

Halbjahresbericht

C-QUADRAT ARTS Total Return Value Invest Protect

1. Dezember 2023 bis 31. Mai 2024

OGAW-Sondervermögen



Zusammensetzung des Fondsvermögens

Vermögensaufstellung zum 31.05.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 31.05.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum								
INVESTMENTZERTIFIKATE							84.909.780,10	99,53
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO							79.294.845,59	92,95
ABSALON-GLBL HIGH YL.I EO	LU1138630212	EUR	57	0	0	14.309,2700	815.628,39	0,96
ACATIS IFK VALUE RENTEN A	DE000A0X7582	EUR	178.000	178.000	0	43,1700	7.684.260,00	9,01
AM-SP GL.FI.ESG EOA	IE000KYX7IP4	EUR	116.000	116.000	0	12,8040	1.485.264,00	1,74
AMF-E.M.S.T.BD I2 HGDEOA	LU1882464198	EUR	6.960	6.960	0	1.097,0800	7.635.676,80	8,95
AMF-GBL SUB.BD I2 UH.EOD	LU1883334606	EUR	7.630	7.630	0	991,1400	7.562.398,20	8,86
APOLLO N.WRLD.MIT.THESAU	AT0000746979	EUR	12.500	12.500	0	237,0700	2.963.375,00	3,47
BNP PFI-ABS OPS IEQA	LU1815417925	EUR	3.810	3.810	0	1.697,7000	6.468.237,00	7,58
CANDR.BDS-CAP.SEC5 IEQCAP	LU1616743388	EUR	500	0	520	1.699,6800	849.840,00	1,00
DWS INV.II-GL.EQ.HI.CO.FC	LU0826453069	EUR	8.200	0	0	342,3800	2.807.516,00	3,29
GAM STAR-CR.OPPS(EQ)OA EO	IE00B567SW70	EUR	37.500	37.500	0	18,1914	682.177,50	0,80
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	EUR	8.400	16.900	8.500	182,0700	1.529.388,00	1,79
HSBC EURO CRED.SUB.BD ID	DE000A0H0RA1	EUR	5.500	5.500	0	66,9000	367.950,00	0,43
ISIV-E.MSCI E.M.U.ETF EOA	IE00BZ0PKV06	EUR	39.000	39.000	0	9,4990	370.461,00	0,43
JPM-GL.SUS.EQ.JPMGSRCD EOH	LU1420294560	EUR	7.710	8.500	790	252,6300	1.947.777,30	2,28
JPM-GLOBAL FOCUS I A. EUR	LU0248053109	EUR	6.300	0	0	451,9300	2.847.159,00	3,34
L+G-EU.EX UK EQ EOD	IE00BMYDM919	EUR	45.500	45.500	0	12,3060	559.923,00	0,66
LA FRANCAISE SUB DEB C	FR0010674978	EUR	1.650	3.320	1.670	2.328,2500	3.841.612,50	4,50
M+G(L)I1-E.S.V. CEOA	LU1670707873	EUR	134.000	134.000	0	16,1386	2.162.572,40	2,53
MAGNA UMB.FD-M.N.FR.GA EO	IE00BFTW8Z27	EUR	53.000	0	55.000	25,6120	1.357.436,00	1,59
MAN F.VI-GLG HI.Y.OP.I EO	IE00BDTYYL24	EUR	52.800	52.800	0	145,5700	7.686.096,00	9,01
MAN-GL.INV.G.OP I HGDEOA	IE000VA5W9H0	EUR	36.100	0	35.900	112,5500	4.063.055,00	4,76
NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	LU0772943501	EUR	26.000	26.000	0	202,4320	5.263.232,00	6,17
PGIS.-PIM.C.SEC. INST EOH	IE00B6VHBN16	EUR	172.000	172.000	0	14,9900	2.578.280,00	3,02
SISF EURO HIGH YIELD CAEO	LU0849400030	EUR	1.200	7.900	6.700	171,1900	205.428,00	0,24
SYCOMORE SELECTION RESP.I	FR0010971705	EUR	4.650	4.650	0	574,0600	2.669.379,00	3,13
UNISECTOR: BASICINDS A	LU0101442050	EUR	2.800	2.800	0	181,2700	507.556,00	0,59
V-T.G.W.S.F. IEQA	LU2001709976	EUR	4.250	4.250	0	273,0700	1.160.547,50	1,36
VONTOBEL-EM.MKT.DEB.HIEOH	LU0926440222	EUR	10.500	42.500	32.000	116,4400	1.222.620,00	1,43
INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR							5.614.934,51	6,58
JPM-AMERICA EQ.JPMAE IADL	LU0248041781	USD	950	950	0	486,0400	425.918,27	0,50
SPDR MSCI WORLD FINANC.UE	IE00BYTRR970	USD	20.200	20.200	0	63,7000	1.186.920,03	1,39
SPDR MSCI WORLD INDUST.UE	IE00BYTRRC02	USD	33.300	42.800	9.500	66,1250	2.031.143,34	2,38
T.ROW.PR.-US EQU.F.QACCDL	LU1521982055	USD	50.000	50.000	0	25,7000	1.185.315,01	1,39
T.ROWE P.-FRON.MK.EQ.Q DL	LU1079764939	USD	53.000	53.000	0	16,0700	785.637,86	0,92
BANKGUTHABEN							495.024,37	0,58
EUR-Guthaben							495.024,37	0,58
EUR-Guthaben							495.024,37	0,58
ABGRENZUNGEN							-94.596,56	-0,11
DIVERSE GEBÜHREN							-125.309,59	-0,15
ZINSENANSPRÜCHE							30.713,03	0,04
Fondsvermögen						EUR	85.310.207,91	100,00¹⁾
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot. (VTH) IA						EUR	135,37	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot.(VTH) IA H						EUR	105,34	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot. (VTH) IA						STK	630.150,206	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Tot. Ret. Val. Inv. Prot.(VTH) IA H						STK	60,000	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz) per 29.05.2024

Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,08410	= 1 (EUR)

Risikohinweis

Es besteht das Risiko, dass aufgrund von Kursbildungen auf illiquiden Märkten die Bewertungskurse bestimmter Wertpapiere von ihren tatsächlichen Veräußerungen abweichen können (Bewertungsrisiko).

Der Wert eines Anteiles ergibt sich aus der Teilung des Gesamtwertes des Kapitalanlagefonds einschließlich der Erträge durch die Zahl der Anteile. Der Gesamtwert des Kapitalanlagefonds ist aufgrund der jeweiligen Kurswerte der zu ihm gehörigen Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Bezugsrechte zuzüglich des Wertes der zum Fonds gehörenden Finanzanlagen, Geldbeträge, Guthaben, Forderungen und sonstigen Rechte abzüglich Verbindlichkeiten, von der Depotbank zu ermitteln.

Das Nettovermögen wird nach folgenden Grundsätzen ermittelt:

a) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird grundsätzlich auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt.

b) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für einen Vermögenswert, welcher an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, der Kurs den tatsächlichen Marktwert nicht angemessen widerspiegelt, wird auf die Kurse zuverlässiger Datenprovider oder alternativ auf Marktpreise gleichartiger Wertpapiere oder andere anerkannte Bewertungsmethoden zurückgegriffen.

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO				
AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH	LU1699968225	EUR	0	234.000
AMUNDI EO L.RAT.SRI ICAP3	FR0007038138	EUR	0	8
BL.STR.-B.EM.MK.SH.D.D2EH	LU1706560163	EUR	0	40.500
BLUEBAY-I.G.ABS.RTN B.IEO	LU0627763740	EUR	0	6.600
BNY MGF-E.M.CORP.DEBT.CEO	IE00B4LXKS30	EUR	6.400	6.400
DNCA INV.-ALPHA BDS I EO	LU1694789378	EUR	0	27.000
EDRF-BIG DATA I EO	LU1244894231	EUR	0	1.090
FID.FDS-EO CORP.BDS YA EO	LU0370787359	EUR	154.000	154.000
FID.FDS-EURO BOND Y AC.EO	LU0346390197	EUR	325.000	325.000
GSF-EM.M.DEB.L.PTF.I A EO	LU0494455123	EUR	0	224.000
ISHSII-DJ GL.SUST.SCR.DLA	IE00B57X3V84	EUR	24.300	42.000
ISHSII-FTSE MIB EO DIS	IE00B1XNH568	EUR	29.000	29.000
ISHSV-EM DIVID.U.ETF DLD	IE00B652H904	EUR	91.000	91.000
ISIV-MWMFEETF DLA	IE000L5NW549	EUR	395.000	395.000
JPM-EO.H.Y SH.DUR.B CAEO	LU1533169881	EUR	0	8.000
JPM.FDS-US HED.EQ.CACCEOH	LU1297691492	EUR	0	11.200
KATHREIN YIELD + I T	AT0000A1H542	EUR	0	18.600
LA FRANCAISE-TRESORERIE I	FR0010609115	EUR	0	73
LIF-600 MEDIA EOA	LU1834988195	EUR	32.200	42.800
LOF-UL.LO.DU.(EO)EONUHACC	LU1230566041	EUR	0	360.000
MSI-EUR.HIGH YIELD BD ZEO	LU0360481153	EUR	0	4.600

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
NEUB.BERM.-EUR.H.Y.FOIAUN	IE00BNH72V92	EUR	150.000	150.000
NORDEA 1-EUR.H.YLD BI-EUR	LU0141799097	EUR	0	108.000
SISF EURO LIQUIDITY C ACC	LU0136043634	EUR	0	32.000
SISF-GL.CR.H.INC.CACC.EOH	LU0903425766	EUR	20.400	20.400
SPDR M.W.V. UNHEDGEDDLA	IE00BJXRT813	EUR	0	21.300
SPDR MSCI EUR.CO.SER.UETF	IE00BKWQ0N82	EUR	0	34.000
T.ROWE P-EUR.HY BD QAEO	LU1032541671	EUR	237.000	317.000
UBAM-DYNAMIC EURO BD I CP	LU0132662635	EUR	0	18.900
WMF(I)-W.EO HI.YI.BD SUNH	IE00BJRHVH04	EUR	553.000	553.000
XTR.SPAIN 1CEO	LU0592216393	EUR	47.000	47.000
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR				
AIS-A.MSCI USA M.V.F.UEDL	LU1589349734	USD	0	10.700
GS-INDIA EQUITY I ACC DL	LU0333811072	USD	0	69.500

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.

Erfolgsabhängige Vergütung im Berichtszeitraum

Für alle Anteilklassen wird gemäß der Fondsbestimmungen eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Value Invest Protect (VTH) IA H wurde eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 33,12 EUR (0,524 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Während der Berichtsperiode wurden für die weitere Anteilklasse keine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben.

Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Verwaltungsgesellschaft

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Postfach 10 16 65
50456 Köln
Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729

Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 31.05.2024)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Geschäftsführung

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

Dr. Dirk Erdmann
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Stefan Kampmeyer
Mitglied der Geschäftsführung der
Ampega Asset Management GmbH, Köln

Jürgen Meyer

Djam Mohebbi-Ahari

Aufsichtsrat

Dr. Jan Wicke, Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover

Clemens Jungsthöfel, stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der Hannover Rück SE, Hannover

Jens Hagemann
Dipl.-Kaufmann, München

Dr. Christian Hermelingmeier
Mitglied des Vorstands der HDI Global SE, Hannover

Sven Lixenfeld
Mitglied des Vorstands der HDI Deutschland AG, Düsseldorf

Fondsmanagement

ARTS Asset Management GmbH
Schottenfeldgasse 20
1070 Wien
Österreich

Depotbank

Raiffeisen Bank International AG
Am Stadtpark 3
1030 Wien
Österreich

Vertriebsstellen

Neben der Depotbank/Verwahrstelle können weitere Vertriebsstellen benannt werden

Abschlussprüfer

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH
Renngasse 1/Freyung
1010 Wien
Österreich



Ampega Investment GmbH
Postfach 10 16 65, 50456 Köln, Deutschland

Fon +49 (221) 790 799-799
Fax +49 (221) 790 799-729
Email fonds@ampega.com
Web www.ampega.com