

Halbjahresbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return Value Invest Protect

1. Dezember 2022 bis 31. Mai 2023

OGAW-Sondervermögen



Zusammensetzung des Fondsvermögens

Vermögensaufstellung zum 31.05.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 31.05.2023	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
INVESTMENTZERTIFIKATE							80.123.526,76	98,82
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO							73.366.940,60	90,48
AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH	LU1699968225	EUR	314.000	343.000	29.000	14,7300	4.625.220,00	5,70
AMUNDI EO L.RAT.SRI ICAP3	FR0007038138	EUR	7	6	3		7.371.294,00	9,09
AMUNDI ETF STOXX EURO.50	FR0010790980	EUR	23.800	0	0	102,5800	2.441.404,00	3,01
BNPP LOCAL EM BD IRHEOC	LU0823386916	EUR	17.200	34.500	17.300	84,1200	1.446.864,00	1,78
DEKAFONDS CF	DE0008474503	EUR	6.000	6.000	0	118,2100	709.260,00	0,87
DNCA INV.-ALPHA BDS I EO	LU1694789378	EUR	27.000	0	27.500	120,4100	3.251.070,00	4,01
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	EUR	12.300	12.300	0	161,6300	1.988.049,00	2,45
GEN.INV.-C.+E.EUR.BD BXEO	LU0145480769	EUR	43.300	43.300	0	170,0910	7.364.940,30	9,08
GUTMANN EA.EU.BD.(EUR)(A)	AT0000A0PET0	EUR	13.000	13.000	0	105,5100	1.371.630,00	1,69
ISHSIV-ISH.C HGDEO ACC	IE00BKT6VQ12	EUR	315.000	315.000	0	5,2429	1.651.513,50	2,04
JPM-EQ.H.Y SH.DUR.B CAEO	LU1533169881	EUR	8.000	8.000	0	109,6980	877.584,00	1,08
JPM.FDS-US HED.EQ.CACCEOH	LU1297691492	EUR	11.200	11.200	0	140,9500	1.578.640,00	1,95
LA FRANCAISE-TRESORERIE I	FR0010609115	EUR	75	75	0	108.187,0000	8.114.025,00	10,01
LOYS - LOYS GLOBAL S	LU0277768098	EUR	900	900	0	1.082,5800	974.322,00	1,20
LYXOR IF-LYX.SM.O.R.UCECO	LU1190417599	EUR	118.500	0	32.000	99,1000	11.743.350,00	14,48
MSI-EUR.HIGH YIELD BD ZEO	LU0360481153	EUR	4.600	37.500	32.900	58,5100	269.146,00	0,33
OAKT.L-GL EX-US CO.IEOA	LU0931240575	EUR	21.800	21.800	0	227,1300	4.951.434,00	6,11
ODDO BHF VAL.RENDEM. CIEO	FR0010258731	EUR	8	8	0	188.154,1000	1.505.232,80	1,86
SPDR MSCI EUR.UTIL.ETF	IE00BKWQ0P07	EUR	4.000	4.000	0	158,8200	635.280,00	0,78
UBS FDSO-CMCI CO.CR.SFHCO	IE00BMC5DV85	EUR	23.700	0	0	117,6600	2.788.542,00	3,44
UNIRENTA OSTEUROPA A	LU0097169550	EUR	267.000	267.000	0	27,1700	7.254.390,00	8,95
XTR.MSCI EUR.COMM.SERV.1C	LU0292104030	EUR	6.600	6.600	0	68,7500	453.750,00	0,56
INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR							592.952,69	0,73
HSBC GIF-GL.EM.MESGLDICDL	LU0992595826	USD	70.000	70.000	0	9,0870	592.952,69	0,73
INVESTMENTZERTIFIKATE Britische Pfund							1.479.990,28	1,83
SISF UK EQUITY C ACC	LU0106246225	GBP	214.000	214.000	0	5,9784	1.479.990,28	1,83
INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN							4.683.643,19	5,78
LO FDS.-SF CR.BD.(FOR.)NA	LU0209983930	CHF	184.000	370.000	186.000	13,0916	2.484.123,34	3,06
SISF SWISS EQUITY C ACC	LU0106244444	CHF	31.000	31.000	0	68,8024	2.199.519,85	2,71
BANKGUTHABEN							1.053.445,92	1,30
EUR-Guthaben							1.053.445,92	1,30
EUR-Guthaben							1.053.445,92	1,30
ABGRENZUNGEN							-94.008,99	-0,12
DIVERSE GEBÜHREN							-119.054,41	-0,15
FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN							3.200,14	0,00
ZINSENANSPRÜCHE							21.845,28	0,03
Fondsvermögen						EUR	81.082.963,69	100,00¹⁾
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot. (VTH) IA						EUR	126,23	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot.(VTH) IA H						EUR	98,16	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot. (VTH) IA						STK	642.246,827	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot.(VTH) IA H						STK	60,000	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 30.05.2023

Britische Pfund	(GBP)	0,86445	= 1 (EUR)
Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,96970	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,07275	= 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 EURO				
A.C.-ASS.CR.SE.ESG I	LU0890803710	EUR	5.900	5.900
AB SIC.I-INT.H.CARE IEOC	LU0251855366	EUR	0	1.650
AIS-ITALY MIB ESG DREOA	LU1681037518	EUR	35.500	35.500
AM-SP GL.IN.ESG EOA	IE000LTA2082	EUR	0	228.000
AMF-E.M.S.T.BD I2 HGDEOA	LU1882464198	EUR	1.960	1.960
AMF-STRAT.BD I2 UH.EOA	LU1883302660	EUR	0	31.500
ASL(L)-EURO FUND A2	LU0090865873	EUR	9.200	9.200
CS I.F.1-CS FIN.BD IBEO	LU1160526791	EUR	4.000	4.000
DNCA INV.-VALUE EUROPE I	LU0284395984	EUR	4.150	4.150
DWS I.-ASIAN BDS FCH	LU0813324794	EUR	37.500	37.500
FID.FDS-GL.HYBR.BDS YAEHO	LU1261433111	EUR	325.000	325.000
GEN.INV.-EO BD 1-3YR.BXEO	LU0396183112	EUR	0	3.400
GS A.DB.HC ICEOHI	LU0750253519	EUR	710	710
IS.S.E.600 MEDIA U.ETF A.	DE000A0H08L5	EUR	46.500	46.500
ISHSVII-MSCI E.DL H.ACC	IE00BWZN1T31	EUR	0	325.000
JAMS-JP.ST.AB.RE.BD IAEHO	IE00BLP58Q81	EUR	0	654.000
JAMS-MERIAN G.DY.BD AEOHA	IE00B553LK51	EUR	0	244.000
JPM-E.M.C.B JPMEMCB IAEHO	LU1306423655	EUR	51.000	51.000
JPM-EO.HYB.JPMEHYB IAEHO	LU0248062605	EUR	0	42.500

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
LIF-600 INSURA. EOA	LU1834987973	EUR	48.400	48.400
LIF-600 MEDIA EOA	LU1834988195	EUR	19.600	19.600
LYX I.-L.MSCIEMU VA. D	LU1598690169	EUR	21.600	21.600
LYXOR IBEX35 (DR) U.ETF D	FR0010251744	EUR	27.500	27.500
M+G(L)1-E.IN.L.COR. CAEO	LU1582984222	EUR	0	197.000
MUL-LYX.EO 2-10Y I.EX. A	LU1390062245	EUR	7.100	7.100
NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	LU0772943501	EUR	30.100	30.100
PICT.-SHORT-TERM MM EUR I	LU0128494944	EUR	0	63.700
ROBECO EUROP.HGH YLD IHEO	LU0226955762	EUR	0	21.100
T.ROW.PR.-DY.GL.BD QHEO	LU1439084705	EUR	0	37.500
VANECK MSTR.DM DIV.UC.ETF	NL0011683594	EUR	25.500	25.500
XTR.II EUR OV.RATE SW. 1C	LU0290358497	EUR	0	54.000
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR				
BNPP EMERGING BD CI	LU0102020947	USD	116.000	116.000
IS MSCI JAP.USD H.U.ETF A	IE00BCLWRG39	USD	0	33.000
ISHS V-M.WHCS ESG ETF DLD	IE00BJ5JNZ06	USD	0	132.000

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 alle Anteilklassen wird gemäß der 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 31.05.2023)
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 (ab dem 01.01.2023)
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