

Halbjahresbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return Bond

1. Januar 2022 bis 30. Juni 2022

OGAW-Sondervermögen



Zusammensetzung des Fondsvermögens

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
INVESTMENTZERTIFIKATE							110.044.695,86	99,11
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO							103.853.842,20	93,54
AXA WLD-GL.I.S.D.BD.FCEO	LU1353951707	EUR	71.100	106.600	35.500	103,7300	7.375.203,00	6,64
CAN.BDS-GL IN.SH.DU.INH.I	LU0165522086	EUR	13.500	11.400	13.600	155,3600	2.097.360,00	1,89
DNB-HIGH YIELD INSTAEOA	LU1303786096	EUR	32.000	30.000	29.500	110,6868	3.541.977,60	3,19
DNCA INV.-ALPHA BDS I EO	LU1694789378	EUR	176.800	176.800	0	111,1600	19.653.088,00	17,70
GEN.IN.-EO S.TERM BD BXEO	LU0145484910	EUR	20.000	20.000	0	136,2930	2.725.860,00	2,46
ISHSII-EO FR BD ESG EOD	IE00BF5GB717	EUR	1.980.000	1.980.000	0	4,9800	9.860.400,00	8,88
ISHSIV-ISH.C HGDEO ACC	IE00BKT6VQ12	EUR	3.100.000	3.100.000	0	5,0847	15.762.570,00	14,20
JAMS-JP.ST.AB.RE.BD IAEHO	IE00BLP58Q81	EUR	134.000	134.000	0	10,9155	1.462.677,00	1,32
M+G(L)1-E.IN.L.COR. CAEO	LU1582984222	EUR	138.000	0	0	12,3187	1.699.980,60	1,53
MAN F.-M.GLG GEMLCR. ICE	IE00BYQP7387	EUR	12.900	26.000	13.100	112,5900	1.452.411,00	1,31
MUL-LYX.EO 2-10Y I.EX. A	LU1390062245	EUR	193.000	193.000	0	108,8400	21.006.120,00	18,92
NORDIX BASIS AK I	DE000A2AJHF9	EUR	30.500	30.500	0	96,7900	2.952.095,00	2,66
PI.GIS-GL.L.D.R.R.INSTEOH	IE00BHZKQB61	EUR	551.000	551.000	0	10,4700	5.768.970,00	5,20
T.ROW.PR.-DY.GL.BD QHEO	LU1439084705	EUR	560.000	560.000	0	10,3800	5.812.800,00	5,24
VON.TW.FOUR M.E.A.B.S.IEO	LU1602255561	EUR	26.500	53.500	27.000	101,2200	2.682.330,00	2,42
INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR							6.190.853,66	5,58
AIS-AM.FL.R.DL.CO.E.UE.DR	LU1681040900	USD	54.000	54.000	0	110,6080	5.700.083,03	5,13
PGIF-F.U.EM F.I.I DL ACC	IE00BD2ZKP80	USD	47.500	365.000	317.500	10,8264	490.770,63	0,44
DEVISENTERMINGESCHAEFTE							-144.723,47	-0,13
DTG EUR CZK 01.07.22	DTG148350	EUR	-585.032	0	585.032	24,7475	1.855,54	0,00
DTG EUR PLN 01.07.22	DTG148344	EUR	-12.189.207	0	12.189.207	4,6701	-146.579,01	-0,13
BANKGUTHABEN							1.047.798,46	0,94
EUR-Guthaben							1.046.714,05	0,94
EUR-Guthaben							1.046.714,05	0,94
GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAEHRUNGEN							1.084,41	0,00
CZK							1.050,82	0,00
PLN							33,59	0,00
ABGRENZUNGEN							80.575,03	0,07
DIVERSE GEBÜHREN							-118.909,62	-0,11
ZINSENANSPRÜCHE							-515,35	-0,00
Diverse							200.000,00	0,18
CC CASH_COLL_GEGEBEN		EUR	200.000			1,0000	200.000,00	0,18
Fondsvermögen						EUR	111.028.345,88	100,00¹⁾
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)						EUR	143,27	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)						EUR	183,53	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I						EUR	197,25	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A						EUR	196,98	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN						PLN	911,11	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H						PLN	122,31	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK						CZK	1.079,45	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre						EUR	104,41	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)						STK	34.289,030	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)						STK	291.829,605	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I						STK	1.207,070	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A						STK	61.195,144	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN						STK	31.765,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H						STK	457.251,177	

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK					STK		13.508,874	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre					STK		205.861,147	

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

Devisenkurse (in Mengennote) per 29.06.2022

Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,66925	= 1 (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	24,74250	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,04785	= 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 Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN				
CSIF14-CSL C.S.D.SF B.IB	LU0155952566	CHF	0	4.850
CSIF14-CSL I.LI.CHF B.IB	LU0175164002	CHF	0	2.800
FISCH BD GBL CHF BC	LU0102602561	CHF	0	670
LO FDS.-SF CR.BD(FOR.)NA	LU0209983930	CHF	0	156.000
UBSLBF-GBL FLEX. QA SF	LU0415184216	CHF	0	24.600
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO				
BNPP EO HY S.DUR BD IHEOC	LU1022395633	EUR	38.500	38.500
BNPP EUR.SC CONVERT. CPR	LU0265308576	EUR	0	7.400
BNPP EURO HY BD IC	LU0823381016	EUR	18.800	18.800
DNCA INV.-CONVERTIBL.I EO	LU0401808935	EUR	0	4.400
DPAM L-BDS.EM SUST.FCEO	LU0907928062	EUR	29.500	29.500

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
DWS I.EO HY CORP. FC	LU0616840772	EUR	23.900	23.900
EDRF-EURO HIGH YLD I EO	LU1160362742	EUR	181	181
FID.FDS-GL.IN.L.BD YACEOH	LU0353649436	EUR	385.000	385.000
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	EUR	28.000	28.000
ISHSII-DLT.BD7-10YR DLDIS	IE00B1FZS798	EUR	0	89.000
ISHSIV - ISH.CHIN.BD.U.ET	IE00BYPC1H27	EUR	0	2.420.000
JPM-EO.H.Y SH.DUR.B CAEO	LU1533169881	EUR	28.000	28.000
NORDEA 1-EUR.H.YLD BI-EUR	LU0141799097	EUR	122.000	122.000
NORDEA 1-N.A.H.Y.BD BI EO	LU0826397993	EUR	0	8.900
PFIE.-E ST HY CB IU EOA	IE00BD8D5G25	EUR	1.210.000	1.210.000
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE Schwedische Krone				
NORDEA 1-SW.S.-T.BD BP-SK	LU0064321663	SEK	0	9.300
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR				
AF-AM.F.GL.CO.BD IDLC	LU0319688445	USD	0	1.390
ASHMORE-EM.M.S.I.G.D.DL I	LU0493855521	USD	0	25.000
ASSCVI-INDIAN BD IADL	LU1254412973	USD	0	222.000
BGF-USD H.YLD BD D ACC.DL	LU0552552704	USD	0	132.000
G.SACHS FDS-US FX.I DL AC	LU0234572963	USD	0	315.000
G.SACHS-GL.HGH YL.I DL AC	LU0234573854	USD	0	31.000
GS ETF-GS A.CHI.G.BD DLDI	IE00BJSBC590	USD	0	395.000
INVECO-IN.INDIA BD CA.DL	LU0996662341	USD	0	191.000
JPM INV-GL.H.Y.BD I ACCDL	LU0468140883	USD	0	3.700
JPM-FLEX.CRD.JPMFC CADL	LU0469576440	USD	0	41.000
MOR.ST.IF-G.A.B.S. ZCAPDL	LU0858068314	USD	0	76.000
MSI-GL.HIGH YLD BD Z	LU0702163451	USD	0	118.000
T. ROWE P.-GL.H.Y.BD QADL	LU0860350221	USD	0	187.000

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 TSCHECHISCHE KRONEN				
DTG EUR CZK 03.06.22	DTG146095	CZK	14.488.000	14.488.000
DTG EUR CZK 03.06.22	DTG148349	CZK	14.488.000	14.488.000
DTG EUR CZK 06.05.22	DTG144492	CZK	14.431.000	14.431.000
DTG EUR CZK 06.05.22	DTG146094	CZK	14.431.000	14.431.000
DTG EUR CZK 08.04.22	DTG143338	CZK	14.352.000	14.352.000
DTG EUR CZK 08.04.22	DTG144491	CZK	14.352.000	14.352.000
DTG EUR CZK 11.02.22	DTG141399	CZK	14.222.000	14.222.000
DTG EUR CZK 11.02.22	DTG142221	CZK	14.222.000	14.222.000
DTG EUR CZK 11.03.22	DTG142222	CZK	14.045.000	14.045.000
DTG EUR CZK 11.03.22	DTG143337	CZK	14.045.000	14.045.000
DTG EUR CZK 14.01.22	DTG139963	CZK	0	14.207.000
DTG EUR CZK 14.01.22	DTG141398	CZK	14.207.000	14.207.000
DEISENTERMINGESCHAEFTE EURO				
DTG EUR CZK 03.06.22	DTG146095	EUR	586.008	586.008
DTG EUR CZK 03.06.22	DTG148349	EUR	585.942	585.942
DTG EUR CZK 06.05.22	DTG144492	EUR	587.687	587.687
DTG EUR CZK 06.05.22	DTG146094	EUR	586.054	586.054
DTG EUR CZK 08.04.22	DTG143338	EUR	566.277	566.277
DTG EUR CZK 08.04.22	DTG144491	EUR	586.658	586.658
DTG EUR CZK 11.02.22	DTG141399	EUR	583.752	583.752

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 11.02.22	DTG142221	EUR	584.066	584.066
DTG EUR CZK 11.03.22	DTG142222	EUR	574.866	574.866
DTG EUR CZK 11.03.22	DTG143337	EUR	556.061	556.061
DTG EUR CZK 14.01.22	DTG139963	EUR	556.829	0
DTG EUR CZK 14.01.22	DTG141398	EUR	584.891	584.891
DTG EUR PLN 03.06.22	DTG146099	EUR	12.012.120	12.012.120
DTG EUR PLN 03.06.22	DTG148343	EUR	12.253.592	12.253.592
DTG EUR PLN 06.05.22	DTG144488	EUR	12.003.112	12.003.112
DTG EUR PLN 06.05.22	DTG146098	EUR	12.007.331	12.007.331
DTG EUR PLN 08.04.22	DTG143332	EUR	11.655.113	11.655.113
DTG EUR PLN 08.04.22	DTG144487	EUR	12.027.315	12.027.315
DTG EUR PLN 11.02.22	DTG141391	EUR	12.301.997	12.301.997
DTG EUR PLN 11.02.22	DTG142215	EUR	12.415.940	12.415.940
DTG EUR PLN 11.03.22	DTG142216	EUR	12.172.207	12.172.207
DTG EUR PLN 11.03.22	DTG143331	EUR	11.462.961	11.462.961
DTG EUR PLN 14.01.22	DTG139957	EUR	11.924.134	0
DTG EUR PLN 14.01.22	DTG141390	EUR	12.338.204	12.338.204
DEWISENTERMINGESCHAEFTE POLNISCHE ZLOTY				
DTG EUR PLN 03.06.22	DTG146099	PLN	56.293.000	56.293.000
DTG EUR PLN 03.06.22	DTG148343	PLN	56.293.000	56.293.000
DTG EUR PLN 06.05.22	DTG144488	PLN	56.013.000	56.013.000
DTG EUR PLN 06.05.22	DTG146098	PLN	56.013.000	56.013.000
DTG EUR PLN 08.04.22	DTG143332	PLN	55.921.000	55.921.000
DTG EUR PLN 08.04.22	DTG144487	PLN	55.921.000	55.921.000
DTG EUR PLN 11.02.22	DTG141391	PLN	55.832.000	55.832.000
DTG EUR PLN 11.02.22	DTG142215	PLN	55.832.000	55.832.000
DTG EUR PLN 11.03.22	DTG142216	PLN	54.856.000	54.856.000
DTG EUR PLN 11.03.22	DTG143331	PLN	54.856.000	54.856.000
DTG EUR PLN 14.01.22	DTG139957	PLN	0	55.897.000
DTG EUR PLN 14.01.22	DTG141390	PLN	55.897.000	55.897.000

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 4.354,76 CZK (0,029 % 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 30.06.2022)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Geschäftsführung

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

Dr. Dirk Erdmann
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

Harry Ploemacher, Vorsitzender (bis zum 01.03.2022)
Vorsitzender der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Clemens Jungsthöfel, stellv. Vorsitzender (ab dem 02.03.2022)
Mitglied des Vorstands der Hannover Rück SE, Hannover

Norbert Eickermann (bis zum 01.03.2022)
Mitglied des Vorstandes der HDI Vertriebs AG, Hannover

Jens Hagemann
Dipl.-Kaufmann, München

Dr. Christian Hermelingmeier (ab dem 02.03.2022)
Mitglied des Vorstands der HDI Global SE, Hannover

Prof. Dr. Alexander Kempf (bis zum 01.03.2022)
Direktor des Seminars für Allgemeine BWL und
Finanzierungslehre, Köln

Sven Lixenfeld (ab dem 02.03.2022)
Mitglied des Vorstands der HDI Deutschland AG, Düsseldorf

Dr. jur. Dr. rer. pol. Günter Scheipermeier (bis zum
01.03.2022)
Rechtsanwalt, Köln

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