

Rechenschaftsbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return ESG

1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022

OGAW-Sondervermögen



RECHENSCHAFTSBERICHT

des C-QUADRAT ARTS Total Return ESG, Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 2 InvFG 2011, für das Rechnungsjahr vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022.

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

die Ampega Investment GmbH legt hiermit den Bericht des C-QUADRAT ARTS Total Return ESG über das abgelaufene Rechnungsjahr vor.

Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates sowie den Gesellschafterkreis finden Sie im Abschnitt "Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft".

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)	TEUR	8.935
davon feste Vergütung	TEUR	7.050
davon variable Vergütung	TEUR	1.885
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen	TEUR	n.a.
Zahl der Mitarbeiter der KVG (ohne Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)		80
Höhe des gezahlten Carried Interest	TEUR	n.a.
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütungen Risktaker	TEUR	3.612
davon Geschäftsleiter	TEUR	1.617
davon andere Führungskräfte	TEUR	1.569
davon andere Risikoträger	TEUR	n.a.
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen	TEUR	426
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe	TEUR	n.a.

Die Angaben zu den Vergütungen sind dem zuletzt festgestellten Jahresabschluss der KVG entnommen und werden aus den Entgeltabrechnungsdaten des Jahres ermittelt. Zur Grundvergütung können Mitarbeiter und Geschäftsleiter eine leistungsorientierte Vergütung erhalten. Nähere Hinweise und Erläuterungen zum Vergütungssystem der Gesellschaft sind auf der Internetseite der Gesellschaft (www.ampega.com) erhältlich. Die Vergütung, die Risikoträger im Jahr von anderen Gesellschaften des Talanx Konzerns erhielten, wurde bei der Ermittlung der Vergütungen einbezogen.

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik durch die Gesellschaft hat ergeben, dass Änderungen der Vergütungspolitik nicht erforderlich sind.

Wesentliche Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik fanden daher im Berichtszeitraum nicht statt.

Vom Unternehmen ARTS Asset Management GmbH, an die das Portfoliomanagement ausgelagert ist, wurden uns folgende Informationen zur Mitarbeitervergütung übermittelt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Auslagerungsunternehmen gezahlten Mitarbeitervergütung	TEUR	3.442
davon feste Vergütung	TEUR	3.395
davon variable Vergütung	TEUR	47

Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen n.a.

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens 36

Stand: 31.12.2021

Köln, am 26. April 2023

Ampega Investment GmbH
Die Geschäftsführung



Dr. Dirk Erdmann



Stefan Kampmeyer



Dr. Thomas Mann



Jürgen Meyer



Djam Mohebbi-Ahari

Vergleichende Übersicht über die letzten vier Rechnungsjahre des Fonds

Fondsvermögen gesamt in EUR	
31.12.2022	29.206.192,49
31.12.2021	26.038.593,57
31.12.2020	19.889.250,92
31.12.2019	20.011.285,57
28.12.2018	21.630.478,13

Thesaurierungsfonds AT0000618137 in EUR	Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG
Geschäftsjahr			
31.12.2022	160,22	-25,7213	0,0000
31.12.2021	203,25	19,7107	1,6281
31.12.2020	181,39	8,3547	0,0000
31.12.2019	158,56	-5,4206	0,0000
28.12.2018	156,19	-10,2942	0,0000

Thesaurierungsfonds AT0000A218K9 in EUR	Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG
Geschäftsjahr			
31.12.2022	94,45	-14,3102	0,0000
31.12.2021	120,17	10,5264	2,1297
31.12.2020	107,61	4,2335	0,3482
31.12.2019	94,37	-2,4738	0,0000
28.12.2018	92,23	-3,6910	0,0000

Thesaurierungsfonds AT0000A2RXB0 in EUR (Auflage 20.07.2021)	Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG
Geschäftsjahr			
31.12.2022	84,84	-13,2187	0,0000
31.12.2021	106,98	2,9301	0,6766

Thesaurierungsfonds AT0000A2RXC8 in EUR (Auflage 20.07.2021)	Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil	Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag	Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG
Geschäftsjahr			
31.12.2022	85,45	-12,8016	0,0000
31.12.2021	107,28	3,1652	0,7394

Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

Wertentwicklung im Rechnungsjahr (Fonds Performance)

Ermittlung der Werte nach OeKB-Berechnungsmethode pro Anteil in Fondswährung ohne Berücksichtigung eines Ausgabeaufschlages.

Thesaurierungsanteil (AT0000618137)	
Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres	203,25
Auszahlung am 15.03.2022 (errechneter Wert: 180,31) von EUR 1,6281 (entspricht 0,009029 Anteilen)	
Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres	160,22
Gesamtwert inkl. durch Auszahlung erworbene Anteile (1,0090 * 160,22)	161,67
Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil	-41,58
Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr	-20,46

Thesaurierungsanteil IT retr (AT0000A218K9)	
Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres	120,17
Auszahlung am 15.03.2022 (errechneter Wert: 105,58) von EUR 2,1297 (entspricht 0,020171 Anteilen)	
Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres	94,45
Gesamtwert inkl. durch Auszahlung erworbene Anteile (1,0202 * 94,45)	96,36
Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil	-23,81
Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr	-19,82

Thesaurierungsanteil IT I (AT0000A2RXB0)	
Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres	106,98
Auszahlung am 15.03.2022 (errechneter Wert: 95,21) von EUR 0,6770 (entspricht 0,007111 Anteilen)	
Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres	84,84
Gesamtwert inkl. durch Auszahlung erworbene Anteile (1,0071 * 84,84)	85,44
Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil	-21,54
Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr	-20,13

Thesaurierungsanteil IT IH (AT0000A2RXC8)	
Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres	107,28
Auszahlung am 15.03.2022 (errechneter Wert: 95,47) von EUR 0,7393 (entspricht 0,007744 Anteilen)	
Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres	85,45
Gesamtwert inkl. durch Auszahlung erworbene Anteile (1,0077 * 85,45)	86,11
Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil	-21,17
Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr	-19,73

Fondsergebnis

Ertragsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2022 bis 31.12.2022

Ertragsrechnung Kontogruppe/Konto	EUR	EUR
A) Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)		-3.914.114,36
Ordentliches Fondsergebnis		-198.512,93
Erträge (ohne Kursergebnis)		346.167,33
Dividenerträge einschl. Dividendenäquivalent	274.898,59	
Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen)	-34.034,35	
Zinserträge	105.303,09	
Aufwendungen		-544.680,26
Researchkosten	-3.679,22	
Zulassungskosten Ausland	-3.650,00	
Depotbankgebühren	-13.713,88	
Depotgebühren	-9.029,74	
Wirtschaftsprüfungskosten	-6.764,00	
Verwaltungsgebühren	-469.171,24	
Pflicht- bzw. Veröffentlichungskosten	-38.672,18	
Realisiertes Kursergebnis		-3.715.601,43
Gewinne aus derivativen Instrumenten	783.796,55	
Realisierte Gewinne	1.862.216,53	
Verluste aus derivativen Instrumenten	-2.184.205,12	
Realisierte Verluste	-4.177.409,39	
B) Nicht realisiertes Fondsergebnis		-2.114.369,42
Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses	-2.111.992,82	
Veränderung der Dividendenforderungen	-2.376,60	
C) Ertragsausgleich		-697.503,97
Ertragsausgleich für Erträge des Rechnungsjahres	-697.503,97	
Fondsergebnis gesamt		-6.725.987,75

Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von 125.754,32 EUR

Entwicklung des Fondsvermögens

Entwicklung des Fondsvermögens		Vermögen in EUR
Fondsvermögen am 31.12.2021 (148.540,779 Anteile)		26.038.593,57
Auszahlung am 15.03.2022 (EUR 0,677 x 10 Thesaurierungsanteilen)		-6,77
Auszahlung am 15.03.2022 (EUR 0,7393 x 14 Thesaurierungsanteilen)		-10,35
Auszahlung am 15.03.2022 (EUR 1,6281 x 98.796,297 Thesaurierungsanteilen)		-160.850,25
Auszahlung am 15.03.2022 (EUR 2,1297 x 89.170,74 Thesaurierungsanteilen)		-189.906,92
Mittelveränderung		10.244.360,96
aus Zertifikatsabsatz	13.610.784,55	
aus Zertifikatrücknahmen	-4.063.927,56	
Anteiliger Ertragsausgleich	697.503,97	
Fondsergebnis gesamt		-6.725.987,75
Fondsvermögen am 31.12.2022 (219.564,110 Anteile)		29.206.192,49

Finanzmärkte und Anlagepolitik

Finanzmärkte

Mit einer Aufwärtsbewegung starteten die Indizes in die erste Handelswoche, diese wurde jedoch bereits kurz darauf, vor dem Hintergrund einer geplanten Zinserhöhung und somit dem Ausstieg aus der lockeren Geldpolitik durch die US-Notenbank Fed, gebrochen. Nicht nur die Aktienindizes verloren massiv, sondern auch Kryptowährungen, wie beispielsweise Bitcoin, konnten der Abwärtsbewegung nicht entgehen. Auch ein erneuter Aufwärtsschwung in den letzten Handelstagen des Jänners konnte einen negativen Jahresauftakt nicht verhindern. Dies endete sogar in einer regelrechten Talfahrt der europäischen Indizes. So verlor beispielsweise der deutsche Aktienindex DAX, mit -10,03% in der Spitze massiv an Wert. Von medialer Seite stand der Einmarsch russischer Truppen in die Ukraine und somit der schwelende Krieg, nahe der Grenzen der EU, im Vordergrund. Die damit verbundenen Sanktionen gegen Russland, die unter anderem ein Handelsverbot für russische Staatsanleihen und den Ausschluss mehrerer russischer Banken aus dem SWIFT-System vorsehen, führten zu einer Schließung der Moskauer Börse. Die folgenden Monate waren weiterhin von Verlusten geprägt sowie von einem massiv steigenden Ölpreis, der den höchsten Stand seit 2008 verzeichnete. Erst der Sommer brachte etwas Entspannung. Am stärksten performten hier neben den US-amerikanischen Indizes, Indizes aus Fernost, beispielsweise der japanischen Nikkei 225. Der September und Oktober verliefen wiederum zweigeteilt. Während an den europäischen Handelsplätzen eine moderate Aufwärtsbewegung verzeichnet werden konnte, verlief der Start der US-amerikanischen und asiatischen Indizes eher seitwärts. Diese positive Tendenz hielt jedoch nicht lange an, denn bereits zur Mitte des Septembers kam es zu einer Kehrtwende, welche herbe Verluste nach sich zog. Der europäische Leitindex EUROSTOXX 50, als auch der amerikanische Dow Jones Industrial Average erreichten den niedrigsten Stand seit Ende 2020. Medial präsent waren die Zinserhöhung der US-Notenbank Fed, der Rutsch des Euros auf den tiefsten Stand seit 20 Jahren, sowie die immer weiter steigenden Energiepreise und der anhaltende Ukraine-Konflikt. Im Oktober jedoch konnten die internationalen Aktienindizes eine positive Tendenz aufweisen. Einmal mehr standen die weiter steigende Teuerung und die damit verbundene Erhöhung des Leitzinses durch die EZB um weitere 0,75% im Mittelpunkt der medialen Berichterstattung. Die folgende moderate Abwärtsbewegung wurde schon kurz darauf von einer erneuten Erholung abgelöst. Allen voran waren die europäischen Indizes, wie der europäische Leitindex EUROSTOXX 50, welcher den höchsten Stand seit März erreichen konnte aber auch der deutsche Leitindex DAX, der den November mit 8,6% abschließen konnte. In den letzten

Berichtsmonat des Jahres 2022 starteten die internationalen Aktienindizes eher seitwärts. Auch ein kurzer Erholungsversuch gegen Mitte Dezember konnte dem nicht nachhaltig entgegenwirken. Am stärksten waren US-amerikanische Indizes betroffen, beispielsweise der marktweite S&P 500, der gegen Ende der Berichtsperiode -7,28% verlor. Auch ein kurzer Aufschwung am Ende des Jahres konnte die insgesamt negative Entwicklung nicht bessern. Im medialen Mittelpunkt stand die Leitzinserhöhung der Fed um einen weiteren halben Prozentpunkt genauso wie der Beschluss der Fed als auch der EZB weitere entschlossene Maßnahmen zur Eindämmung der steigenden Inflation zu setzen.

Anlagepolitik

Der C-QUADRAT ARTS Total Return ESG ist ein Aktienfonds, der einen aktiven, nach ESG Kriterien gemanagten Vermögensverwaltungs-Ansatz verfolgt. Die aktuelle Zielallokation wird erstellt, indem ESG-Kriterien hierbei angemessen berücksichtigt und die Attraktivität der einsetzbaren Investments ermittelt werden. Zudem werden diese mit den Bedürfnissen der Anleger nach Rendite und Risikostreuung vereint. Die Anlagepolitik folgt einem Total-Return-Ansatz. Hierbei nutzt das Fondsmanagement ein von ARTS Asset Management entwickeltes technisches Handelsprogramm mit einer kurz- bis mittelfristig trendfolgenden Ausrichtung. Zu diesem Zweck arbeitet ARTS mit dem renommierten Analysehaus ISS ESG zusammen, welches das Basis-Universum nach den Nachhaltigkeitskriterien des Österreichischen Umweltzeichens und des FNG-Siegels analysiert und zur Verfügung stellt. Das Fondsvermögen kann bis zu 100% in Aktien veranlagt werden. In negativen Börsenzeiten kann die Aktienquote reduziert und das Aktienrisiko über Derivate bis auf 0% abgesichert, bzw. in konservativere ESG-Anleihen- oder geldmarktnahe Anlagen ausgewichen werden. Die Anlagestrategie orientiert sich nicht an einer Benchmark.

Zusammensetzung des Fondsvermögens

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
						im Berichtszeitraum		
SUMME DER ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE							15.569.554,82	53,31
AKTIEN Euro							1.531.983,00	5,25
ALLIANZ SE NA O.N.	DE0008404005	EUR	2.200	4.030	1.830	203,7000	448.140,00	1,53
AXA S.A. INH. EO 2,29	FR0000120628	EUR	16.400	29.200	12.800	26,4000	432.960,00	1,48
MUENCH.RUECKVERS.VNA O.N.	DE0008430026	EUR	1.461	1.461	0	305,9000	446.919,90	1,53
SAP SE O.N.	DE0007164600	EUR	2.090	2.090	0	97,5900	203.963,10	0,70
AKTIEN US Dollar							10.822.708,46	37,06
ADT INC. DL-,01	US00090Q1031	USD	51.000	51.000	0	9,2100	440.360,01	1,51
AIR PROD. CHEM. DL 1	US0091581068	USD	1.400	1.400	0	311,4100	408.732,01	1,40
AMGEN INC. DL-,0001	US0311621009	USD	1.200	1.900	700	263,1600	296.059,63	1,01
AUTOZONE INC. DL-,01	US0533321024	USD	100	100	200	2.464,3800	231.039,23	0,79
BIOGEN INC. DL -,0005	US09062X1037	USD	1.600	1.600	0	276,0000	414.006,47	1,42
BOSTON SCIENTIFIC DL-,01	US1011371077	USD	7.200	7.200	0	46,3500	312.867,39	1,07
CAMPBELL SOUP CO.DL-,0375	US1344291091	USD	8.700	8.700	0	56,7100	462.548,16	1,58
CATERPILLAR INC. DL 1	US1491231015	USD	1.900	1.900	0	240,2000	427.862,94	1,46
CIGNA CORP. NEW DL 1	US1255231003	USD	1.600	1.600	0	330,7200	496.087,75	1,70
CONAGRA BRANDS INC. DL 5	US2058871029	USD	12.100	12.100	0	38,7700	439.804,06	1,51
CUMMINS INC. DL 2,50	US2310211063	USD	1.800	1.800	0	241,7300	407.925,75	1,40
DEXCOM INC. DL-,001	US2521311074	USD	4.100	4.100	0	112,0700	430.775,79	1,47
ELI LILLY	US5324571083	USD	1.100	1.700	600	367,0200	378.495,29	1,30
FAIR ISAAC CORP. DL-,01	US3032501047	USD	700	700	0	600,9000	394.346,79	1,35
GARTNER INC. DL -,0005	US3666511072	USD	1.300	1.300	1.600	340,2200	414.649,60	1,42
GENL MILLS DL -,10	US3703341046	USD	6.100	6.100	0	84,3800	482.555,66	1,65
GILEAD SCIENCES DL-,001	US3755581036	USD	4.500	4.500	0	85,2600	359.696,25	1,23
GRAINGER (W.W.) INC. DL 1	US3848021040	USD	600	1.400	800	562,2200	316.253,69	1,08
HERSHEY CO. DL 1	US4278661081	USD	1.000	2.100	1.100	233,2500	218.675,29	0,75
INTL BUS. MACH. DL-,20	US4592001014	USD	3.000	3.000	0	141,0600	396.737,45	1,36
KELLOGG CO. DL -,25	US4878361082	USD	5.900	5.900	0	71,4700	395.324,61	1,35
LAMB WESTON HLDGS DL 1	US5132721045	USD	3.200	3.200	0	88,9400	266.824,17	0,91
MONDELEZ INTL INC. A	US6092071058	USD	5.800	5.800	0	66,9700	364.155,06	1,25
O'REILLY AUTOMOTIV.DL-,01	US67103H1077	USD	500	500	0	843,6600	395.471,80	1,35
PEPSICO INC. DL-,0166	US7134481081	USD	2.600	5.300	2.700	181,9800	443.583,18	1,52
PRINCIPAL FINL GRP DL-,01	US74251V1026	USD	5.200	5.200	0	85,5100	416.867,76	1,43
ROSS STRS INC. DL-,01	US7782961038	USD	4.000	4.000	0	115,8600	434.481,79	1,49
RYDER SYST. DL-,50	US7835491082	USD	4.800	4.800	0	83,6700	376.520,88	1,29
AKTIEN Britische Pfund							457.649,45	1,57
PEARSON PLC LS-,25	GB0006776081	GBP	43.000	43.000	0	9,4180	457.649,45	1,57
AKTIEN Japanische Yen							1.136.370,47	3,89
AJINOMOTO	JP3119600009	JPY	13.200	13.200	0	4.103,0000	381.125,29	1,30
DAIICHI SANKYO CO. LTD	JP3475350009	JPY	11.600	11.600	0	4.223,0000	344.723,90	1,18
EISAI CO. LTD	JP3160400002	JPY	6.700	6.700	0	8.707,0000	410.521,28	1,41
AKTIEN Dänische Kronen							469.964,70	1,61
DANSKE BK NAM. DK 10	DK0010274414	DKK	25.500	25.500	0	137,0500	469.964,70	1,61
ANLEIHEN Euro							1.150.878,74	3,94
B.T.P. 13-24	IT0004953417	EUR	1.133.000	3.363.000	2.230.000	101,5780	1.150.878,74	3,94
FINANZTERMINKONTRAKTE							-14.350,61	-0,05
CAC40 Index Future 20230120	0FCE20230120	EUR	-8	0	8	6.572,5000	-5.245,00	-0,02
Mini S&P 500 Future 20230317	0FES20230317	USD	-3	0	3	3.871,7500	-9.105,61	-0,03

Vermögensaufstellung zum 31.12.2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 31.12.2022	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
				im Berichtszeitraum				
BANKGUTHABEN							13.669.591,47	46,80
EUR-Guthaben							13.654.116,48	46,75
EUR-Guthaben							13.654.116,48	46,75
GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAEHRUNGEN							1.565,22	0,01
PLN							659,52	0,00
SEK							905,70	0,00
GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WAEHRUNGEN							13.909,77	0,05
AUD							751,72	0,00
CAD							544,29	0,00
CHF							1.275,23	0,00
GBP							664,20	0,00
HKD							1.388,65	0,00
JPY							3.172,75	0,01
MXN							1.378,69	0,00
SGD							1.077,09	0,00
USD							3.003,87	0,01
ZAR							653,28	0,00
ABGRENZUNGEN							-18.603,19	-0,06
DIVERSE GEBÜHREN							-49.056,56	-0,17
DIVIDENDENFORDERUNGEN							7.437,40	0,03
ZINSENANSPRÜCHE							23.015,97	0,08
Fondsvermögen						EUR	29.206.192,49	100,00¹⁾
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH)						EUR	160,22	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT retr						EUR	94,45	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT I						EUR	84,84	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT IH						EUR	85,45	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH)						STK	128.879,110	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT retr						STK	89.768,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT I						STK	813,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT IH						STK	104,000	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.12.2022

Australische Dollar	(AUD)	1,57660	= 1 (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,88490	= 1 (EUR)
Canadische Dollar	(CAD)	1,44725	= 1 (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,43625	= 1 (EUR)
Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,31375	= 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	142,10445	= 1 (EUR)
Mexikanische Peso	(MXN)	20,60875	= 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,67450	= 1 (EUR)
Schwedische Krone	(SEK)	11,15325	= 1 (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,98505	= 1 (EUR)
Singapur Dollar	(SGD)	1,43540	= 1 (EUR)
Südafrikanische Rand	(ZAR)	18,01170	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,06665	= 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
BEZUGSRECHTE Euro				
TELEFONICA INH. -ANR-	ES06784309G2	EUR	84.000	84.000
ANLEIHEN Euro				
B.T.P. 12-22	IT0004848831	EUR	2.320.000	2.320.000
B.T.P. 2023 01.11	IT0000366655	EUR	2.110.000	2.110.000
BUNDANLV.94/24	DE0001134922	EUR	1.827.000	1.827.000
AKTIEN Australische Dollar				
BRAMBLES LTD	AU000000BXB1	AUD	46.000	46.000
COMPUTERSHARE LTD.	AU000000CPU5	AUD	25.000	25.000
AKTIEN Canadische Dollar				
BCE INC. NEW	CA05534B7604	CAD	8.300	8.300
BK MONTREAL CD 2	CA0636711016	CAD	4.000	4.000
BK NOVA SCOTIA	CA0641491075	CAD	0	6.800
CANADIAN NATL RAILWAY CO.	CA1363751027	CAD	0	3.300
CIBC	CA1360691010	CAD	0	3.500
DOLLARAMA INC.	CA25675T1075	CAD	4.400	4.400
LOBLAW COS LTD	CA5394811015	CAD	5.100	5.100
NATL BK OF CDA	CA6330671034	CAD	0	5.700
POWER CORPORATION OF CDA	CA7392391016	CAD	0	14.100
ROYAL BK CDA	CA7800871021	CAD	3.500	3.500
STANTEC INC.	CA85472N1096	CAD	0	8.900
TELUS CORP.	CA87971M1032	CAD	18.000	18.000
THOMSON REUTERS CORP.	CA8849037095	CAD	0	3.700
TORONTO-DOMINION BK	CA8911605092	CAD	5.000	5.000
AKTIEN Schweizer Franken				
CIE FIN.RICHEMONT SF 1	CH0210483332	CHF	0	2.850
SIKA AG NAM. SF 0,01	CH0418792922	CHF	0	1.070

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
STRAUMANN HLDG NA SF 0,10	CH0012280076	CHF	0	243
SWISS LIFE HLDG NA SF0,10	CH0014852781	CHF	740	740
SWISS RE AG NAM. SF -,10	CH0126881561	CHF	4.500	4.500
UBS GROUP AG SF -,10	CH0244767585	CHF	7.000	23.600
AKTIEN Euro				
ABN AMRO BANK DR/EO1	NL0011540547	EUR	0	29.450
AEGON NV (DEMAT.) EO-12	NL0000303709	EUR	78.000	78.000
BNP PARIBAS INH. EO 2	FR0000131104	EUR	3.150	3.150
CAPGEMINI SE INH. EO 8	FR0000125338	EUR	0	1.210
FUGRO NV NAM. EO 0,05	NL00150003E1	EUR	12.300	12.300
GAZTRANSP.TECHNIG.EO-,01	FR0011726835	EUR	3.250	3.250
HERMES INTERNATIONAL O.N.	FR0000052292	EUR	0	293
IMCD N.V. EO -,16	NL0010801007	EUR	0	1.981
INTESA SANPAOLO	IT0000072618	EUR	152.000	152.000
NN GROUP NV EO -,12	NL0010773842	EUR	8.300	8.300
ORANGE INH. EO 4	FR0000133308	EUR	35.300	35.300
PUBLICIS GRP INH. EO 0,40	FR0000130577	EUR	0	6.900
TELEFONICA DTL D HLDG NA	DE000A1J5RX9	EUR	142.000	142.000
TELEFONICA INH. EO 1	ES0178430E18	EUR	84.000	84.000
UNICREDIT	IT0005239360	EUR	28.000	28.000
VIVENDI SE INH. EO 5,5	FR0000127771	EUR	0	33.500
AKTIEN Britische Pfund				
CRODA INTL LS -,10609756	GB00BJFFLV09	GBP	0	3.450
DIAGEO PLC LS-,28935185	GB0002374006	GBP	8.000	8.000
FERGUSON PLC LS 0,1	JE00BJVNS543	GBP	2.490	2.490
IMI PLC LS-,2857	GB00BGLP8L22	GBP	0	17.500
MARKS SPENCER GRP LS-,01	GB0031274896	GBP	140.000	140.000
SAGE GRP PLC LS-,01051948	GB00B8C3BL03	GBP	38.000	38.000
STAND. CHART. PLC DL-,50	GB0004082847	GBP	55.600	55.600
TESCO PLC LS-,0633333	GB00BLGZ9862	GBP	67.000	112.000
WPP PLC LS-,10	JE00B8KF9B49	GBP	25.500	25.500
AKTIEN Hongkong Dollar				
BYD CO. LTD H YC 1	CNE100000296	HKD	11.000	11.000
WH GROUP LTD DL-,0001	KYG960071028	HKD	590.000	590.000
AKTIEN Japanische Yen				
FUJI ELECTRIC CO. LTD.	JP3820000002	JPY	7.900	7.900
ITOCHU CORP.	JP3143600009	JPY	13.700	13.700
NGK SPARK PLUG	JP3738600000	JPY	20.300	20.300
AKTIEN Mexikanische Peso				
AMERICA MOVIL L	MXP001691213	MXN	345.000	345.000
AKTIEN Schwedische Krone				
TELIA COMPANY AB SK 3,20	SE0000667925	SEK	102.000	102.000
AKTIEN Singapur Dollar				
DBS GRP HLDGS SD 1	SG1L01001701	SGD	15.600	15.600
UTD OV. BK SD 1	SG1M31001969	SGD	21.200	21.200
AKTIEN US Dollar				
ABBVIE INC. DL-,01	US00287Y1091	USD	3.200	3.200
ALLSCRIPTS HEAL.SOL.DL-01	US01988P1084	USD	22.500	22.500
AMCOR PLC DL -,01	JE00BJ1F3079	USD	34.500	34.500
AMDOCS LTD. LS-,01	GB0022569080	USD	5.000	5.000
ARCHER DANIELS MIDLAND	US0394831020	USD	4.800	4.800
ARISTA NETWORKS DL-,0001	US0404131064	USD	0	3.200
ASSURANT INC. DL-,01	US04621X1081	USD	2.500	2.500
AUTOM. DATA PROC. DL -,10	US0530151036	USD	1.400	1.400

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
AVERY DENNISON DL 1	US0536111091	USD	0	1.100
AVIS BUDGET GROUP DL-,01	US0537741052	USD	0	1.900
AVNET INC. DL 1	US0538071038	USD	9.200	9.200
BRISTOL-MYERS SQUIBB DL-10	US1101221083	USD	6.600	6.600
CARLISLE COS. INC. DL 1	US1423391002	USD	0	2.100
CARLYLE GROUP INC.	US1431610888	USD	0	9.800
CHECK POINT SOFTW. TECHS	IL0010824113	USD	3.100	3.100
CHIPOTLE MEX.GR. DL -,01	US1696561059	USD	200	400
CHURCH + DWIGHT CO. DL 1	US1713401024	USD	4.100	4.100
CIENA CORP. NEW DL-,01	US1717793095	USD	0	5.800
COSTCO WHOLESALE DL-,005	US22160K1051	USD	0	700
DELL TECHS INC. C DL-,01	US24703L2025	USD	0	3.300
DOVER CORP. DL 1	US2600031080	USD	0	2.000
EDGEWELL PERS.CARE DL-,01	US28035Q1022	USD	8.900	8.900
ELEVANCE HEALTH DL-,01	US0367521038	USD	900	900
ENCORE CAP. DL-,01	US2925541029	USD	7.300	7.300
ENPHASE ENERGY INC.DL-,01	US29355A1079	USD	1.000	1.000
ESTEE LAUDER COS A DL-,01	US5184391044	USD	0	1.200
EVERSOURCE ENERGY DL 5	US30040W1080	USD	4.600	4.600
FACTSET RESH SYS DL-,01	US3030751057	USD	800	1.800
FIRST SOLAR INC. D -,001	US3364331070	USD	2.500	2.500
FMC CORP. DL-,10	US3024913036	USD	3.200	3.200
FTI CONSULTING DL-,01	US3029411093	USD	4.400	4.400
HARLEY-DAVID.INC. DL -,01	US4128221086	USD	9.700	9.700
HENRY SCHEIN INC. DL-,01	US8064071025	USD	5.100	5.100
HEWLETT PACKARD ENT.	US42824C1099	USD	28.000	28.000
HOME DEPOT INC. DL-,05	US4370761029	USD	0	1.000
HP INC DL -,01	US40434L1052	USD	10.800	10.800
HSBC HLDGS PLC ADR/5DL-50	US4042804066	USD	11.800	11.800
HUMANA INC. DL-,166	US4448591028	USD	700	700
INTUIT INC. DL-,01	US4612021034	USD	0	800
IVERIC BIO INC. DL-,001	US46583P1021	USD	21.500	21.500
JONES LANG LASALLE DL-,01	US48020Q1076	USD	0	1.600
JPMORGAN CHASE DL 1	US46625H1005	USD	0	2.900
JUNIPER NETWORKS DL-,01	US48203R1041	USD	0	12.800
KIMBERLY-CLARK DL 1,25	US4943681035	USD	3.100	3.100
KRAFT HEINZ CO.DL -,01	US5007541064	USD	10.000	10.000
KROGER CO. DL 1	US5010441013	USD	8.100	8.100
LOWE'S COS INC. DL-,50	US5486611073	USD	0	1.800
MCCORMICK + CO.INC. N.V.TG	US5797802064	USD	4.700	4.700
MORGAN STANLEY DL-,01	US6174464486	USD	0	4.800
NASDAQ INC. DL -,01	US6311031081	USD	0	2.000
NETEASE INC. ADR/5	US64110W1027	USD	4.100	4.100
NORTHWEST NATURAL HLDG	US66765N1054	USD	8.100	8.100
OMNICOM GRP INC. DL-,15	US6819191064	USD	5.200	5.200
ON SEMICOND. DL-,01	US6821891057	USD	0	6.900
ORACLE CORP. DL-,01	US68389X1054	USD	0	5.100
OTIS WORLDWID.CORP DL-,01	US68902V1070	USD	0	4.600
PACKAGING CORP. OF AMER.	US6951561090	USD	2.900	2.900
PALO ALTO NETWKS DL-,0001	US6974351057	USD	600	600
PAYCHEX INC. DL-,01	US7043261079	USD	0	3.500
PERKINELMER INC. DL 1	US7140461093	USD	0	2.400
QUALCOMM INC. DL-,0001	US7475251036	USD	0	2.300
QUANTA SVCS DL-,00001	US74762E1029	USD	3.100	3.100

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
RESMED INC. DL-,004	US7611521078	USD	0	1.500
ROBERT HALF INTL DL-,001	US7703231032	USD	0	4.300
ROCKWELL AU. DL 1	US7739031091	USD	0	1.200
ROYAL GOLD INC. DL-,01	US7802871084	USD	3.200	3.200
S+P GLOBAL INC. DL 1	US78409V1044	USD	0	900
SEAGEN INC. DL-,001	US81181C1045	USD	1.600	1.600
SEMPRA	US8168511090	USD	2.700	2.700
SERVICENOW INC. DL-,001	US81762P1021	USD	0	600
SWITCH INC. CL.A DL-,001	US87105L1044	USD	0	17.100
SYNOPSIS INC. DL-,01	US8716071076	USD	0	1.300
THERMO FISH.SCIENTIF.DL 1	US8835561023	USD	0	700
TRAVELERS COS INC.	US89417E1091	USD	2.500	2.500
TREEHOUSE FOODS DL-,01	US89469A1043	USD	7.700	7.700
UNION PAC. DL 2,50	US9078181081	USD	1.600	1.600
UNITED PARCEL SE.B DL-01	US9113121068	USD	2.000	2.000
VALVOLINE INC. DL-,01	US92047W1018	USD	11.800	11.800
WESCO INTL INC. DL-,01	US95082P1057	USD	0	4.000
WOLFSPEED INC. DL-,00125	US9778521024	USD	3.100	3.100
WORKDAY INC.CL.A DL-,001	US98138H1014	USD	0	1.500
ZEBRA TECH. A DL-,01	US9892071054	USD	0	800
AKTIEN Südafrikanische Rand				
ABSA GROUP LTD. RC 2	ZAE000255915	ZAR	39.000	39.000
NEDBANK GROUP LTD. RC 1	ZAE000004875	ZAR	31.000	31.000
SHOPRITE HLD LTD RC 1,134	ZAE000012084	ZAR	30.000	30.000

Derivate

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
FINANZTERMINKONTRAKTE				
CAC40 Index Future 20220318	0FCE20220318	EUR	8	8
CAC40 Index Future 20220414	0FCE20220414	EUR	33	33
CAC40 Index Future 20220520	0FCE20220520	EUR	40	40
CAC40 Index Future 20220617	0FCE20220617	EUR	66	66
CAC40 Index Future 20220715	0FCE20220715	EUR	63	63
CAC40 Index Future 20220819	0FCE20220819	EUR	57	57
CAC40 Index Future 20220916	0FCE20220916	EUR	14	14
CAC40 Index Future 20221021	0FCE20221021	EUR	73	73
CAC40 Index Future 20221118	0FCE20221118	EUR	59	59
OSE Nikkei 225 Index Fut 20220609	FSNO20220609	JPY	31	31
OSE Nikkei 225 Index Fut 20220908	FSNO20220908	JPY	25	25
OSE Nikkei 225 Index Fut 20221208	FSNO20221208	JPY	23	23
Mini S&P 500 Future 20220318	0FES20220318	USD	1	1
Mini S&P 500 Future 20220617	0FES20220617	USD	42	42
Mini S&P 500 Future 20220916	0FES20220916	USD	34	34
Mini S&P 500 Future 20221216	0FES20221216	USD	29	29

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 ESG (TTH) IT I und die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return ESG (TTH) IT IH wird gemäß den Fondsbestimmungen keine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Darüber hinaus wird gemäß den Fondsbestimmungen eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Während der Berichtsperiode wurde keine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben.

Den enthaltenen Unterfonds, die nicht in eigener Verwaltung stehen, wurden von deren jeweils verwaltenden Kapitalanlagegesellschaften Verwaltungsentschädigungen zwischen 0 % und 0 % p. a. verrechnet. Für den Kauf der Anteile wurden von diesen Fondsgesellschaften keine Ausgabeaufschläge in Rechnung gestellt.

Bestätigungsvermerk

Bericht zum Rechenschaftsbericht

Prüfungsurteil

Wir haben den Rechenschaftsbericht der Ampega Investment GmbH, über den von ihr verwalteten

C-QUADRAT ARTS Total Return ESG, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2022, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Rechenschaftsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. Dezember 2022 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung gemäß § 49 Abs 5 InvFG 2011 in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Diese Grundsätze erfordern die Anwendung der International Standards on Auditing (ISA). Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt "Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts" unseres Bestätigungsvermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und wir haben unsere sonstigen beruflichen Pflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen im Rechenschaftsbericht, ausgenommen die Vermögensaufstellung, die Ertragsrechnung, die sonstigen

in Anlage I Schema B InvFG 2011 vorgesehenen Angaben und den Bestätigungsvermerk.

Unser Prüfungsurteil zum Rechenschaftsbericht erstreckt sich nicht auf diese sonstigen Informationen und wir geben dazu keine Art der Zusicherung.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Rechenschaftsberichts haben wir die Verantwortlichkeit, diese sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Rechenschaftsbericht oder zu unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf der Grundlage der von uns zu den vor dem Datum des Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers erlangten sonstigen Informationen durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Rechenschaftsbericht

Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Aufstellung des Rechenschaftsberichts und dafür, dass dieser in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011 ein möglichst getreues Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Fonds vermittelt. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachten, um die Aufstellung eines Rechenschaftsberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Der Aufsichtsrat ist verantwortlich für die Überwachung des Rechnungslegungsprozesses der Gesellschaft betreffend den von ihr verwalteten Fonds.

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Rechenschaftsbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist und einen Bestätigungsvermerk zu

erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Rechenschaftsberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus gilt:

- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Rechenschaftsbericht, planen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken, führen sie durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- Wir gewinnen ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- Wir beurteilen die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängende Angaben.
- Wir beurteilen die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Rechenschaftsberichts einschließlich der Angaben sowie ob der Rechenschaftsbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse in einer Weise wiedergibt, dass ein möglichst getreues Bild erreicht wird.

Wir tauschen uns mit dem Aufsichtsrat unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung erkennen, aus.

Wien, am 26. April 2023

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfung GmbH

Mag. Robert PEJHOVSKY
Wirtschaftsprüfer

Anhang gemäß Offenlegungsverordnung

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

C-QUADRAT ARTS Total Return ESG

Unternehmenskennung (LEI-Code):

529900R7GX3HX07QCZ36

Ökologische- und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieses Finanzprodukt trägt zu keinem Umweltziel im Sinne von Art. 9 der Taxonomieverordnung bei.

Das Fondsvermögen wurde risikodiversifiziert vor allem in Aktien, bonitätsstarke Staatsanleihen und Geldmarkt, angelegt.

Die Titelselektion erfolgte nach einem Best-in-Class-Ansatz und berücksichtigte neben finanziellen Aspekten im Besonderen auch ökologische, soziale und Kriterien der guten Unternehmensführung. Bei der Investition des Fondsvermögens wurden Nachhaltigkeits- bzw. ESG-Kriterien (Ecological, Social, Governance) berücksichtigt. Dazu wurden Treibhausgas-Emissionen, Klimaziele, Maßnahmen und Strategien zur Emissionsminderung der jeweiligen Emittenten in die Anlageentscheidung einbezogen.

Die Zusammensetzung des Portfolios sowie die ESG-Scores, Ausschlüsse und sonstiger Nachhaltigkeitsfaktoren der zugrundeliegenden Vermögenswerte wurden sowohl bei der Investitionsentscheidung als auch kontinuierlich überprüft.

Die Bewertung der sozialen und ökologischen Merkmale der Investitionen basierte auf Informationen von spezialisierten externen Datenanbietern sowie auf eigenen Analysen, die von internen Analysten durchgeführt wurden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Indikator

ISS ESG Performance Score

Beschreibung

Die ESG-Leistung eines Unternehmens wird anhand eines Standardsatzes von mehr als 700 sektorübergreifenden Indikatoren bewertet, die durch 100 sektorspezifische Indikatoren ergänzt werden, um die wesentlichen ESG-Herausforderungen eines Unternehmens zu erfassen. Für jeden Sektor werden vier bis fünf Schlüsselthemen ermittelt. Um sicherzustellen, dass sich die Leistung in Bezug auf diese wichtigsten Themen angemessen in den Ergebnissen des Gesamtratings widerspiegelt, macht ihre Gewichtung mindestens 50 % des Gesamtratings aus. Das Ausmaß der branchenspezifischen E-, S- und G- Risiken und Auswirkungen bestimmt die jeweiligen Leistungsanforderungen: Ein Unternehmen einer Branche mit hohen Risiken muss besser abschneiden als ein Unternehmen in einer Branche mit geringen Risiken, um das gleiche Rating zu erhalten. Jedes ESG-Unternehmensrating wird durch eine Analystenmeinung ergänzt, die eine qualitative Zusammenfassung und Analyse der zentralen Ratingergebnisse in drei Dimensionen liefert: Nachhaltigkeits-Chancen, Nachhaltigkeits-Risiken und Governance. Um eine hohe Qualität der Analysen zu gewährleisten, werden Indikatoren, Ratingstrukturen und Ergebnisse regelmäßig von einem beim externen Datenanbieter angesiedelten Methodology Board überprüft. Darüber hinaus werden die Methodik und die Ergebnisse beim externen Datenanbieter

regelmäßig mit einem externen Rating-Ausschuss diskutiert, der sich aus hoch anerkannten ESG-Experten zusammensetzt.

Methodik

Der ESG-Performance-Score ist die numerische Darstellung der alphabetischen Bewertungen (A+ bis D-) auf einer Skala von 0 bis 100. Alle Indikatoren werden einzeln auf der Grundlage klar definierter absoluter Leistungserwartungen bewertet. Auf der Grundlage der einzelnen Bewertungen und Gewichtungen auf Indikatorebene werden die Ergebnisse aggregiert, um Daten auf Themenebene sowie eine Gesamtbewertung (Performance Score) zu erhalten. 100 ist dabei die beste Bewertung, 0 die schlechteste.

Indikator

Sustainalytics ESG Risk Score

Beschreibung

Das ESG-Risiko-Rating (ESG Risk Rating) bewertet Maßnahmen von Unternehmen sowie branchenspezifische Risiken in den Bereichen Umwelt (Environmental), Soziales (Social) und verantwortungsvolle Unternehmensführung (Governance). Die Bewertung erfolgt in Bezug auf Faktoren, die als wesentliche

ESG-Themen (Material ESG Issues - MEIs) einer Branche identifiziert werden, wie Umweltperformance, Ressourcenschonung, Einhaltung der Menschenrechte, Management der Lieferkette. Der Bewertungsrahmen umfasst 20 MEIs, die sich aus über 250 Indikatoren zusammensetzen. Pro Branche sind in der Regel drei bis acht dieser Themen relevant.

Methodik

Die Skala läuft von 0 bis 100 Punkten (Scores): 0 ist dabei die beste Bewertung, 100 die schlechteste. Die Unternehmen werden anhand ihrer Scores in fünf Risikokategorien gruppiert, beginnend beim geringsten Risiko „Negligible“ (0 – 10 Punkte) bis zu „Severe“ (über 40 Punkte), der schlechtesten Bewertung. Unternehmen sind damit auch über unterschiedliche Branchen vergleichbar.

Referenzperiode	31.12.2022
ISS ESG Performance Score	27,10
Sustainalytics ESG Risk Score	10,09
Anteil Investitionen mit E/S-Merkmal	54,17%
Anteil der sonstigen Investitionen	45,83%

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

- Die Steuerung nach den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impact) ist in diesem Fonds kein Bestandteil der Anlagestrategie.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

- Zu den Hauptinvestitionen zählen die 15 Positionen des Wertpapiervermögens mit dem höchsten Durchschnittswert der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.01.2022 - 31.12.2022

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Italy BTP (IT0000366655)	Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialvers.	2,88%	Italien
Anthem Inc. (US0367521038)	Gesundheitswesen	1,14%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Eli Lilly & Co. (US5324571083)	Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	1,05%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083)	Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	1,01%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
The Hershey Company (US4278661081)	Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	0,96%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Amgen Inc. (US0311621009)	Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	0,95%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Pepsico Inc. (US7134481081)	Getränkeherstellung	0,92%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
General Mills Inc. (US3703341046)	Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	0,82%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Canadian Imperial Bank of Commerce Ltd. (CA1360691010)	Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	0,81%	Kanada
Robert Half International Inc. (US7703231032)	Vermittlung und Überlassung von Arbeitskräften	0,81%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)
Bank of Nova Scotia (CA0641491075)	Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	0,77%	Kanada

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Italy BTP (IT0004848831)	Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialvers.	0,74%	Italien
Vivendi SA (FR0000127771)	Medien; Filmbranche; Kinos; Musikverlage	0,71%	Frankreich
Loblaw Companies Ltd. (CA5394811015)	Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	0,69%	Kanada
AbbVie Inc. (US00287Y1091)	Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	0,68%	USA (Vereinigte Staaten von Amerika)



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

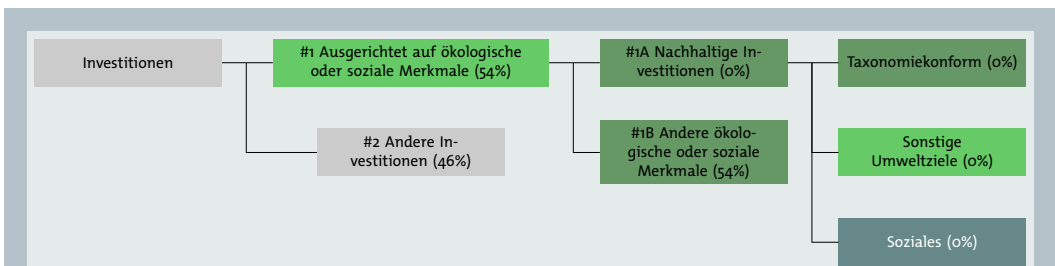
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensgegenstände des Fonds werden in nachstehender Grafik in verschiedene Kategorien unterteilt. Der jeweilige Anteil am Fondsvermögen wird in Prozent dargestellt. Mit „Investitionen“ werden alle für den Fonds erwerbbaaren Vermögensgegenstände erfasst.

Die Kategorie „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst diejenigen Vermögensgegenstände, die im Rahmen der Anlagestrategie zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt werden.

Die Kategorie „#2 Andere Investitionen“ umfasst z. B. Derivate, Bankguthaben oder Finanzinstrumente, für die nicht genügend Daten vorliegen, um sie für die nachhaltige Anlagestrategie des Fonds bewerten zu können.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Es wird für alle Positionen des Wertpapiervermögens der Durchschnitt der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage je Wirtschaftssektor gebildet. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

Angaben nach Art. 54 RTS ("[...] zum Anteil der Investitionen während des Berichtszeitraums in verschiedenen Sektoren und Teilsektoren, darunter auch Sektoren und Teilsektoren der Wirtschaft, die Einkünfte aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Herstellung, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel von fossilen Brennstoffen gemäß der Begriffsbestimmung in Artikel 2 Nummer 62 der Verordnung (EU) 2018/1999 des Europäischen Parlaments und des Rates erzielen.") sind nicht möglich, da aktuell der NACE-Code und nicht der NACE-Klassencode systemseitig geführt wird.

Branche	Anteil
Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	6,88%
Verlagswesen	6,49%
Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	5,44%
Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialvers.	4,16%
Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	4,01%
Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	3,47%
Herstellung von elektron. und opt. Erzeugnissen	2,67%
Telekommunikation	2,67%
Beteiligungsgesellschaften	1,99%
Gesundheitswesen	1,95%
Herstellung von chemischen Erzeugnissen	1,75%
Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	1,72%
Nichtlebensversicherungen	1,44%
Großhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	1,25%
Getränkeherstellung	1,13%
Informationsdienstleistungen	1,11%
Herstellung von sonstigen Waren	1,07%
Vermittlung und Überlassung von Arbeitskräften	1,04%
Maschinenbau	1,01%
Werbung und Marktforschung	0,95%
Lebensversicherungen	0,92%
Architektur- und Ingenieurbüros; Untersuchungslab.	0,91%
Dienstleistungen der Informationstechnologie	0,88%
Energieversorgung	0,74%
Medien; Filmbranche; Kinos; Musikverlage	0,71%
Erbringung von wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,65%
Erbringung von sonstigen Finanzdienstleistungen	0,64%
Landverkehr und Transport in Rohrfernleitungen	0,57%
Herstellung von Gummi- und Kunststoffwaren	0,52%
Tiefbau	0,50%
Herstellung von Metallerzeugnissen	0,50%
Herstellung von elektrischen Ausrüstungen	0,49%

Branche	Anteil
Herstellung von Leder, Lederwaren und Schuhen	0,41%
Herstellung von Kraftwagen und Kraftwagenteilen	0,38%
Gastronomie	0,38%
Rechts- und Steuerberatung, Wirtschaftsprüfung	0,36%
Rückversicherungen	0,36%
Herstellung von Druckerzeugnissen; Kopierwerke	0,36%
Post-, Kurier- und Expressdienste	0,34%
Grundstücks- und Wohnungswesen	0,34%
Effekten- und Warenbörsen	0,34%
Forschung und Entwicklung	0,25%
Unternehmensberatung	0,24%
Glas, Glaswaren, Keramik, Verarb. von Steinen Erd.	0,24%
Handel mit Kfz; Instandhaltung und Reparatur	0,22%
Lagerei sowie Dienstleistungen für den Verkehr	0,21%
Sonstiger Fahrzeugbau	0,19%
Herstellung von Textilien	0,11%
Vermietung von beweglichen Sachen	0,11%
Spiel-, Wett- und Lotteriewesen	0,10%
Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,05%



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hat keine nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel nach EU-Taxonomieverordnung getätigt. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

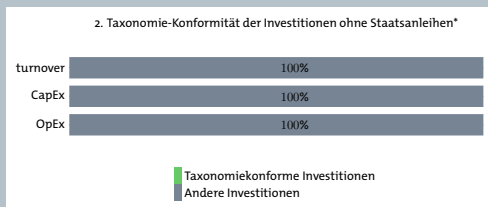
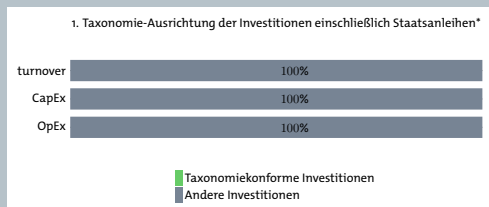
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Für diesen Fonds wurden keine Investitionen getätigt, die in Übergangstätigkeiten oder ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter #2 „Andere Investitionen“ fielen Investitionen, die nicht zu ökologischen oder sozialen Merkmalen beitragen. Hierunter fallen beispielsweise Derivate, Investitionen zu Diversifikationszwecken, Investitionen, für die keine Daten vorliegen, oder Barmittel zur Liquiditätssteuerung. Beim Erwerb dieser Vermögensgegenstände wurde mit Ausnahme der Mindestausschlüsse, welche für Investitionen zu Diversifikationszwecke greifen, kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Fonds wendete Ausschlusskriterien an und steuerte darüber hinaus nach einer ESG-Strategie („Best-in-Class“).

Investitionen in Unternehmen, die gegen den UN-Global Compact verstoßen, galten als nicht investierbar. Abgedeckt wurden in diesem Zusammenhang auch die Themenbereiche Zwangsarbeit, Kinderarbeit und Diskriminierung. Als Bewertungsrichtlinien für Kontroversen im Bereich der Umweltprobleme wurden u.a. das Prinzip der besten verfügbaren Technik (BVT) sowie internationale Umweltgesetzgebungen herangezogen. Investitionen in Unternehmen, die im Zusammenhang mit geächteten Waffen (gemäß „Ottawa-Konvention“, „OsloKonvention“ und den UN-Konventionen „UN BWC“, „UN CWC“) standen, wurden nicht getätigt. Bei Investitionen in Staaten wurden Länder mit einer niedrigen Nachhaltigkeitsbewertung ausgeschlossen. Dimensionen der Bewertung umfassten Umwelt-, Soziale- und Regierungsaktivitäten, die internationalen Konventionen und Normen entsprechen. Hierfür wurde eine Analyse relevanter Kontroversen, wie beispielsweise Korruption, Umweltverschmutzung oder Meinungsfreiheit zu Grunde gelegt. Staaten, die gegen globale Normen wie den „Freedom House Index“ verstoßen, wurden zudem ausgeschlossen. Investitionen in Unternehmen, die einen signifikanten Umsatzanteil aus der Gewinnung oder Verstromung von Kohle oder Ölsanden generieren, wurden ausgeschlossen.

Die Anlagestrategie diente als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt wurden.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

Steuerliche Behandlung

Mit Inkrafttreten des neuen Meldeschemas (ab 06.06.2016) wird die steuerliche Behandlung von der Österreichischen Kontrollbank (OeKB) erstellt und auf www.profitweb.at veröffentlicht. Die Steuerdateien stehen für sämtliche Fonds zum Download zur Verfügung. Hinsichtlich Detailangaben zu den anrechenbaren bzw. rückerstattbaren ausländischen Steuern verweisen wir auf die Homepage www.profitweb.at

Berechnungsmethode des Gesamtrisikos: Value-at-Risk

Vergleichsvermögen: 100 % MSCI World

Risikomodell:

Multi-Faktor-Modell mit Monte Carlo Simulation

relativ zum Vergleichsvermögen:

Minimum VaR: 3,92 %

Durchschnitt VaR: 5,85 %

Maximum VaR: 12,94 %

Angaben nach Art. 11 Offenlegungsverordnung

Bei der Titelauswahl wurde unter Anwendung einer individuellen ESG-Strategie Investitionen mit nachhaltigem Fokus bevorzugt ausgewählt. Die Bewertung der sozialen und ökologischen Merkmale der Investitionen basiert auf Informationen von spezialisierten externen Datenanbietern sowie auf eigenen Analysen, die von internen Analysten durchgeführt werden. Die Zusammensetzung des Portfolios sowie die ESG-Scores, Ausschlüsse und sonstiger Nachhaltigkeitsfaktoren der zugrundeliegenden Vermögenswerte werden sowohl bei der Investitionsentscheidung als auch kontinuierlich überprüft.

Der erste Schritt der Operationalisierung erfolgte in Form der Begrenzung von ESG-relevanten Risiken und Kontroversen durch das ESG-Committee. Dieses nutzt hierzu neben individuellen Analysen zusätzlich Informationen von spezialisierten, externen Dienstleistern. Relevante Faktoren und Informationen sind u.a. ESG-Ratings, Informationen zu kontroversen

Waffen, Menschenrechten, Arbeitsnormen, Umweltbelangen und zur Korruptionsprävention (UN Global Compact Kriterien). Auf Basis dieser Informationen wurden für die verschiedenen Asset Klassen Ausschlusslisten und Schwellenwerte für zulässige Nachhaltigkeitsrisiken und entsprechende Kontroversen definiert.

Aus der Kombination der vorgenannten Vorgaben hat die Gesellschaft in einem zweiten Schritt einen umfangreichen Filterkatalog entwickelt, welcher auf die getätigten Investitionen angewendet wird. Durch den konsequenten Ausschluss von negativ bewerteten Titeln sowie einer Würdigung von ESG-Scores wurde das zulässige Investmentuniversum definiert und Investitionen in Titel mit hohem Nachhaltigkeitsrisiko verhindert oder begrenzt.

Bei der Titelauswahl wurden neben marktbedingten Rendite- und risikorelevanten Faktoren auch Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt. Dazu folgte der Investmentprozess einem quantitativen Handelsansatz unter gleichzeitiger adäquater Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsfaktoren. Die Titelselektion erfolgte nach einem Best-in-Class-Ansatz mit Fokus auf ökologische, soziale und Kriterien der guten Unternehmensführung sowie zusätzlichen grundsätzlichen Ausschlusskriterien, welche sich nach dem österreichischen Umweltzeichen und dem FNG Siegel orientierten.

Die Vorgaben werden in den im Investmentprozess genutzten Tools integriert, welche auch zur Überwachung der Restriktionen des Anlageuniversums verwendet werden. Die Zusammensetzung des Portfolios sowie die ESG-Scores, Ausschlüsse und sonstiger Nachhaltigkeitsfaktoren der zugrundeliegenden Vermögenswerte werden sowohl bei der Investitionsentscheidung als auch kontinuierlich überprüft.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Fondsbestimmungen gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den **C-QUADRAT ARTS Total Return ESG**, Miteigentumsfonds gemäß **Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**, wurden von der Finanzmarktaufsicht (FMA) genehmigt.

Der Investmentfonds ist ein Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren (OGAW) und wird von der Ampega Investment GmbH (nachstehend „Verwaltungsgesellschaft“ genannt) mit Sitz in Köln/Deutschland verwaltet.

Artikel 1 Miteigentumsanteile

Die Miteigentumsanteile werden durch Anteilscheine (Zertifikate) mit Wertpapiercharakter verkörpert, die auf Inhaber lauten.

Die Anteilscheine werden in Sammelurkunden je Anteilsgattung dargestellt. Effektive Stücke können daher nicht ausgefolgt werden.

Artikel 2 Depotbank (Verwahrstelle)

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die Raiffeisen Bank International AG, Wien. Zahlstellen für Anteilscheine sind die Depotbank (Verwahrstelle) und ihre Filialen oder sonstige im Prospekt genannte Zahlstellen.

Artikel 3 Veranlagungsinstrumente und -grundsätze

Der Fonds verfolgt eine aktive Managementstrategie und orientiert sich an keiner Benchmark. Es wird vielmehr, auf langfristige Sicht gesehen, angestrebt einen absoluten Wertzuwachs nach ethisch-nachhaltigen Veranlagungskriterien zu erwirtschaften.

Für den Investmentfonds dürfen nachstehende Vermögenswerte nach Maßgabe des InvFG ausgewählt werden.

Beschreibung des Veranlagungsschwerpunktes

Der Investmentfonds veranlagt zumindest **51 vH** des Fondsvermögens in Wertpapiere, welche die Kriterien eines ESG konformen Investments erfüllen müssen. Anteile an Investmentfonds dürfen bis zu **10 vH** erworben werden, wenn die für den Fonds erwerbbaaren Vermögensgegenstände im Einklang mit den für Direktanlagen geltenden Anlagevorschriften stehen. Die nachfolgenden Veranlagungsinstrumente werden unter Einhaltung des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunktes für das Fondsvermögen erworben.

3.1. Wertpapiere

Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) dürfen bis zu **100 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.2. Geldmarktinstrumente

Geldmarktinstrumente dürfen bis zu **49 vH** des Fondsvermögens erworben werden..

3.3. Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist zulässig.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen.

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

3.4. Anteile an Investmentfonds

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen **jeweils bis zu 10 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt bis zu 10 vH des Fondsvermögens** erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr als **10 vH** des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

3.5. Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens (Berechnung nach Marktpreisen) und zur Absicherung eingesetzt werden.

3.6. Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Value at Risk

Der VaR-Wert wird gemäß dem 4. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV idgF ermittelt.

Relativer VaR

Der zuordenbare Risikobetrag für das Gesamtrisiko, ermittelt als Value-at-Risk-Wert von im Fonds getätigten Veranlagungen, ist auf maximal **das Zweifache** des VaR eines Referenzportfolios, welches den Anforderungen des § 16 Abs. 2 der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV idgF. entspricht, begrenzt.

3.7. Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten dürfen **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens gehalten werden.

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

Im Rahmen von Umschichtungen des Fondsportfolios und/oder der begründeten Annahme drohender Verluste bei Wertpapieren kann der Investmentfonds den Anteil an Wertpapieren unterschreiten und einen höheren Anteil an Sichteinlagen oder kündbaren Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten aufweisen.

3.8. Vorübergehend aufgenommene Kredite

Die Verwaltungsgesellschaft darf für Rechnung des Investmentfonds vorübergehend Kredite **bis zur Höhe von 10 vH** des Fondsvermögens aufnehmen.

3.9. Pensionsgeschäfte

Nicht anwendbar.

3.10. Wertpapierleihe

Nicht anwendbar.

Der Erwerb von Veranlagungsinstrumenten ist nur einheitlich für den ganzen Investmentfonds und nicht für eine einzelne Anteilsgattung oder eine Gruppe von Anteilsgattungen zulässig. Dies gilt jedoch nicht für Währungssicherungsgeschäfte. Diese können auch ausschließlich zugunsten einer einzigen Anteilsgattung abgeschlossen werden. Ausgaben und Einnahmen aufgrund eines Währungssicherungsgeschäfts werden ausschließlich der betreffenden Anteilsgattung zugeordnet.

Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

Der Wert der Anteile wird bankarbeitstäglich ermittelt.

4.1. Ausgabe und Ausgabeaufschlag

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 5,00 vH** zur Deckung der Ausgabekosten der Verwaltungsgesellschaft, aufgerundet auf den nächsten Cent. Für die retrofreien Anteilsklassen „H“ und „IH“ sowie für die Anteilklasse „I“ wird kein Ausgabeaufschlag erhoben.

Die Ausgabe der Anteile ist grundsätzlich nicht beschränkt, die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch vor, die Ausgabe von Anteilscheinen vorübergehend oder vollständig einzustellen.

4.2. Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Es wird kein Rücknahmeabschlag verrechnet. Der Rücknahmepreis ergibt sich aus dem Anteilswert abgerundet auf den nächsten Cent.

Auf Verlangen eines Anteilinhabers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis gegen Rückgabe des Anteilscheines ausbezahlt.

Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds ist die Zeit vom 01.01. bis zum 31.12.

Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

Für den Investmentfonds können sowohl Ausschüttungsanteilscheine und Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung, und zwar jeweils über ein Stück oder Bruchteile davon, ausgegeben werden.

Für diesen Investmentfonds können verschiedene Gattungen von Anteilscheinen ausgegeben werden. Die Bildung der Anteilsgattungen sowie die Ausgabe von Anteilen einer Anteilsgattung liegen im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft.

Ertragnisverwendung bei Ausschüttungsanteilscheinen (Ausschütter)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge (Zinsen und Dividenden) können nach Deckung der Kosten nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft ausgeschüttet werden. Eine Ausschüttung kann unter Berücksichtigung der Interessen der Anteilinhaber unterbleiben. Ebenso steht die Ausschüttung von Erträgen aus der Veräußerung von Vermögenswerten des Investmentfonds einschließlich von Bezugsrechten im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft. Eine Ausschüttung aus der Fondssubstanz sowie Zwischenausschüttungen sind zulässig. Das Fondsvermögen darf durch Ausschüttungen in keinem Fall das im Gesetz vorgesehene Mindestvolumen für eine Kündigung unterschreiten.

Die Beträge sind an die Inhaber von Ausschüttungsanteilscheinen ab 30.04. des folgenden Rechnungsjahres auszuschütten, der Rest wird auf neue Rechnung vorgetragen.

Jedenfalls ist ab dem 30.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag ausbezahlt, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 30.04. der gemäß InvFG ermittelte Betrag ausbezahlt, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschüttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen. Der für das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gemäß InvFG maßgebliche Zeitpunkt ist jeweils der 30.04. des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotführenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden können, die entweder nicht der inländischen Einkommen- oder Körperschaftssteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen für eine Befreiung gemäß § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. für eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen. Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfüllt, ist der gemäß InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotführenden Kreditinstituts auszuführen.

Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer Auslandstranche)

Der Vertrieb der Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung erfolgt ausschließlich im Ausland. Die während des Rechnungsjahres vereinnahmten Erträge nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschüttet. Es wird keine Auszahlung gemäß InvFG vorgenommen.

Artikel 7 Verwaltungsgebühr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Verwaltungstätigkeit eine jährliche Vergütung bis zu einer Höhe von **2,00 vH** p.a. des Fondsvermögens, die auf Grund der Monatsendwerte errechnet wird. Es liegt im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Staffelung dieser Vergütung vorzunehmen.

Zusätzlich erhält die Verwaltungsgesellschaft monatlich eine variable Verwaltungsgebühr (Performancefee, erfolgsabhängige Vergütung) in Höhe von **20 vH** der Nettoperformance (= Wertentwicklung des Anteilswertes) gegenüber der sogenannten „High-Water-Mark“. Die „High-Water-Mark“ entspricht jenem Anteilswert zum Ende jenes vergangenen Monats, zu dem zuletzt eine Performancefee ausbezahlt wurde und wird auf Basis des durchschnittlichen Fondsvolumens laufend abgegrenzt und beeinflusst erfolgswirksam den ermittelten Rechenwert. Bei der Berechnung wird die Anzahl der sich am Ende des relevanten Monats im Umlauf befindlichen Anteile in Betracht gezogen.

Für Anteilklassen mit der Bezeichnung "I" und "IH" wird keine variable Verwaltungsgebühr (Performancefee, erfolgsabhängige Vergütung) erhoben.

Die Kosten bei Einführung neuer Anteilsgattungen für bestehende Sondervermögen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhält die abwickelnde Stelle eine Vergütung von **0,50 vH** des Fondsvermögens.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen.

Nähere Angaben und Erläuterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.

Anhang

Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

1. Börsen mit amtlichem Handel und organisierten Märkten in den Mitgliedstaaten des EWR sowie Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR, die als gleichwertig mit geregelten Märkten gelten

Jeder Mitgliedstaat hat ein aktuelles Verzeichnis der von ihm genehmigten Märkte zu führen. Dieses Verzeichnis ist den anderen Mitgliedstaaten und der Kommission zu übermitteln.

Die Kommission ist gemäß dieser Bestimmung verpflichtet, einmal jährlich ein Verzeichnis der ihr mitgeteilten geregelten Märkte zu veröffentlichen.

Infolge verringerter Zugangsschranken und der Spezialisierung in Handelssegmente ist das Verzeichnis der „geregelten Märkte“ größeren Veränderungen unterworfen. Die Kommission wird daher neben der jährlichen Veröffentlichung eines Verzeichnisses im Amtsblatt der Europäischen Union eine aktualisierte Fassung auf ihrer offiziellen Internetseite zugänglich machen.

- 1.1. Das aktuell gültige Verzeichnis der geregelten Märkte finden Sie unter https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg ¹⁾
- 1.2. Folgende Börsen sind unter das Verzeichnis der geregelten Märkte zu subsumieren:
 - 1.2.1. Luxemburg: Euro MTF Luxemburg
- 1.3. Gemäß § 67 Abs. 2 Z2 InvFG anerkannte Märkte im EWR:
Märkte im EWR, die von den jeweils zuständigen Aufsichtsbehörden als anerkannte Märkte eingestuft werden.

2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR

- 2.1. Bosnien Herzegowina: Sarajevo, Banja Luka
- 2.2. Montenegro: Podgorica
- 2.3. Russland: Moskau Exchange
- 2.4. Schweiz: SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG
- 2.5. Serbien: Belgrad
- 2.6. Türkei: Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")
- 2.7. Großbritannien: Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange

3. Börsen in außereuropäischen Ländern

3.1.	Australien:	Sydney, Hobart, Melbourne, Perth
3.2.	Argentinien:	Buenos Aires
3.3.	Brasilien:	Rio de Janeiro, Sao Paulo
3.4.	Chile:	Santiago
3.5.	China:	Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange
3.6.	Hongkong:	Hongkong Stock Exchange
3.7.	Indien:	Mumbai
3.8.	Indonien:	Jakarta
3.9.	Israel:	Tel Aviv
3.10.	Japan:	Tokyo, Osaka, Nagoya, Fukuoka, Sapporo
3.11.	Kanada:	Toronto, Vancouver, Montreal
3.12.	Kolumbien:	Bolsa de Valores de Colombia
3.13.	Korea:	Korea Exchange (Seoul, Busan)
3.14.	Malaysia:	Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad
3.15.	Mexiko:	Mexico City
3.16.	Neuseeland:	Wellington, Auckland
3.17.	Peru:	Bolsa de Valores de Lima
3.18.	Philippinen:	Philippine Stock Exchange
3.19.	Singapur:	Singapur Stock Exchange
3.20.	Südafrika:	Johannesburg
3.21.	Taiwan:	Taipeh
3.22.	Thailand:	Bangkok
3.23.	USA:	New York, NYCE American, New York Stock Exchange (NYSE), Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati, Nasdaq
3.24.	Venezuela:	Caracas
3.25.	Vereinigte Arabische Emirate:	Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)

4. Organisierte Märkte in Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten der Europäischen Gemeinschaft

4.1.	Japan:	Over the Counter Market
4.2.	Kanada:	Over the Counter Market
4.3.	Korea:	Over the Counter Market
4.4.	Schweiz:	Over the Counter Market der Mitglieder der International Capital Market Association (ICMA), Zürich
4.5.	USA:	Over the Counter Market (unter behördlicher Beaufsichtigung wie z.B. durch SEC, FINRA)

¹⁾ Zum Öffnen des Verzeichnisses in der Spalte links unter „Entity Type“ die Einschränkung auf „Regulated market“ auswählen und auf „Search“ (bzw. auf „Show table columns“ und „Update“) klicken. Der Link kann durch die ESMA geändert werden. Der Link kann durch die ESMA geändert werden.

5. Börsen mit Futures und Options Märkten

- 5.1. Argentinien: Bolsa de Comercio de Buenos Aires
- 5.2. Australien: Australien Options Market, Australian Securities Exchange (ASX)
- 5.3. Brasilien: Bolsa Brasileira de Futuros, Bolsa de Mercadorias & Futuros, Rio de Janeiro Stock Exchange, Sao Paulo Stock Exchange
- 5.4. Hongkong: Hong Kong Futures Exchange Ltd.
- 5.5. Japan: Osaka Securities Exchange, Tokyo International Financial Futures Exchange, Tokyo Stock Exchange
- 5.6. Kanada: Montreal Exchange, Toronto Futures Exchange
- 5.7. Korea: Korea Exchange (KRX)
- 5.8. Mexiko: Mercado Mexicano de Derivados
- 5.9. Neuseeland: New Zealand Futures & Options Exchange
- 5.10. Philippinen: Maninal International Futures Exchange
- 5.11. Singapur: The Singapore Exchange Limited (SGX)
- 5.12. Südafrika: Johannesburg Stock Exchange (JSE), South African Futures Exchange (SAFEX)
- 5.13. Türkei: TurkDEX
- 5.14. USA: NYCE American, Chicago, Board of Trade, Chicago Mercantile Exchange, Comex, FINEX, ICE Future US Inc. New York, Nasdaq, New York Stock Exchange, Boston Options Exchange (BOX)

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 31.12.2022)
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

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