

Halbjahresbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive

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 | | | | | | | 1.914.828,73 | 104,63 |
| INVESTMENTZERTIFIKATE EURO | | | | | | | 1.806.193,93 | 98,69 |
| AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH | LU1699968225 | EUR | 11.000 | 18.500 | 7.500 | 14,9100 | 164.010,00 | 8,96 |
| AMUNDI GERMAN EQUITY H DA | DE000A0RL2F6 | EUR | 262 | 453 | 191 | 205,3300 | 53.796,46 | 2,94 |
| BL-EQUITIES JAPAN BEURH | LU0887931292 | EUR | 195 | 195 | 0 | 275,3000 | 53.683,50 | 2,93 |
| BLUEBAY-H.Y.ESG BD I-EO | LU0242579596 | EUR | 708 | 1.020 | 312 | 231,1700 | 163.668,36 | 8,94 |
| COMGEST MONDE I | FR0011007251 | EUR | 7 | 7 | 0 | 3.062,1500 | 21.435,05 | 1,17 |
| DNCA INV.-ALPHA BDS I EO | LU1694789378 | EUR | 1.360 | 2.250 | 2.050 | 120,8300 | 164.328,80 | 8,98 |
| GEN.INV.-C.+E.EUR.BD BXEO | LU0145480769 | EUR | 950 | 1.560 | 610 | 173,1480 | 164.490,60 | 8,99 |
| GUTMANN EA.EU.BD.(EUR)(A) | AT0000A0PET0 | EUR | 1.540 | 2.140 | 600 | 107,3900 | 165.380,60 | 9,04 |
| J O H.C.M.U.FD-CO.EU.A EO | IE0033009238 | EUR | 11.800 | 17.000 | 5.200 | 4,6610 | 54.999,80 | 3,01 |
| JPM.FDS-US HED.EQ.CACCEOH | LU1297691492 | EUR | 380 | 630 | 250 | 144,5600 | 54.932,80 | 3,00 |
| KATHREIN S.EM L BD(I)(T) | AT0000A2HU91 | EUR | 810 | 2.390 | 1.580 | 98,9200 | 80.125,20 | 4,38 |
| KEPPLER LINGOHR GL.EQU.MC | DE000A0JDCH4 | EUR | 722 | 1.180 | 458 | 74,5100 | 53.796,22 | 2,94 |
| M+G1-PAEUSUPAAL EOAC | LU1670717674 | EUR | 1.670 | 2.750 | 1.080 | 32,8145 | 54.800,22 | 2,99 |
| RAIFF.OSTEUR.-RENT (I) A | AT0000A1KKA6 | EUR | 800 | 1.310 | 510 | 206,7000 | 165.360,00 | 9,04 |
| SISF E.M.D.A.R.C ACC E HD | LU0177222394 | EUR | 5.700 | 14.300 | 8.600 | 27,7880 | 158.391,60 | 8,65 |
| SISF EURO HIGH YIELD CAEO | LU0849400030 | EUR | 432 | 432 | 0 | 152,4519 | 65.859,22 | 3,60 |
| UNIRENTA OSTEUROPA A | LU0097169550 | EUR | 5.950 | 9.800 | 3.850 | 28,0900 | 167.135,50 | 9,13 |
| INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR | | | | | | | 108.634,80 | 5,94 |
| COMGEST GROWTH GLB.DLAC | IE0033535075 | USD | 1.500 | 2.040 | 540 | 39,6900 | 54.676,95 | 2,99 |
| MSI-INTL EQU.(E.US) Z | LU1121079674 | USD | 1.700 | 2.750 | 1.050 | 34,5600 | 53.957,85 | 2,95 |
| BANKGUTHABEN | | | | | | | -82.980,23 | -4,53 |
| EUR-Verbindlichkeiten | | | | | | | -82.980,23 | -4,53 |
| EUR-Verbindlichkeiten | | | | | | | -82.980,23 | -4,53 |
| ABGRENZUNGEN | | | | | | | -1.769,58 | -0,10 |
| DIVERSE GEBÜHREN | | | | | | | -3.201,45 | -0,17 |
| FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN | | | | | | | 701,07 | 0,04 |
| ZINSENANSPRÜCHE | | | | | | | 730,80 | 0,04 |
| Fondsvermögen | | | | | | EUR | 1.830.078,92 | 100,00¹⁾ |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (AUS) | | | | | | EUR | 110,53 | |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (TTH) | | | | | | EUR | 111,34 | |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (VTH) IT IA | | | | | | EUR | 114,04 | |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (TTH) IT retrofrei | | | | | | EUR | 99,68 | |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (AUS) | | | | | | STK | 10,000 | |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (TTH) | | | | | | STK | 893,438 | |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (VTH) IT IA | | | | | | STK | 15.113,026 | |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive (TTH) IT retrofrei | | | | | | STK | 59,000 | |

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

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.06.2023

| | | | |
|-----------|-------|---------|-----------|
| Euro | (EUR) | 1,00000 | = 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 Schuldscheindarlehen (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 | 19.600 | 19.600 |
| SISF-SW.S+MID CAP EQ.CACC | LU0149524208 | CHF | 1.420 | 1.420 |
| IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE TSCHECHISCHE KRONEN | | | | |
| GS CZ CROWN BD PCCZK | LU0082087437 | CZK | 2.550 | 2.550 |
| IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO | | | | |
| A.C.-ASS.CR.SE.ESG I | LU0890803710 | EUR | 322 | 322 |
| AB SIC.I-INT.H.CARE IEOC | LU0251855366 | EUR | 0 | 36 |
| ACATIS IFK VALUE RENTEN A | DE000A0X7582 | EUR | 6.700 | 6.700 |
| AF-AM.FEM CO.BD IEOHC | LU0755947800 | EUR | 0 | 281 |
| AMF-STRAT.BD I2 UH.EOA | LU1883302660 | EUR | 0 | 2.300 |
| AMU AUSTRIA STOCK (T) | AT0000767736 | EUR | 830 | 830 |
| BC GIF-EUROPE VALUE I C | LU0164907411 | EUR | 750 | 750 |
| BGF-E.MKT.CORP.BD D2C EOH | LU1728038495 | EUR | 0 | 19.200 |
| BLACK.ST.-FIX.INC.STR.DEO | LU0438336421 | EUR | 0 | 920 |
| BNPP JAP.SM.CAP P.CHE | LU0925122235 | EUR | 0 | 405 |
| CS I.F.1-CS FIN.BD IBEO | LU1160526791 | EUR | 0 | 259 |
| DNCA INV.-VALUE EUROPE I | LU0284395984 | EUR | 426 | 426 |
| DWSI-CROCI GBL DIV. ICEOA | LU1769943553 | EUR | 0 | 251 |
| FID.FDS-GL INDUSTR.YACCIO | LU0346389181 | EUR | 0 | 2.950 |
| FID.FDS-GL.HYBR.BDS YAEOH | LU1261433111 | EUR | 10.000 | 10.000 |
| FID.FDS-ITALY FD Y AC.EUR | LU0318940342 | EUR | 6.500 | 6.500 |
| GAMAX FDS -MAXI BD NAM.A | LU0051667300 | EUR | 45.000 | 45.000 |
| GEN.INV.-EO BD 1-3YR.BXEO | LU0396183112 | EUR | 0 | 220 |
| JAMS-MERIAN G.DY.BD AEOHA | IE00B553LK51 | EUR | 0 | 10.100 |
| JPM-E.M.C.B JPMEMCB IAEOH | LU1306423655 | EUR | 0 | 2.800 |
| JSS I.-SU.EQ.GL DIVI.CEOA | LU0950588763 | EUR | 0 | 650 |

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 |
|---------------------------|--------------|---------|--------------------|-----------------------|
| LO-ASIA VALUE BOND EOPSHC | LU1480986204 | EUR | 1.250 | 1.250 |
| LOYS - LOYS GLOBAL S | LU0277768098 | EUR | 55 | 55 |
| NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO | LU0772943501 | EUR | 1.480 | 1.480 |
| NORDEA 1-FLEX.FI BI-EO | LU0915363070 | EUR | 2.400 | 2.400 |
| PICT.-SHORT-TERM MM EUR I | LU0128494944 | EUR | 0 | 1.750 |
| PIMCO G.I.-E.M.I.B.I.AEOH | IE00B6075M09 | EUR | 0 | 20.800 |
| ROBECO BP GL PREM.EQ.I EO | LU0233138477 | EUR | 0 | 386 |
| ROBECO EUROP.HGH YLD IHCO | LU0226955762 | EUR | 0 | 1.130 |
| THREADN(L)-UK EQ.AEH C EO | LU0713323730 | EUR | 2.160 | 2.160 |
| UBS(L.)BD-F.R.I.(USD)QEOH | LU1679114121 | EUR | 2.180 | 2.180 |
| UNIDIVIDENDENASS INH.A | LU0186860408 | EUR | 0 | 740 |

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

Darüber hinaus wird gemäß den Fondsbestimmungen eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Während der Berichtsperiode wurde 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