nr. 231/2013.		
Durchschnittlicher Umfang des Leverage		100,00 %
Maximaler Umfang des Leverage		100,00 %
Leverage nach der Brutto-Methode gemäß Artikel 7 der Level II VO Nr. 231/2013.		
Durchschnittlicher Umfang des Leverage		87,37 %
Maximaler Umfang des Leverage		93,86 %

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	20,56
Umlaufende Anteile	STK	155.881

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.

Zum Stichtag 30.09.2018 erfolgte die Bewertung für das Sondervermögen zu 15 % auf Basis von handelbaren Kursen, zu 50 % auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen und zu 35 % auf Basis von sonstigen Bewertungsverfahren. Die sonstigen Bewertungsverfahren sind Bewertungen zum letzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs für Investmentfonds, deren Anteilscheinrücknahme beschränkt ist.

Das Sondervermögen ist zum Stichtag zu insgesamt 35 % in Offene Immobilienfonds investiert, für die die Liquidation angekündigt wurde und deren Rücknahme von Anteilen ausgesetzt ist.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio [TER]) beträgt 1,84 %.

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Geschäftsjahr getragenen Kosten (ohne Transaktionskosten und ohne Performance Fee) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus, sowie die laufenden Kosten (in Form der veröffentlichten TER bzw. Verwaltungskosten) der zum Geschäftsjahresende des Sondervermögens im Bestand befindlichen Zielfonds im Verhältnis zum Nettoinventarwert des Sondervermögens am Geschäftsjahresende.

Der Anteil der erfolgsabhängigen Vergütung am durchschnittlichen Fondsvermögen beträgt 0,00 %.

Die Ampega Investment GmbH gewährt sogenannte Vermittlungsprovision an Vermittler aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Im Geschäftsjahr vom 01.10.2017 bis 30.09.2018 erhielt die Kapitalverwaltungsgesellschaft Ampega Investment GmbH für das Sondervermögen NV Strategie Quattro Plus AMI keine Rückvergütung der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die wesentlichen sonstigen Erträge und sonstigen Aufwendungen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung dargestellt.

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände) im Geschäftsjahr gesamt: 0,00 EUR.

Bei einigen Geschäftsarten (u.a. Renten- und Devisengeschäfte) sind die Transaktionskosten als Kursbestandteil nicht individuell ermittelbar und daher in obiger Angabe nicht enthalten.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen: Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR Transaktionen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)	TEUR	7.384
davon feste Vergütung	TEUR	5.839
davon variable Vergütung	TEUR	1.545
<hr/>		
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen		n.a.
Zahl der Mitarbeiter der KVG (ohne Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)		60
Höhe des gezahlten Carried Interest		n.a.
<hr/>		
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Risikoträger	TEUR	3.701
davon Geschäftsleiter	TEUR	1.633
davon andere Führungskräfte	TEUR	2.068
davon andere Risikoträger		n.a.
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	TEUR	537
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe		n.a.

Die Angaben zu den Vergütungen sind dem Jahresabschluss zum 31.12.2017 der KVG entnommen und werden aus den Entgeltabrechnungsdaten des Jahres 2017 ermittelt. Zur Grundvergütung können Mitarbeiter und Geschäftsleiter eine leistungsorientierte Vergütung erhalten. Nähere Hinweise und Erläuterungen zum Vergütungssystem der Gesellschaft sind auf der Internetseite der Gesellschaft (www.amega.de) erhältlich. Die Vergütung, die Risikoträger im Jahr von anderen Gesellschaften des Talanx Konzerns erhielten, wurde bei der Ermittlung der Vergütungen einbezogen.

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik durch die Gesellschaft hat ergeben, dass Änderungen der Vergütungspolitik nicht erforderlich sind.

Wesentliche Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik gem. § 101 KAGB fanden daher im Berichtszeitraum nicht statt.

Zusätzliche Angaben

Prozentualer Anteil der schwer liquidierbaren Vermögensgegenstände für die besondere Regelungen gelten 0,00

Angaben zu neuen Regelungen zum Liquiditätsmanagement gem. § 300 Abs.1 Nr.2 KAGB

Die Gesellschaft überwacht Liquiditätsrisiken, die sich auf Ebene des Investmentvermögens oder durch Anteilscheinrückgaben ergeben können. Für die Überwachung der Liquiditätsrisiken sind mehrstufige Limite und Schwellenwerte festgelegt und für den Fall von Limit-Überschreitungen entsprechende Maßnahmen vorgesehen. Die eingerichteten Verfahren sollen eine Konsistenz zwischen Liquiditätsquote, den Liquiditätsrisikolimiten und den zu erwartenden Nettomitveränderungen gewährleisten.

Aufgrund von nachhaltig erhöhten Anteilscheinrücknahmen sank der liquide Teil des Fondsvermögens fortschreitend, so dass per 11.08.2014 die Ausgabe und Rücknahme von Anteilscheinen ausgesetzt werden musste. Diesbezüglich verweisen wir auf unsere Ausführungen zu den Liquiditätsrisiken im Tätigkeitsbericht.

Angaben zum Risikoprofil nach § 300 Abs. 1 Nr. 3 KAGB

Das aktuelle Risikoprofil des Sondervermögens kann den Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) entnommen werden. Das Risikoprofil wird durch die Gesellschaft mit einer 7-stufigen Skala dargestellt, wobei Fonds der Risikoklasse 1 ein niedriges und Fonds der Risikoklasse 7 ein hohes Risiko aufweisen. Ein niedriges Risiko bedeutet nicht, dass das Sondervermögen als „risikolos“ eingestuft werden kann.

Die aktuelle Risikoprofileinstufung des NV Strategie Quattro Plus AMI kann jederzeit auf der Internet-Seite <https://amega.de> im Fondsprofil unter Chance-Risiko-Profil eingesehen werden.

Alle wesentlichen Risiken des Investmentvermögens werden mit Hilfe von geeigneten Modellen und Verfahren überwacht, hierzu zählen insbesondere die Value-at-Risk Methode, die Ermittlung des Leverage und der Bedeckungsquote für Liquiditätsrisiken. Des Weiteren werden regelmäßige Stresstests durchgeführt, um mögliche Wertverluste zu ermitteln, die aufgrund ungewöhnlicher Änderungen der wertbestimmenden Parameter und bei außergewöhnlichen Ereignissen auftreten können. Zur Überwachung und Steuerung der Risiken setzt die Gesellschaft für alle wesentlichen Risiken ein mehrstufiges Schwellenwert- und Limitsystem ein.

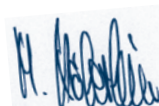
Im Berichtszeitraum hat der NV Strategie Quattro Plus AMI keine Risikolimit überschritten.

Eine detaillierte Darstellung und Würdigung der wesentlichen Risiken des Investmentvermögens im Berichtszeitraum erfolgt im Tätigkeitsbericht.

Köln, im März 2019

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Manfred Köberlein



Ralf Pohl

Besonderer Vermerk des Abschlussprüfers

An die Ampega Investment GmbH, Köln

Die Ampega Investment GmbH hat uns beauftragt, gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) den Jahresbericht des Sondervermögens **NV Strategie Quattro Plus AMI** für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2017 bis 30. September 2018 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Jahresberichts nach den Vorschriften des KAGB und der delegierten Verordnung (EU) Nr. 231/2013 liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Jahresbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Jahresbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwal-

tung des Sondervermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Jahresbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Jahresbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Jahresbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2017 bis 30. September 2018 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 11. März 2019

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Behrens
Wirtschaftsprüfer

Lüning
Wirtschaftsprüfer

Steuerliche Hinweise

Der Europäische Gerichtshof (EuGH) hat zur Direktanlage in Aktien in der Rechtssache „Manninen“ für einen finnisch-schwedischen Sachverhalt entschieden, dass die Versagung der Anrechnung ausländischer Körperschaftsteuern auf ausländische Dividenden nach finnischem Recht europarechtswidrig ist. Auch in Deutschland konnte unter Geltung des so genannten Anrechnungsverfahrens (in der Regel bis Ende des Veranlagungszeitraums 2000) nur die auf inländische Dividenden entfallende Körperschaftsteuer, nicht aber die ausländische Körperschaftsteuer auf die persönliche Steuerschuld des Anlegers angerechnet werden.

Zur Vereinbarkeit des deutschen Anrechnungsverfahrens mit europäischem Gemeinschaftsrecht hat der EuGH mit Urteil vom 06.03.2007 in der Rechtssache Meilicke (Az. C-292/04) hinsichtlich eines Sachverhalts innerhalb der Europäischen Union entschieden, dass das deutsche Körperschaftsteuer-Anrechnungsverfahren insoweit europarechtswidrig war, als die Anrechnung ausländischer Körperschaftsteuer nicht zulässig war. Danach ist es geboten, dass ein inländischer Anleger, der während der Geltung des deutschen Anrechnungsverfahrens Gewinnausschüttungen von Körperschaften mit Sitz in einem EU-Mitgliedsstaat erhalten hat, die ausländische Körperschaftsteuer nachträglich auf seine inländische Steuerschuld anrechnen lassen kann. Die verfahrensrechtliche Lage im Hinblick auf die Geltendmachung der ausländischen Steuer ist derzeit für die Fondsanlage allerdings noch unklar. Zur Wahrung möglicher Rechte in dieser Angelegenheit kann es sinnvoll sein, sich mit Ihrem Steuerberater in Verbindung zu setzen.

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 30.09.2018)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Gesellschafter

Ampega Asset Management GmbH (94,9 %)
Alstertor Erste Beteiligungs- und
Investitionssteuerungs-GmbH & Co. KG (5,1 %)

Aufsichtsrat

Harry Ploemacher, Vorsitzender
Vorsitzender der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Dr. Immo Querner, stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Norbert Eickermann
Mitglied des Vorstandes der HDI Vertriebs AG, Hannover

Prof. Dr. Alexander Kempf
Direktor des Seminars für Allgemeine BWL und
Finanzierungslehre, Köln

Dr. jur. Dr. rer. pol. Günter Scheipermeier
Rechtsanwalt, Köln

Geschäftsführung

Dr. Thomas Mann, Sprecher
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH

Jörg Burger (bis zum 31.12.2018)

Manfred Köberlein

Jürgen Meyer (ab dem 01.01.2019)

Ralf Pohl

Verwahrstelle

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Kaiserstr. 24
60311 Frankfurt am Main
Deutschland

Abschlussprüfer

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft (bis zum 31.12.2018)

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft (ab dem 01.01.2019)

Auslagerung

Compliance, Revision, Rechnungswesen und IT-Dienstleistungen sind auf Konzernunternehmen ausgelagert, d. h. die Talanx AG (Compliance und Revision), die HDI Service AG (Rechnungswesen) und die HDI Systeme AG (IT-Dienstleistungen).

Anlageberater

Bayerische Vermögen AG
Vermögensbetreuung für private Kunden
Aktiengesellschaft
Brienner Str. 53 a
80333 München
Deutschland

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Str. 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