

Halbjahresbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return Bond

1. Januar 2023 bis 30. Juni 2023

OGAW-Sondervermögen



Zusammensetzung des Fondsvermögens

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
INVESTMENTZERTIFIKATE							107.470.155,65	99,33
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO							83.333.885,20	77,02
AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH	LU1699968225	EUR	680.000	680.000	0	14,9100	10.138.800,00	9,37
AMPEGA CR.OPPS R.FDS I(A)	DE000A2QFHD8	EUR	20.200	0	0	87,6000	1.769.520,00	1,64
ASHMORE-E.M.L.C.BD IACCEO	LU1023716233	EUR	7.500	62.000	54.500	82,8000	621.000,00	0,57
AXA WLD-EURO STR.BDS ITEO	LU0227128450	EUR	16.200	0	0	169,2500	2.741.850,00	2,53
BNPP EUR.SC CONVERT. CPR	LU0265308576	EUR	4.800	19.600	14.800	158,4900	760.752,00	0,70
BNPP LOCAL EM BD IRHEOC	LU0823386916	EUR	7.100	59.000	51.900	86,8700	616.777,00	0,57
CANDR.BDS-EUR HY INH.I	LU0144746509	EUR	980	0	2.970	1.311,1000	1.284.878,00	1,19
DNCA INV.-ALPHA BDS I EO	LU1694789378	EUR	129.300	0	0	120,8300	15.623.319,00	14,44
DWS I.EO HY CORP. FC	LU0616840772	EUR	30.000	30.000	0	164,8800	4.946.400,00	4,57
EDRF-EMERGING CDT I EO	LU1080016071	EUR	36.000	36.000	0	118,7100	4.273.560,00	3,95
GAM M.B.-LOC.EM.BD BEOCAP	LU0256064774	EUR	3.750	31.000	27.250	163,7700	614.137,50	0,57
GEN.INV.-C.+E.EUR.BD BXEO	LU0145480769	EUR	61.000	61.000	0	173,1480	10.562.028,00	9,76
INVESCO-IN.INDIA BD CAEOH	LU1642785734	EUR	54.000	222.000	168.000	9,0845	490.563,00	0,45
ISHSIV-ISH.C HGDEO ACC	IE00BKT6VQ12	EUR	1.020.000	1.020.000	0	5,2751	5.380.602,00	4,97
JPM-EO.H.Y SH.DUR.B CAEO	LU1533169881	EUR	9.900	0	0	110,0180	1.089.178,20	1,01
KATHREIN S.EM L BD(I)(T)	AT0000A2HU91	EUR	37.000	37.000	0	98,9200	3.660.040,00	3,38
MSI-EUR.HIGH YIELD BD ZEO	LU0360481153	EUR	3.250	27.000	23.750	58,9100	191.457,50	0,18
N.B.I.FD.E.M.D.L.C.ACCIEO	IE00B975F507	EUR	36.000	300.000	264.000	7,4900	269.640,00	0,25
OAKT.L-GL EX-US CO.IEOA	LU0931240575	EUR	10.800	21.800	11.000	230,5700	2.490.156,00	2,30
RAIFF.OSTEUR.-RENT (I) A	AT0000A1KKA6	EUR	14.000	14.000	0	206,7000	2.893.800,00	2,67
UBS(L.)BD-F.R.I.(USD)QEOH	LU1679114121	EUR	11.600	47.000	35.400	107,9500	1.252.220,00	1,16
UNIRENTA OSTEUROPA A	LU0097169550	EUR	186.000	186.000	0	28,0900	5.224.740,00	4,83
VF-SU.EM.LO.CU.BD EOAP	LU0563308872	EUR	5.500	22.500	17.000	80,5200	442.860,00	0,41
VON.TW.FOUR M.E.A.B.S.IEO	LU1602255561	EUR	57.700	63.100	5.400	103,9100	5.995.607,00	5,54
INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR							11.194.269,18	10,35
HSBC GIF-GL.EM.MESGLDICDL	LU0992595826	USD	580.000	580.000	0	9,3730	4.992.735,45	4,61
MSI-EM.MK.FXD INC.OP.Z DL	LU1258507661	USD	79.000	79.000	0	29,0100	2.104.780,27	1,95
SISF E.M.D.A.R.C ACC	LU0106253437	USD	140.000	140.000	0	31,8625	4.096.753,46	3,79
INVESTMENTZERTIFIKATE BRITISCHE PFUND							12.942.001,27	11,96
PFI ETF-PLS SH.MA.LSI	IE00B622SG73	GBP	110.000	110.000	0	101,5300	12.942.001,27	11,96
DEVISENTERMINGESCHAEFTE							64.911,35	0,06
DTG EUR CZK 14.07.23	DTG167822	EUR	-582.137	0	582.137	23,7315	2.573,61	0,00
DTG EUR PLN 14.07.23	DTG167812	EUR	-12.241.867	0	12.241.867	4,4489	62.337,74	0,06
BANKGUTHABEN							759.731,47	0,70
EUR-Guthaben							757.470,23	0,70
EUR-Guthaben							757.470,23	0,70
GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAEHRUNGEN							2.261,24	0,00
CZK							1.097,04	0,00
PLN							1.164,20	0,00
ABGRENZUNGEN							-96.614,38	-0,09
DIVERSE GEBÜHREN							-117.298,13	-0,11
FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN							11.904,14	0,01
ZINSENANSPRÜCHE							8.779,61	0,01
Fondsvermögen						EUR	108.198.184,09	100,00¹⁾
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)						EUR	141,45	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)						EUR	181,21	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I						EUR	194,72	

Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A		EUR					194,49	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN		PLN					856,06	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H		PLN					127,52	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK		CZK					1.114,92	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre		EUR					103,39	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)		STK					36.960,800	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)		STK					280.952,200	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I		STK					1.507,070	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A		STK					61.084,261	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN		STK					30.815,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H		STK					430.051,177	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK		STK					12.397,260	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre		STK					203.281,147	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.06.2023

Britische Pfund	(GBP)	0,86295	= 1 (EUR)
Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,44325	= 1 (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	23,70000	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,08885	= 1 (EUR)

Risikohinweis

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.

b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schulscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN				
LO FDS.-SF CR.BD(FOR.)NA	LU0209983930	CHF	370.000	370.000
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE TSCHHEISCHE KRONEN				
GS CZ CROWN BD PCCZK	LU0082087437	CZK	49.500	49.500
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO				
A.C.-ASS.CR.SE.ESG I	LU0890803710	EUR	3.660	3.660
ACATIS IFK VALUE RENTEN A	DE000A0X7582	EUR	122.000	122.000
AF-AM.F.EM CO.BD IEHC	LU0755947800	EUR	0	6.000
AMF-E.M.S.T.BD I2 HGDEOA	LU1882464198	EUR	5.000	5.000
AMF-STRAT.BD I2 UH.EOA	LU1883302660	EUR	0	95.000
BGF-USD SH.DU.BD D2ACCEOH	LU1423762027	EUR	530.000	530.000
BLUEBAY-I.G.ABS.RTN B.IEO	LU0627763740	EUR	0	40.500
CS I.F.1-CS FIN.BD IBEO	LU1160526791	EUR	0	9.650
DWS I.-ASIAN BDS FCH	LU0813324794	EUR	27.000	27.000
EDRF-EUROPE CONV. I EO	LU1103208846	EUR	15.000	15.000
GS A.DB.HC ICEOHI	LU0750253519	EUR	500	500
GSF-EM.MKTS COR.BD IA EOH	LU0622306495	EUR	0	33.700
HSBC GIF-EURO HGH YLD I C	LU0165129072	EUR	0	212.000
IS DL T.BD1-3YR U.ETF EHA	IE00BDFK1573	EUR	850.000	850.000
JAMS-JP.ST.AB.RE.BD IAEHO	IE00BLP58Q81	EUR	0	369.000
JPM-E.M.C.B JPMEMCB IAEHO	LU1306423655	EUR	0	49.500
JPM-EMIGB JPMEMIGB IAEHO	LU0562247188	EUR	24.700	24.700
JPM-EO.HYB.JPMEHYB IAEO	LU0248062605	EUR	0	22.200
L.I-L.E.1-3Y I.B.G.B. D	LU1598691050	EUR	30.000	30.000
LA FRANCAISE SUB DEB C	FR0010674978	EUR	0	2.410
M+G(L)1-E.IN.L.COR. CAEO	LU1582984222	EUR	0	138.000
MUL-LYX.EO 2-10Y I.EX. A	LU1390062245	EUR	117.000	117.000
NIFLI-OST.EUR.H.INC. IAEHO	LU0556616935	EUR	0	5.200
NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	LU0772943501	EUR	33.900	33.900
PIMCO G.I.-E.M.I.B.I.AEOH	IE00B607SM09	EUR	0	390.000
ROBECO EUROP.HGH YLD IHEO	LU0226955762	EUR	0	21.100
SCHOELLERBK.REALZ.PL.(T)	AT0000672266	EUR	0	8.000
UBS(L)BD-GL.DYN(DL)QA EOH	LU1240774601	EUR	26.000	26.000
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR				
BNPP EMERGING BD CI	LU0102020947	USD	0	160.000
N.B.I.FD.E.M.D.H.C.IACCDL	IE00B99K4563	USD	0	178.000

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
DEISENTERMINGESCHAEFTE TSCHHEISCHE KRONEN				
DTG EUR CZK 10.02.23	DTG158887	CZK	13.772.000	13.772.000
DTG EUR CZK 10.02.23	DTG160721	CZK	13.772.000	13.772.000
DTG EUR CZK 10.03.23	DTG160722	CZK	13.825.000	13.825.000
DTG EUR CZK 10.03.23	DTG162516	CZK	13.825.000	13.825.000
DTG EUR CZK 12.05.23	DTG163982	CZK	13.439.000	13.439.000
DTG EUR CZK 12.05.23	DTG165744	CZK	13.439.000	13.439.000
DTG EUR CZK 13.01.23	DTG158223	CZK	0	13.711.000
DTG EUR CZK 13.01.23	DTG158886	CZK	13.711.000	13.711.000
DTG EUR CZK 14.04.23	DTG162517	CZK	13.748.000	13.748.000
DTG EUR CZK 14.04.23	DTG163981	CZK	13.748.000	13.748.000

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
DTG EUR CZK 16.06.23	DTG165745	CZK	13.637.000	13.637.000
DTG EUR CZK 16.06.23	DTG167821	CZK	13.637.000	13.637.000
DEISENTERMINGESCHAEFTE EURO				
DTG EUR CZK 10.02.23	DTG158887	EUR	571.365	571.365
DTG EUR CZK 10.02.23	DTG160721	EUR	579.605	579.605
DTG EUR CZK 10.03.23	DTG160722	EUR	580.054	580.054
DTG EUR CZK 10.03.23	DTG162516	EUR	585.012	585.012
DTG EUR CZK 12.05.23	DTG163982	EUR	574.017	574.017
DTG EUR CZK 12.05.23	DTG165744	EUR	573.336	573.336
DTG EUR CZK 13.01.23	DTG158223	EUR	563.520	0
DTG EUR CZK 13.01.23	DTG158886	EUR	570.864	570.864
DTG EUR CZK 14.04.23	DTG162517	EUR	579.639	579.639
DTG EUR CZK 14.04.23	DTG163981	EUR	588.779	588.779
DTG EUR CZK 16.06.23	DTG165745	EUR	580.002	580.002
DTG EUR CZK 16.06.23	DTG167821	EUR	573.465	573.465
DTG EUR PLN 10.02.23	DTG158883	EUR	11.862.372	11.862.372
DTG EUR PLN 10.02.23	DTG160715	EUR	11.774.568	11.774.568
DTG EUR PLN 10.03.23	DTG160716	EUR	11.988.351	11.988.351
DTG EUR PLN 10.03.23	DTG162510	EUR	12.172.559	12.172.559
DTG EUR PLN 12.05.23	DTG163990	EUR	11.712.364	11.712.364
DTG EUR PLN 12.05.23	DTG165752	EUR	12.076.801	12.076.801
DTG EUR PLN 13.01.23	DTG158217	EUR	11.852.730	0
DTG EUR PLN 13.01.23	DTG158882	EUR	11.898.912	11.898.912
DTG EUR PLN 14.04.23	DTG162511	EUR	11.994.016	11.994.016
DTG EUR PLN 14.04.23	DTG163989	EUR	12.124.460	12.124.460
DTG EUR PLN 16.06.23	DTG165753	EUR	12.155.719	12.155.719
DTG EUR PLN 16.06.23	DTG167811	EUR	12.384.167	12.384.167
DEISENTERMINGESCHAEFTE POLNISCHE ZLOTY				
DTG EUR PLN 10.02.23	DTG158883	PLN	55.835.000	55.835.000
DTG EUR PLN 10.02.23	DTG160715	PLN	55.835.000	55.835.000
DTG EUR PLN 10.03.23	DTG160716	PLN	57.054.000	57.054.000
DTG EUR PLN 10.03.23	DTG162510	PLN	57.054.000	57.054.000
DTG EUR PLN 12.05.23	DTG163990	PLN	54.691.000	54.691.000
DTG EUR PLN 12.05.23	DTG165752	PLN	54.691.000	54.691.000
DTG EUR PLN 13.01.23	DTG158217	PLN	0	55.794.000
DTG EUR PLN 13.01.23	DTG158882	PLN	55.794.000	55.794.000
DTG EUR PLN 14.04.23	DTG162511	PLN	56.443.000	56.443.000
DTG EUR PLN 14.04.23	DTG163989	PLN	56.443.000	56.443.000
DTG EUR PLN 16.06.23	DTG165753	PLN	55.221.000	55.221.000
DTG EUR PLN 16.06.23	DTG167811	PLN	55.221.000	55.221.000

Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 (SFTR)

Wertpapierleihegeschäfte iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden daher im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden daher im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds eingesetzt werden. Während der Berichtsperiode gab es keine Total Return Swaps.

Erfolgsabhängige Vergütung im Berichtszeitraum

Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 23.139,82 CZK (0,167 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 138.469,84 PLN (0,254 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die weiteren Anteilklassen wird gemäß den Fondsbestimmungen eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Während der Berichtsperiode wurden für diese Anteilklassen keine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben.

Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Verwaltungsgesellschaft

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

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729

Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.06.2023)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Geschäftsführung

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

Dr. Dirk Erdmann
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Stefan Kampmeyer
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

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

Fondsmanagement

ARTS Asset Management GmbH
Schottenfeldgasse 20
1070 Wien
Österreich

Depotbank

Raiffeisen Bank International AG
Am Stadtpark 3
1030 Wien
Österreich

Vertriebsstellen

Neben der Depotbank/Verwahrstelle können weitere Vertriebsstellen benannt werden

Abschlussprüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH
Renngasse 1/Freyung
1010 Wien
Österreich



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