

# Halbjahresbericht

1. Januar 2024 bis 30. Juni 2024

## C-QUADRAT ARTS Total Return Bond

OGAW-Sondervermögen

**ampega.**

Talanx Investment Group



# Zusammensetzung des Fondsvermögens

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
						im Berichtszeitraum		
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>							<b>115.602.164,91</b>	<b>99,34</b>
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>							<b>103.129.419,42</b>	<b>88,62</b>
AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH	LU1699968225	EUR	300.000	300.000	365.000	16,5800	4.974.000,00	4,27
ABSALON-GLBL HIGH YL.I EO	LU1138630212	EUR	351	274	0	14.346,9900	5.035.793,49	4,33
ACATIS IFK VALUE RENTEN A	DE000A0X7582	EUR	232.000	232.000	0	43,3900	10.066.480,00	8,65
AF-ORYIE.SH.T. I2 UH.EOA	LU1883339746	EUR	4.950	0	0	1.101,0500	5.450.197,50	4,68
AF-PI.GL.H.Y.BD I2 UH.EOA	LU1883837004	EUR	151	610	459	2.516,3500	379.968,85	0,33
AMF-E.M.S.T.BD I2 HGDEOA	LU1882464198	EUR	6.280	6.280	0	1.106,3600	6.947.940,80	5,97
AMF-GBL SUB.BD I2 UH.EOD	LU1883334606	EUR	13.690	13.690	0	995,8900	13.633.734,10	11,72
AMPEGA CR.OPPS R.FDS I(A)	DE000A2QFHD8	EUR	10.000	0	0	95,6000	956.000,00	0,82
APOLLO N.WRLD.MIT.THESAU	AT0000746979	EUR	10.700	21.600	10.900	238,3700	2.550.559,00	2,19
ASS.CR.-A.C.SUBD.A.COCC I	LU0990655838	EUR	4.520	4.000	5.080	891,6500	4.030.258,00	3,46
BNP PFI-ABS OPS IEOA	LU1815417925	EUR	1.140	1.140	0	1.710,3400	1.949.787,60	1,68
LO-ASIA VALUE BOND EOPSHC	LU1480986204	EUR	11.600	11.600	0	114,5983	1.329.340,28	1,14
MAN F.VI-GLG HI.Y.OP.I EO	IE00BDTYYL24	EUR	79.000	79.000	0	146,6600	11.586.140,00	9,96
MAN-GL.INV.G.OP I HGDEOA	IE000VA5W9H0	EUR	136.000	0	25.000	114,6000	15.585.600,00	13,39
NEUB.BERM.-EUR.H.Y.EOIAUN	IE00BNH72V92	EUR	151.000	0	469.000	14,5100	2.191.010,00	1,88
NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	LU0772943501	EUR	78.000	0	0	203,1931	15.849.061,80	13,62
VONTOBEL-EM.MKT.DEB.HIEOH	LU0926440222	EUR	5.200	42.500	37.300	117,9900	613.548,00	0,53
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR</b>							<b>2.349.701,27</b>	<b>2,02</b>
FTIF-FR.GULF WLTH BD AADL	LU0962741061	USD	150.000	150.000	0	16,7800	2.349.701,27	2,02
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE BRITISCHE PFUND</b>							<b>10.123.044,22</b>	<b>8,70</b>
SPDR B.O-5Y.LS C.B.UETF	IE00BCBJF711	GBP	295.000	295.000	0	29,0600	10.123.044,22	8,70
<b>DEVISENTERMINGESCHAEFTE</b>							<b>-58.921,27</b>	<b>-0,05</b>
DTG EUR CZK 05.07.24	DTG178931	EUR	-747.064	0	747.064	25,0075	-10.606,52	-0,01
DTG EUR PLN 05.07.24	DTG178925	EUR	-12.480.036	0	12.480.036	4,3181	-48.314,75	-0,04
<b>BANKGUTHABEN</b>							<b>990.930,13</b>	<b>0,85</b>
<b>EUR-Guthaben</b>							<b>989.119,68</b>	<b>0,85</b>
EUR-Guthaben							989.119,68	0,85
<b>GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAHRUNGEN</b>							<b>1.810,45</b>	<b>0,00</b>
CZK							1.039,88	0,00
PLN							770,57	0,00
<b>ABGRENZUNGEN</b>							<b>-164.381,77</b>	<b>-0,14</b>
DIVERSE GEBÜHREN							-174.666,77	-0,15
FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN							2.098,28	0,00
ZINSENANSPRÜCHE							8.186,72	0,01
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>116.369.792,00</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)						EUR	146,98	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)						EUR	194,01	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I						EUR	208,41	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A						EUR	208,27	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN						PLN	892,70	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H						PLN	138,58	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK						CZK	1.210,84	
Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre						EUR	110,93	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS)						STK	36.694,560	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH)						STK	270.505,923	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I						STK	2.757,070	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A						STK	44.418,858	

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Bestand 30.06.2024	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN						STK	29.350,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H						STK	376.700,000	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK						STK	15.247,108	
Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofe						STK	268.309,147	

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

### Devisenkurse (in Mengennotiz) per 27.06.2024

Britische Pfund	(GBP)	0,84685	= 1 (EUR)
Euro	(EUR)	1,00000	= 1 (EUR)
Polnische Zloty	(PLN)	4,31665	= 1 (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	25,00300	= 1 (EUR)
US Dollar	(USD)	1,07120	= 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 gehörenden 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:

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

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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
<b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>				
BNY MGF-E.M.CORP.DEBT.CEO	IE00B4LXKS30	EUR	6.900	6.900
DWS I.-SH.DUR.CREDIT FC	LU0236146428	EUR	0	8.900
DWS I.EO HY CORP. FC	LU0616840772	EUR	0	3.700
EDR-FINL BDS I EUR	FR0010584474	EUR	0	7.300
FID.FDS-EO CORP.BDS YA EO	LU0370787359	EUR	0	154.000
FID.FDS-EURO BOND Y AC.EO	LU0346390197	EUR	0	325.000
GBL EVOL.F.-FRON.MKTS I	LU0501220262	EUR	38.000	38.000
GSF-EM.M.DEB.L.PTF.I A EO	LU0494455123	EUR	0	24.400

## 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
ISHSIV - ISH.CHIN.BD.U.ET	IE00BYPC1H27	EUR	920.000	920.000
LA FRANCAISE SUB DEB C	FR0010674978	EUR	0	2.130
MSI-EUR.HIGH YIELD BD ZEO	LU0360481153	EUR	0	3.250
NORDEA 1-EME.MKT BD BIEUR	LU0772925276	EUR	0	14.500
NORDEA 1-EUR.H.YLD BI-EUR	LU0141799097	EUR	0	104.000
PFGIS.-PIM.C.SEC. INSTEOH	IE00B6VHBN16	EUR	0	501.000
PIMCO GL I.-G.HY B.AI EOH	IE00B2R34Y72	EUR	0	166.000
SISF EURO HIGH YIELD CAEO	LU0849400030	EUR	4.550	4.550
SISF-GL.CR.H.INC.CACC.EOH	LU0903425766	EUR	0	15.600
T.R.PR.-EM.LOC.MKT.BD QEO	LU1127970090	EUR	0	16.700
T.ROWE P-EUR.HY BD QAEO	LU1032541671	EUR	0	200.000
WMF(I)-W.EO HI.YI.BD SUNH	IE00BJRHVH04	EUR	0	845.000

### Derivate

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
<b>DEVISENTERMINGESCHAEFTE TSCHECHISCHE KRONEN</b>				
DTG EUR CZK 01.03.24	DTG174957	CZK	16.342.000	16.342.000
DTG EUR CZK 01.03.24	DTG176021	CZK	16.342.000	16.342.000
DTG EUR CZK 02.02.24	DTG174245	CZK	16.014.000	16.014.000
DTG EUR CZK 02.02.24	DTG174956	CZK	16.014.000	16.014.000
DTG EUR CZK 05.01.24	DTG173699	CZK	0	15.528.000
DTG EUR CZK 05.01.24	DTG174244	CZK	15.528.000	15.528.000
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG176022	CZK	16.736.000	16.736.000
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG176882	CZK	893.000	893.000
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG177121	CZK	17.629.000	17.629.000
DTG EUR CZK 07.06.24	DTG177991	CZK	17.664.000	17.664.000
DTG EUR CZK 07.06.24	DTG178930	CZK	17.664.000	17.664.000
DTG EUR CZK 10.05.24	DTG177122	CZK	17.760.000	17.760.000
DTG EUR CZK 10.05.24	DTG177990	CZK	17.760.000	17.760.000
<b>DEVISENTERMINGESCHAEFTE EURO</b>				
DTG EUR CZK 01.03.24	DTG174957	EUR	657.575	657.575
DTG EUR CZK 01.03.24	DTG176021	EUR	645.980	645.980
DTG EUR CZK 02.02.24	DTG174245	EUR	648.971	648.971
DTG EUR CZK 02.02.24	DTG174956	EUR	645.388	645.388
DTG EUR CZK 05.01.24	DTG173699	EUR	632.235	0
DTG EUR CZK 05.01.24	DTG174244	EUR	630.169	630.169
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG176022	EUR	660.536	660.536
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG176882	EUR	35.344	35.344
DTG EUR CZK 05.04.24	DTG177121	EUR	696.303	696.303
DTG EUR CZK 07.06.24	DTG177991	EUR	704.499	704.499
DTG EUR CZK 07.06.24	DTG178930	EUR	716.941	716.941
DTG EUR CZK 10.05.24	DTG177122	EUR	700.628	700.628
DTG EUR CZK 10.05.24	DTG177990	EUR	708.552	708.552
DTG EUR PLN 01.03.24	DTG174963	EUR	12.384.396	12.384.396
DTG EUR PLN 01.03.24	DTG176027	EUR	12.443.631	12.443.631
DTG EUR PLN 02.02.24	DTG174239	EUR	12.243.553	12.243.553
DTG EUR PLN 02.02.24	DTG174962	EUR	12.311.973	12.311.973
DTG EUR PLN 05.01.24	DTG173703	EUR	12.043.370	0
DTG EUR PLN 05.01.24	DTG174238	EUR	12.058.371	12.058.371
DTG EUR PLN 05.04.24	DTG176028	EUR	12.374.318	12.374.318

## Derivate

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Währung	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
DTG EUR PLN 05.04.24	DTG177125	EUR	12.464.927	12.464.927
DTG EUR PLN 07.06.24	DTG177999	EUR	12.296.366	12.296.366
DTG EUR PLN 07.06.24	DTG178924	EUR	12.383.956	12.383.956
DTG EUR PLN 10.05.24	DTG177126	EUR	12.592.500	12.592.500
DTG EUR PLN 10.05.24	DTG177998	EUR	12.518.854	12.518.854
<b>DEISENTERMINGESCHAEFTE POLNISCHE ZLOTY</b>				
DTG EUR PLN 01.03.24	DTG174963	PLN	53.698.000	53.698.000
DTG EUR PLN 01.03.24	DTG176027	PLN	53.698.000	53.698.000
DTG EUR PLN 02.02.24	DTG174239	PLN	53.317.000	53.317.000
DTG EUR PLN 02.02.24	DTG174962	PLN	53.317.000	53.317.000
DTG EUR PLN 05.01.24	DTG173703	PLN	0	52.472.000
DTG EUR PLN 05.01.24	DTG174238	PLN	52.472.000	52.472.000
DTG EUR PLN 05.04.24	DTG176028	PLN	53.487.000	53.487.000
DTG EUR PLN 05.04.24	DTG177125	PLN	53.487.000	53.487.000
DTG EUR PLN 07.06.24	DTG177999	PLN	53.199.000	53.199.000
DTG EUR PLN 07.06.24	DTG178924	PLN	53.199.000	53.199.000
DTG EUR PLN 10.05.24	DTG177126	PLN	54.114.000	54.114.000
DTG EUR PLN 10.05.24	DTG177998	PLN	54.114.000	54.114.000

## Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 (SFTR)

Wertpapierleihegeschäfte iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Wertpapierleihegeschäfte wurden daher im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Pensionsgeschäfte iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds nicht eingesetzt werden. Pensionsgeschäfte wurden daher im Berichtszeitraum nicht eingesetzt.

Total Return Swaps (Gesamtrendite-Swaps) iSd Verordnung (EU) 2015/2365 (The Regulation on Transparency of Securities Financing Transactions and of Reuse) dürfen für den Fonds eingesetzt werden. Während der Berichtsperiode gab es keine Total Return Swaps.

## Erfolgsabhängige Vergütung im Berichtszeitraum

Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (AUS) wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 13.569,39 EUR ( 0,252 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 131.410,84 EUR ( 0,250 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) I wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 1330,00 EUR ( 0,231 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 24.497,14 EUR ( 0,265 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A PLN H wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 206.467,73 PLN ( 0,395 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (VTH) A CZK wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 66.426,99 CZK ( 0,360 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Bond (TTH) IT retrofre wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 97.162,50 EUR ( 0,326 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die weiteren Anteilklassen wird gemäß den Fondsbestimmungen eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben. Während der Berichtsperiode wurden für diese Anteilklassen keine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) eingehoben.

# Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

## Verwaltungsgesellschaft

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

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

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

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

Gezeichnetes Kapital: 6 Mio. EUR (Stand 30.06.2024)  
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



Überreicht durch:

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

Fon +49 (221) 790 799-799

Fax +49 (221) 790 799-729

Email [fonds@ampega.com](mailto:fonds@ampega.com)

Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)