

# Halbjahresbericht

## C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced

1. Januar 2021 bis 30. Juni 2021

OGAW-Sondervermögen





# Zusammensetzung des Fondsvermögens

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
						im Berichtszeitraum		
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>							<b>248.039.372,40</b>	<b>99,57</b>
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>							<b>196.633.305,91</b>	<b>78,93</b>
AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH	LU1699968225	EUR	314.000	450.000	315.000	14,8600	4.666.040,00	1,87
ABSALON-GLBL HIGH YL.I EO	LU1138630212	EUR	424	458	34	13.731,7600	5.822.266,24	2,34
AF-PI.GL.H.Y.BD I2 UH.EOA	LU1883837004	EUR	269	1.100	831	2.264,7500	609.217,75	0,24
AMU GL. HIGH Y.BD L.D.(T)	AT0000A13YU6	EUR	47.500	47.500	0	106,2100	5.044.975,00	2,03
ASSCVI-SLT EU.HYB I AEO	LU0231473439	EUR	228.000	134.000	0	19,0054	4.333.231,20	1,74
AXA WLD-FR.EU.MICR.FTEOPF	LU0212993595	EUR	22.350	0	0	431,5800	9.645.813,00	3,87
BGF-GL HGH YLD BD D2EOH	LU0368267034	EUR	128.000	0	132.000	20,0000	2.560.000,00	1,03
BLUEBAY FDS-H.YLD BD I-EO	LU0242579596	EUR	12.000	12.000	0	247,2500	2.967.000,00	1,19
BNPP EURO HY BD IC	LU0823381016	EUR	44.200	24.300	0	262,5500	11.604.710,00	4,66
CANDR.BDS-GL.H.YLD INH.I	LU0170293806	EUR	9.900	0	0	258,2100	2.556.279,00	1,03
CS I.F.1-CS FIN.BD QBE	LU1160527849	EUR	2.430	2.430	0	1.438,7700	3.496.211,10	1,40
CSIF13-CSL AS.COR.B.IBHEO	LU0828909043	EUR	21.500	21.500	0	124,4500	2.675.675,00	1,07
DAN.IN.SICAV-EUR.SM.CAP I	LU0249699918	EUR	243.000	0	0	39,0600	9.491.580,00	3,81
DNB-HIGH YIELD INSTAEOA	LU1303786096	EUR	50.400	33.000	0	112,2427	5.657.032,08	2,27
FID.FDS-EU.SM.C. YACC.EUR	LU0346388456	EUR	38.500	38.500	0	36,4800	1.404.480,00	0,56
FID.FDS-FRANCE Y ACC. EUR	LU0318940185	EUR	208.000	208.000	0	14,4000	2.995.200,00	1,20
GAM STAR-CR.OPPS(EO)OA EO	IE00B5675W70	EUR	218.000	218.000	0	19,3436	4.216.904,80	1,69
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	EUR	15.832	15.832	0	173,4900	2.746.674,60	1,10
JPM INV-GL.HI.YI.I A.EO H	LU0248018375	EUR	51.000	51.000	0	99,2700	5.062.770,00	2,03
JPM-EQ.H.Y SH.DUR.B CAEO	LU1533169881	EUR	39.500	39.500	0	108,1710	4.272.754,50	1,72
JPM.F.-US H.Y.PB.CACCEOH	LU1555081675	EUR	31.500	31.500	0	118,3000	3.726.450,00	1,50
L+G-L+G ECOMM.LOGISTICS	IE00BF0M6N54	EUR	1.332.000	0	168.000	15,0760	20.081.232,00	8,06
LOYS-LOYS AKTIEN EUROPA I	LU1129459035	EUR	2.660	2.660	0	1.052,5400	2.799.756,40	1,12
LUPUS ALPHA DIVID.CHAMP.C	DE000A1JDV61	EUR	18.500	18.500	0	299,9000	5.548.150,00	2,23
M+G LI1-GLFRHYF C-HEOA	LU1670722674	EUR	480.000	480.000	0	10,5353	5.056.944,00	2,03
MAGNA UMB.FD-M.N.FR.GA EO	IE00BFTW8Z27	EUR	96.500	96.500	0	18,8140	1.815.551,00	0,73
MAINF.-EM.MKT.CR.OPC2 EO	LU1061984891	EUR	62.300	90.300	28.000	124,3100	7.744.513,00	3,11
MANDARINE EU.MICROCAP GEO	LU1303941246	EUR	18.500	0	0	208,9500	3.865.575,00	1,55
NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	LU0772943501	EUR	15.600	18.400	15.800	198,0300	3.089.268,00	1,24
NORDIX RENTEN PLUS R	DE000A0YAEJ1	EUR	29.000	0	0	117,9300	3.419.970,00	1,37
RAIFF.EUROPA-HIGHY. (I) T	AT0000A13MR7	EUR	11.100	11.100	0	294,4100	3.267.951,00	1,31
SCHR.ISF-STR.CRED.CDEOHSV	LU0995124236	EUR	15.900	32.000	16.100	90,3589	1.436.706,51	0,58
SISF EURO HIGH YIELD CAEO	LU0849400030	EUR	101.900	13.900	0	167,7645	17.095.202,55	6,86
SISF GL.EQU.YLD C ACC.EUR	LU0248167701	EUR	18.300	18.300	0	206,6416	3.781.541,28	1,52
SISF GL.HY C ACC.EO HDGD	LU0189895658	EUR	53.000	0	55.000	48,4973	2.570.356,90	1,03
T.R.PR.-EUR.H.YLD BD QAEO	LU1032541671	EUR	104.000	0	0	13,9400	1.449.760,00	0,58
VONTOBEL-TW.STRA.INC.HIH	LU1325141510	EUR	20.900	0	0	125,9600	2.632.564,00	1,06
XTR.ST.GL.SE.DI.100SW.1D	LU0292096186	EUR	530.000	530.000	0	29,1000	15.423.000,00	6,19
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR</b>							<b>51.406.066,49</b>	<b>20,64</b>
NEUB.BER.-US H.Y.BD IN.DL	IE00B12VW565	USD	136.000	136.000	0	27,7900	3.174.666,11	1,27
PIMCO G.I-US H.Y.B. INSA	IE0002460974	USD	148.000	148.000	0	40,3000	5.009.995,80	2,01
SISF GL.DIVID.MAX.C ACC	LU0306807156	USD	1.275.000	1.275.000	0	14,4182	15.441.583,37	6,20
SISF-GLOBAL RECOVERY CADL	LU0956908312	USD	35.500	35.500	0	171,7283	5.120.835,49	2,06
UBS FDSO-CMCI C.SF DLAA	IE00B53H0131	USD	336.500	365.000	28.500	80,1650	22.658.985,72	9,10
<b>DEVISENTERMINGESCHAEFTE</b>							<b>-126.568,89</b>	<b>-0,05</b>
DTG EUR CHF 09.07.21	DTG132352	EUR	-1.253.167	0	1.253.167	1,0959	-7.570,90	-0,00
DTG EUR CZK 09.07.21	DTG132371	EUR	-17.045.387	0	17.045.387	25,4998	-86.437,60	-0,03

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2021	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
DTG EUR PLN 09.07.21	DTG132375	EUR	-3.284.759	0	3.284.759	4,5142	-32.560,39	-0,01
<b>BANKGUTHABEN</b>							<b>2.108.750,57</b>	<b>0,85</b>
<b>EUR-Guthaben</b>							<b>2.106.763,15</b>	<b>0,85</b>
EUR-Guthaben							2.106.763,15	0,85
<b>GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAEHRUNGEN</b>							<b>904,27</b>	<b>0,00</b>
CZK							343,11	0,00
PLN							561,16	0,00
<b>GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WAEHRUNGEN</b>							<b>1.083,15</b>	<b>0,00</b>
CHF							1.083,15	0,00
<b>ABGRENZUNGEN</b>							<b>-909.722,77</b>	<b>-0,37</b>
DIVERSE GEBÜHREN							-940.900,22	-0,38
FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN							2.160,19	0,00
SONSTIGE FORDERUNGEN							30.813,64	0,01
ZINSENANSPRÜCHE							-1.796,38	-0,00
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>249.111.831,31</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH)						EUR	212,08	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) I						EUR	218,98	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA						EUR	219,21	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) PLN						PLN	943,49	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) CHF						CHF	118,77	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA CZK						CZK	1.232,44	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) A PLN H						PLN	120,78	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) H						EUR	111,56	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH)						STK	853.220,171	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) I						STK	14.975,436	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA						STK	96.174,094	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) PLN						STK	66.776,937	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) CHF						STK	11.531,640	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA CZK						STK	352.073,807	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) A PLN H						STK	121.990,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) H						STK	74.503,491	

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.06.2021

Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,51470	= 1 (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,09615	= 1 (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	25,50000	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,19050	= 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
<b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>				
AB S.I-A.P.L.C.D.P. I2EOH	LU0736558031	EUR	0	71.000
AB S.I-EM COR.DT P.I2AEOH	LU0736563544	EUR	118.000	118.000
AB S.I-SUST.GL.T.PF I EOH	LU0511383688	EUR	0	140.000
ABSALON-EM CORP.DEBT.I EO	LU1138630998	EUR	275	375
AMF-STRAT.BD I2 UH.EOA	LU1883302660	EUR	41.500	46.800
AMU GL. HIGH YIELD BD (T)	AT0000729397	EUR	3.400	3.400
ASIAN BD.OPPORTUNI.UI REO	LU0679891803	EUR	12.900	12.900
AXA WLD-EURO 10+LT I T.EO	LU0227144903	EUR	0	1.640
AXA WLD-GL.EM.M.B.F-C H	LU0227125944	EUR	22.600	22.600
BERENBERG EM BONDS I D	DE000A1C2XJ0	EUR	0	22.900
BGF-E.MKT.CORP.BD D2C EOH	LU1728038495	EUR	0	460.000
BGF-USD H.YLD BD HG.D2 EO	LU0532707519	EUR	0	17.900
BLUEBAY FDS-EM COR.B I-EO	LU0356219039	EUR	10.800	10.800
BNPP GR.TIGERS I CAP	LU0823438493	EUR	0	34.500
CANDR.BDS-EO L.TERM INH.I	LU0144745956	EUR	0	83
CS IF3-CS(L)E.M.C.B.IBEO	LU0660296384	EUR	22.100	22.100
DEKA-UMWELTINVEST CF	DE000DK0ECS2	EUR	0	23.300
DEKALUXTEAM AKT. ASIEN CF	LU0052859252	EUR	0	6.550
DWS I.-EM.MKTS CORP. FCH	LU0507270097	EUR	0	8.500
ERSTE BD EM GOV EU I T	AT0000A1XWU2	EUR	45.500	45.500
FID.FDS-AS.PA.OP. YACCCEO	LU0345362361	EUR	0	42.500
FID.FDS-EURO BOND Y AC.EO	LU0346390197	EUR	0	44.000
G.SACHS-GL.H.Y.IACC EO-H.	LU0280842005	EUR	0	232.000
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS R	LU0501220429	EUR	17.300	17.300
HSBC GIF-RMB FIX.IN.ICOEEO	LU0782296759	EUR	0	114.000
INV-I.EM BD CHEOA	LU1775956243	EUR	128.000	128.000

## 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
ISHSV-ITAL.GOV'T BD EO D	IE00B7LW6Y90	EUR	0	60.000
LIF-L.E.10Y I.B.G.B. A	LU1598691217	EUR	0	128.000
MAINFIRST-GBL EQU.FD CEO	LU0864710602	EUR	0	9.800
MAN F.-M.GLG GL.CO. ILHEO	IE00B29Z0C19	EUR	37.500	37.500
MFS-M.GLOBAL CONV. IE0A	LU1274833612	EUR	0	60.000
MQ MS BONDS EMER MKT (T)	AT0000817846	EUR	13.200	13.200
MUL-L.AS.E.JAP. EOA	LU1900068161	EUR	0	86.000
SALAR FUND PLC E1ACCEO	IE00B520F527	EUR	30.500	30.500
SCHR.ISF-ASIAN OPP.CACCEO	LU0248183658	EUR	0	99.000
SISF ASIAN CO.BD C AC.EOH	LU0352097272	EUR	0	33.500
T. ROWE PR.-JAP.EQ. Q EUR	LU1127970256	EUR	0	93.000
XTR.MSCI EM ASIA SWAP 1C	LU0292107991	EUR	0	255.000
XTR.MSCI TAIWAN 1C	LU0292109187	EUR	0	135.000
XTR.NIKKEI 225 2DEOH	LU1875395870	EUR	0	29.000
ZANTKE EO CO.BDS AMI I(A)	DE000A0Q8HQ0	EUR	0	37.500
<b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE BRITISCHE PFUND</b>				
JPM-ST.MA.RE.JPMSMR IALS	LU1422956794	GBP	277	277
<b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR</b>				
INVESCOM2 E GL BLOCKCH A	IE00BGBN6P67	USD	0	54.000
JPM-PACIF.EQU.JPMPE IADL	LU0248057431	USD	0	20.100
L+G-L+G R.GBL ROB.AUTOM.	IE00BMW3QX54	USD	320.000	320.000
LIF-MILLEN.ETF DLA	LU2023678449	USD	455.000	455.000
MUL-LYX.DL 10Y I.EX.UE A	LU1390062831	USD	108.000	108.000
VONTOBEL-EM.MKT.C.BD IDLA	LU1305089796	USD	33.500	33.500

## **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.

# 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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.06.2021)  
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

## Geschäftsführung

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

Dr. Dirk Erdmann (ab dem 01.07.2021)  
Mitglied der Geschäftsführung der  
Ampega Asset Management GmbH

Manfred Köberlein

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari (ab dem 01.07.2021)

## Aufsichtsrat

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

Dr. Jan Wicke, 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

## 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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)