

# „Trendfolge – erfolgreicher investieren mit Regeln statt Prognosen“

Ampega Blickwinkel  
Wien, 28. September 2023

## Chancennutzung

Gewinne laufen lassen & Verluste begrenzen

## System mit Erfahrung

Über 360 internationale Auszeichnungen seit 2003

## Hohe Flexibilität

Suche nach weltweit stärksten und stabilsten Trends



## Aktives Fondsmanagement

Entscheidungen unabhängig von einer Benchmark

## Großes Anleiheuniversum

Mehr als 1.000 Rentenfonds & ETFs zur Auswahl

## Trendfolge Systematik

Algorithmus-basierter & emotionsloser Handelsansatz

# ARTS

THE ART OF TRADING

## Marketingunterlage

Dieses Dokument dient ausschließlich zur Information von professionellen Kunden (MiFID Richtlinie 2014/65/EU Anhang II) und Vertriebspartnern und richtet sich nicht an Privatkunden.

Die angeführten Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar, da sich deren Investitionsgrad z.B. in Aktien(fonds) verändern - reduzieren oder erhöhen - kann.

Achtung: Inflation beeinflusst den Realwert Ihres Investments und schmälert die Kaufkraft Ihres Geldes!

**ARTS**  
THE ART OF TRADING



**Vorstellung**

Ein Unternehmen der C-QUADRAT Gruppe



**Mag. Leo Willert**  
Eigentümer & Head of Trading  
ARTS Asset Management



- Spezialist für **technische trendfolgende Handelssysteme**
- **Quantitative & Algorithmus** basierte **Entscheidungsfindung**
- **Eigentümergeführtes, privates** Unternehmen
- Erstes Publikumsmandat **seit 27.03.2003**
- **Verwaltetes Vermögen ca. 1,75 Milliarden EUR** (per 30.06.2023) in 13 Fonds
- Eigens entwickelte Datenbank mit **mehr als 10.000 Fonds und ETFs**
- Verarbeitung von ca. 3,5 Millionen Datensätzen pro Monat
- **Fonds im Einsatz:** Deutschland, Estland, Italien, Lettland, Litauen, Luxemburg, Österreich, Polen, Rumänien, Schweiz, Slowakei, Spanien, Tschechien, Ungarn
- Seit 2021 als **klimapositives Unternehmen** zertifiziert





## Die Rolle von Trendfolge

## 53-Jahres-Ertrag MSCI World (in EUR): + 1.209,89 % (+ 4,97 % p. a.) / 31.12.1969 – 31.12.2022



	über alle 5 Jahres-Zeitfenster	über alle 10 Jahres-Zeitfenster
Durchschnittlicher Ertrag p.a.	5,80%	6,08%
Schlechtester Ertrag	-79,01%	-76,73%
Schlechtester Ertrag p.a.	-12,35%	-5,86%
<b>Anteil negativer Perioden</b>	<b>29,29%</b>	<b>15,86%</b>

Ertrag der letzten 5 Jahre: +39,27% (+6,85% p.a.)

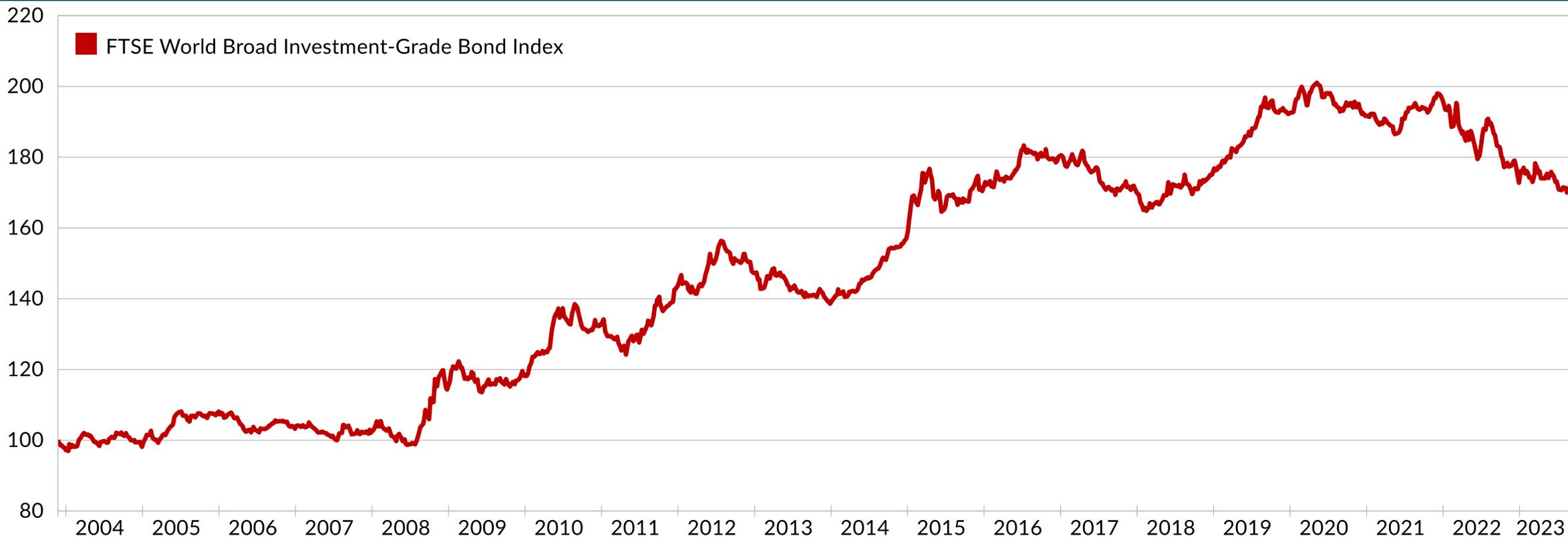
Es sind die großen Verluste, die am meisten schmerzen. Flexible Investments mit aktivem Risikomanagement können Chancen aus den Aktienmärkten nutzen und diese Verluste begrenzen.

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoleistung, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performancedarstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# Weltanleihenmarkt

Entwicklung & Kennzahlen seit Auflage des CQ ARTS TR Bond (24.11.2003)

per 31.08.2023



<b>PERF. GESAMT</b>	<b>71,90%</b>	<b>PERF. P.A.</b>	<b>2,78%</b>	<b>Volatilität</b>	<b>6,26%</b>	<b>Max. DD</b>	<b>-15,99%</b>	<b>5 Jahre</b>	<b>0,07%</b>	<b>5 Jahre p.a.</b>	<b>0,01%</b>
---------------------	---------------	-------------------	--------------	--------------------	--------------	----------------	----------------	----------------	--------------	---------------------	--------------

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoleistung, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performance-Darstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH



**Was machen Verluste mit uns als Anleger?**

# Die Basis der modernen Finanztheorie

Verluste werden anders wahrgenommen als Gewinne!

## Kleines Experiment

### 1. Spiel

A: Münze werfen und bei „Zahl“ 200 € gewinnen, bei „Kopf“ kein Gewinn

B: Kein Münzenwurf und 100 € erhalten

### 2. Spiel

A: Münze werfen und bei „Zahl“ 200 € verlieren, bei „Kopf“ kein Verlust

B: Kein Münzenwurf und gleich 100 € zahlen

## Verluste werden anders wahrgenommen als Gewinne!

**Kleines Experiment (Auswertung in %)**

**Werfen Sie beim 1. Spiel?**

JA

NEIN

**Werfen Sie beim 2. Spiel?**

JA

NEIN

# Das Phänomen „Mensch“



# Ziele des Trendfolgeansatzes

- Schnelle Anpassung des Portfolios an jeweilige Marktentwicklung
- Vermeidung hoher oder langanhaltender Verluste
- Vermeidung menschlicher Fehler sowie irrationaler Verhaltensmuster
- Renditechance in der Investmentphase/Ansparphase (sowohl im Sparplan als auch bei der Einmalanlage)
- Größtmögliche Stabilität der Portfolios auch während der Entnahme-/Auszahlphase
- Zeitliche Flexibilität bei Ein- und Ausstieg

# Mehrstufiges ARTS-Trendfolgemodell

Globales Universum

## Selektion durch

- rechtliche,
- steuerliche & liquiditätstechnische Faktoren
- Track Record Analyse

Fondsuniversum  
> 10.000 Fonds & ETFs  
(65 Ländern & 25 Branchen)

## Aktienquoten- steuerung

- MSCI World definiert die Höhe der Aktienquote

## Wertpapierauswahl durch

- quantitatives Screening: trendfolgend und Momentum gesteuert

## Sektorenrotation

- Auswahl der statistisch stabilsten Trends

Portfolio

Cash- & Risikomanagement

Investment Aktivitäten

## TÄGLICH

- Analyse von mehr als 10.000 Fonds bzw. ETF's
- Verkauforders durch Stop-Loss-Limits

## WÖCHENTLICH

- Reallokation der Asset Allocation – anhand Entwicklung des globalen Aktienmarktes & der jeweiligen Sektoren/Fonds
- Kauf- und Verkauforders

# Wie hilft „Momentum“ dabei in der Praxis?

- Die **Momentum-Strategie als aktiver quantitativer Investment-Ansatz** erhebt nicht den Anspruch, die Marktentwicklung vorhersehen zu können.
- Der **Momentum-Fondsmanager** beobachtet mittels Algorithmen die **kurz- bis mittelfristige Vergangenheit**, um die **Allokation seiner Assets zu bestimmen**.
- Maßgeblich dafür ist das **Momentum**, also die Kursbewegung von Wertpapieren.

**Also, nicht der Versuch das Was und Wann zu prognostizieren,  
sondern einen geeigneten Weg finden mit den  
gegebenen Fakten umzugehen!**

# Trendfolge als Feuerlöscher

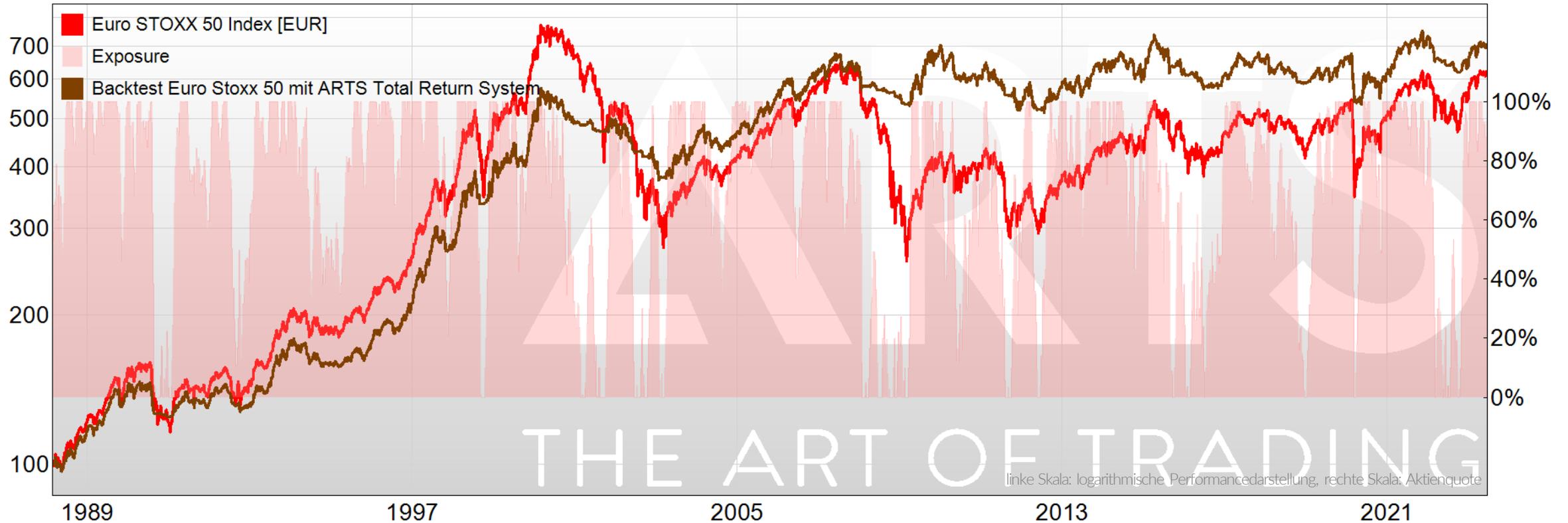


Würden Sie den  
Feuerlöscher wegwerfen,  
nur weil es eine Zeit lang  
nicht gebrannt hat?

# Trendfolge – Ihr Feuerlöscher wenn es brennt

Euro Stoxx 50 – maximaler Wertverlust (-66,88%), Erholungsphase (>23 Jahre)

per 31.08.2023



THE ART OF TRADING

1989		1997		2005		2013		2021			
<b>PERF. GESAMT</b>	507,87%	<b>PERF. P.A.</b>	5,21%	<b>Volatilität</b>	18,74%	<b>Max. DD</b>	-66,88%	<b>5 Jahre</b>	26,22%	<b>5 Jahre p.a.</b>	4,76%
<b>PERF. GESAMT</b>	594,27%	<b>PERF. P.A.</b>	5,60%	<b>Volatilität</b>	12,00%	<b>Max. DD</b>	-35,10%	<b>5 Jahre</b>	12,34%	<b>5 Jahre p.a.</b>	2,35%

Performanceergebnisse und simulierte Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performancedarstellung nicht berücksichtigt. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

# Trendfolge – Ihr Rettungsboot für alle Fälle

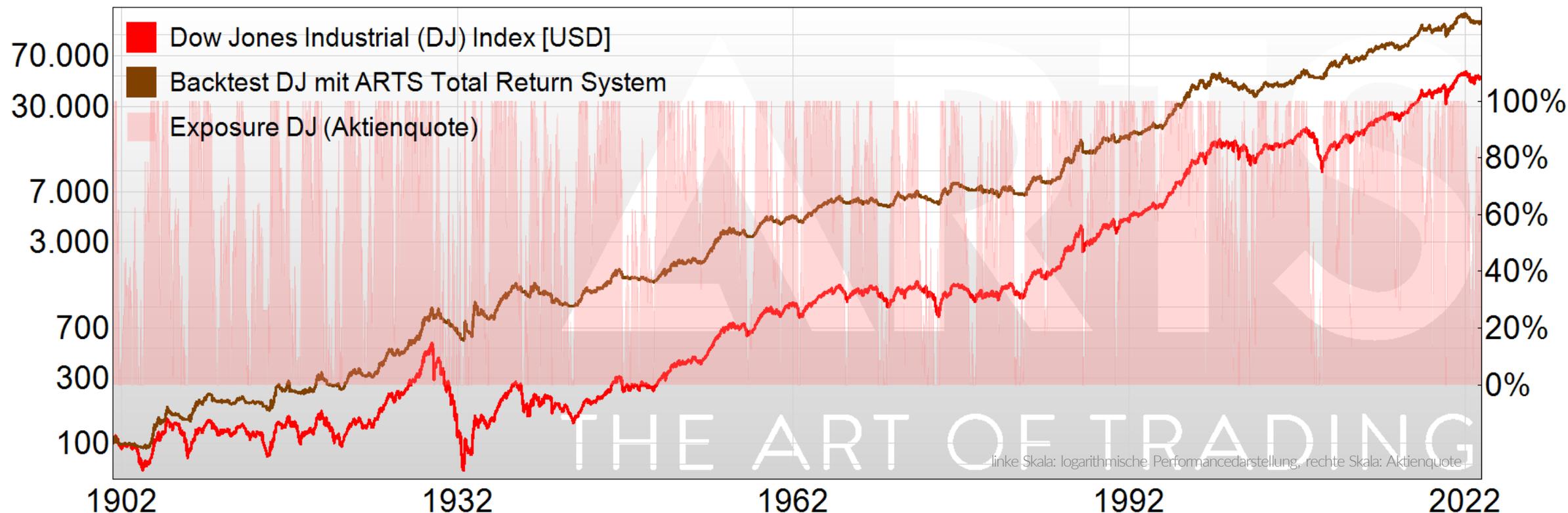
Würden Sie ohne  
Rettungsboote mitfahren?



# Mit Feuerlöscher und Rettungsboot fährt man besser!

Anhand des Dow Jones Industrial seit 1900

per 31.08.2023



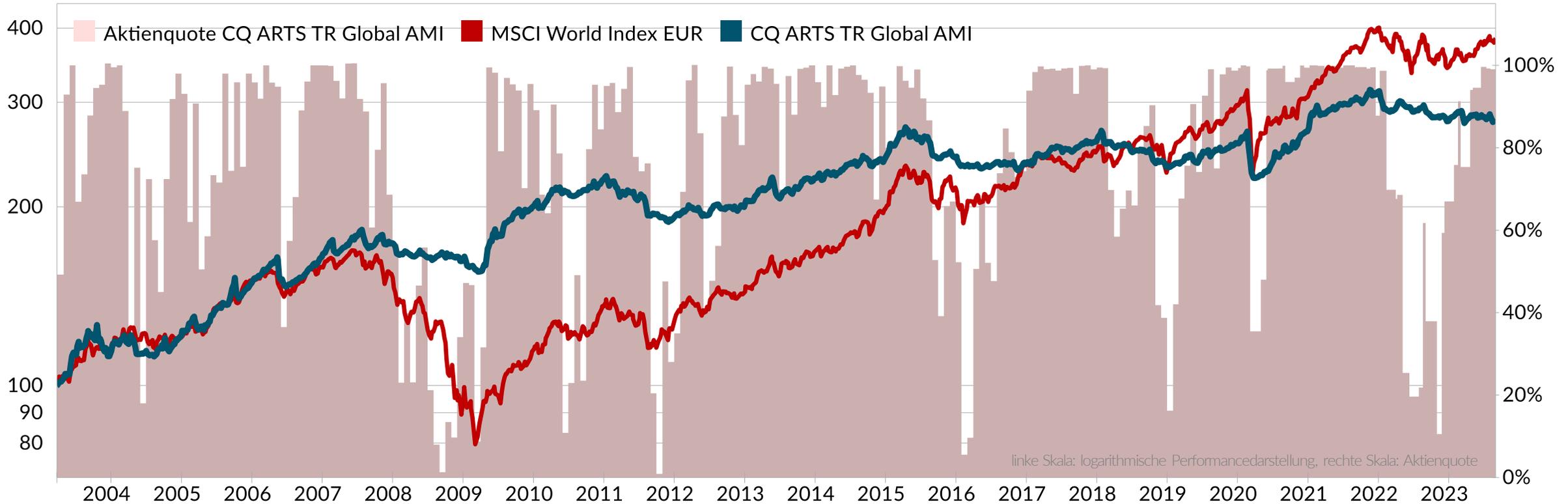
<b>PERF. GESAMT</b> 51.469%	<b>PERF. P.A.</b> 5,23%	<b>Volatilität</b> 19,13%	<b>Maximaler Verlust</b> -89,19%	<b>5 Jahre</b> 33,73%	<b>5 Jahre p.a.</b> 5,98%
<b>PERF. GESAMT</b> 128.147%	<b>PERF. P.A.</b> 6,01%	<b>Volatilität</b> 11,80%	<b>Maximaler Verlust</b> -42,10%	<b>5 Jahre</b> 11,22%	<b>5 Jahre p.a.</b> 2,15%

Performanceergebnisse und simulierte Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performancedarstellung nicht berücksichtigt. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

# C-QUADRAT ARTS Total Return Global AMI

Entwicklung & Kennzahlen seit 27.03.2003

per 31.08.2023



<b>PERF. GESAMT</b>	284,70%	<b>PERF. P.A.</b>	6,82%	<b>Volatilität</b>	15,58%	<b>Max. DD</b>	-55,02%	<b>5 Jahre</b>	47,14%	<b>5 Jahre p.a.</b>	8,03%
<b>PERF. GESAMT</b>	180,97%	<b>PERF. P.A.</b>	5,19%	<b>Volatilität</b>	8,03%	<b>Max. DD</b>	-18,24%	<b>5 Jahre</b>	12,71%	<b>5 Jahre p.a.</b>	2,42%

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performancedarstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH



## Trendfolge bei Bonds

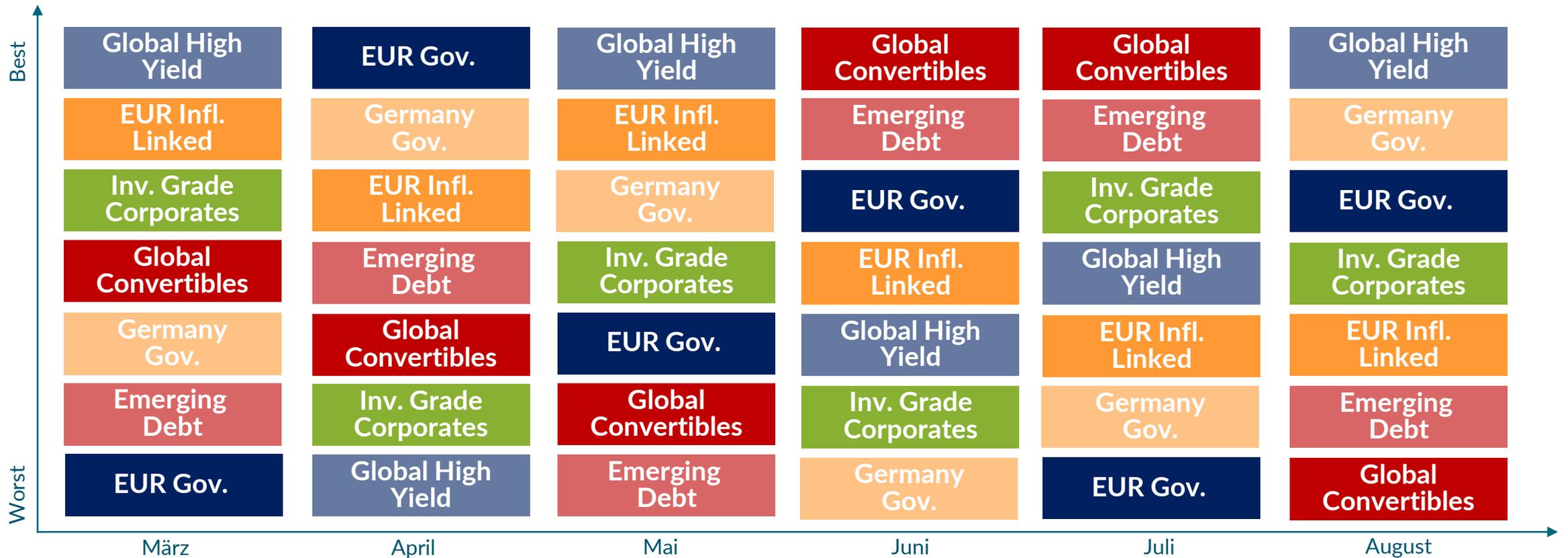
# Globale Anleiherotation in der Praxis

2015-2022



# Globale Anleiherotation in der Praxis

6 Monate



# Globale Anleiheinvestments - Detail

Entwicklung & Kennzahlen seit 01.01.2022

per 31.08.2023

		PERFORMANCE seit 01.01.2022	VOLATILITÄT seit 01.01.2022	MAX. VERLUST seit 01.01.2022	KORRE- LATION*	PERF 5 J	PERF 5 J p.a.
<b>CQ ARTS TR Bond</b>	Total Return	-3,80%	3,42%	-6,47%		4,44%	0,87%
<b>FTSE Europe GBI EUR</b>	European Government	-18,08%	9,01%	-20,38%	0,11	-9,49%	-1,97%
<b>FTSE EuroBIG Corp Index</b>	Inv. Grade Corporates	-11,07%	5,52%	-16,06%	0,27	-4,55%	-0,93%
<b>FTSE World HY Bond Index</b>	Global High Yield	-1,47%	6,77%	-9,12%	0,32	20,83%	3,86%
<b>FTSE EM Broad Bond Index</b>	Emerging Dept	-9,03%	8,67%	-12,98%	0,45	12,58%	2,40%
<b>Thomson Reuters Qual.Glob. Conv. Index</b>	Global Convertibles	-12,21%	9,71%	-23,11%	0,47	23,44%	4,30%
<b>Deutscher Rentenindex (REX)</b>	Germany Government	-11,59%	6,14%	-13,38%	-0,06	-10,52%	-2,20%
<b>J.P. Morgan Euro Li. Secur. Index Aggr.</b>	EUR Infl Linked	-5,36%	8,75%	-15,00%	0,24	9,42%	1,82%
<b>FTSE World Broad Investm.-Grade Bond Index</b>	Anleihen Global	-11,88%	7,68%	-13,52%	0,09	0,07%	0,01%

\*Korrelationsberechnung jeweils im Vergleich mit dem C-QUADRAT ARTS Total Return Bond

## Fondsfakten

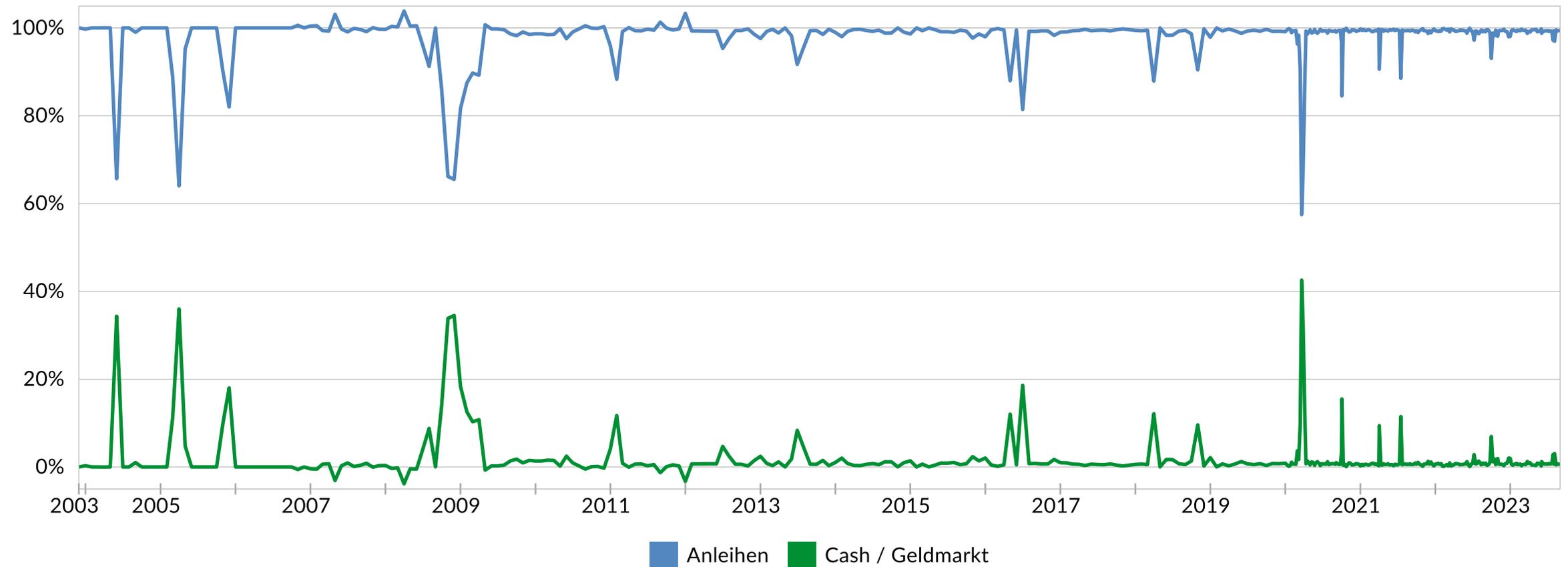
- **Aktiver Vermögensverwaltungsansatz**  
ausschließlich auf Anleiheebene
- **Technisches quantitatives Handelssystem**
  - Algorithmus-basierte, trendfolgende Entscheidungsfindung
- **Flexible Anlagerichtlinien**
  - die Portfoliozusammensetzung wird nicht durch eine Benchmark bestimmt
  - Keine Einschränkung bezüglich Laufzeiten, Regionen und Währungen
  - Freie Selektion der profitabelsten Sektoren
  - Investieren in das Know How der besten Portfolio-Manager
- **Breites Anlageuniversum aus über 1.000 Rentenfonds**
  - Staatsanleihen
  - Unternehmensanleihen
  - High-Yield Anleihen
  - Emerging Markets Anleihen
  - Inflation Linked Anleihen
  - Wandelanleihen

# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Fondsanalyse seit 24.11.2003

per 31.08.2023

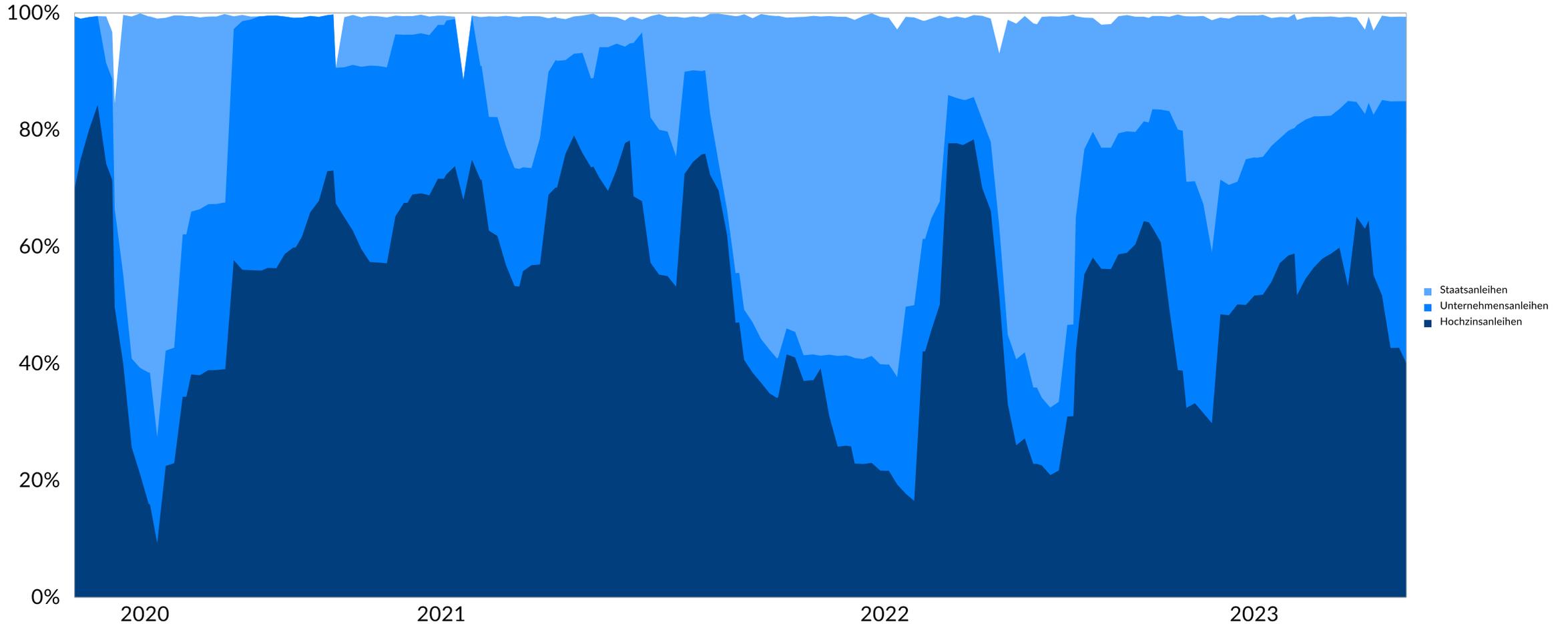
## Historische Asset Klassen



# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Rotation - ANLEIHEN auf Schuldner Ebene 3 Jahre

per 31.08.2023



SCHULDNER PER 31.08.2023

Unternehmensanleihen 44,79%

Hochzinsanleihen 40,09%

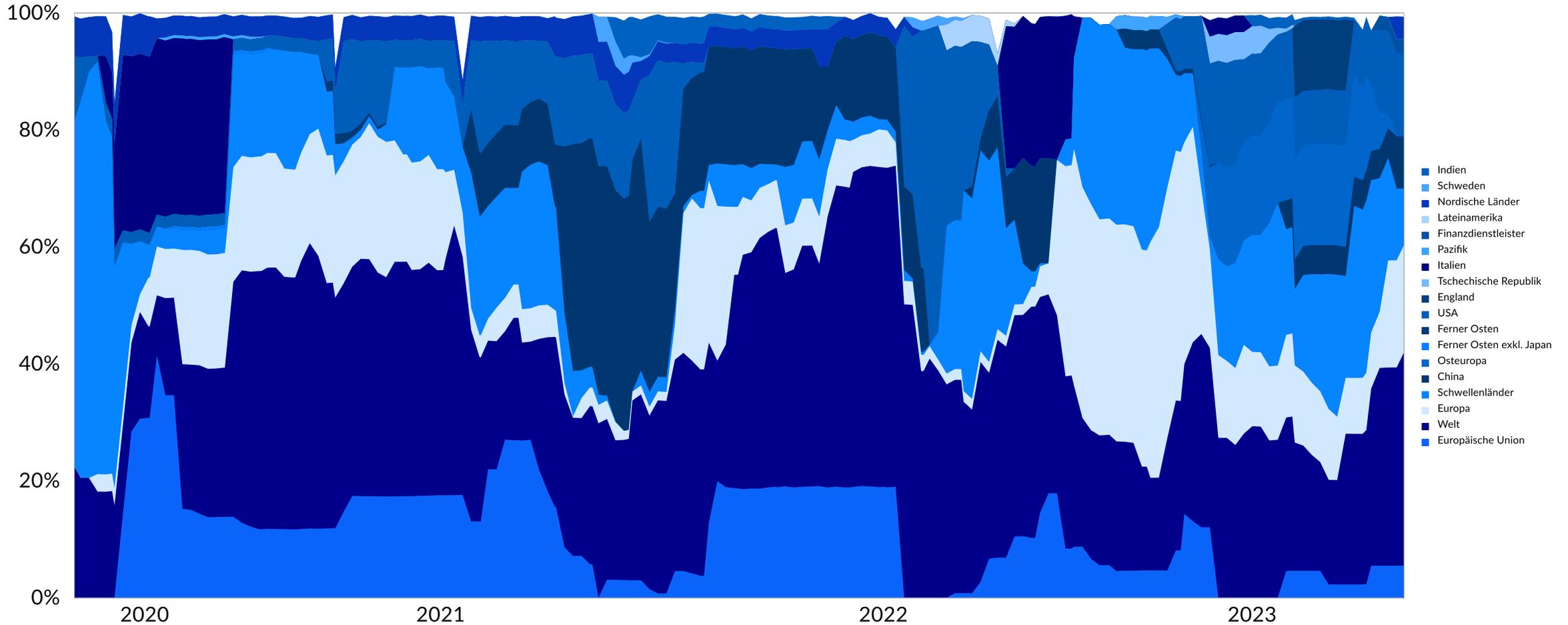
Staatsanleihen 14,47%

Die vorliegenden Bestandsdaten zeigen die jeweiligen Umschichtungen innerhalb des Fonds im Betrachtungszeitraum und basieren auf letztverfügbaren Informationsquellen und können daher von den Bestandsdaten der Fondsbuchhaltung (juristischer Bestand) abweichen.  
Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Rotation - ANLEIHEN auf Länder/Sektoren Ebene 3 Jahre

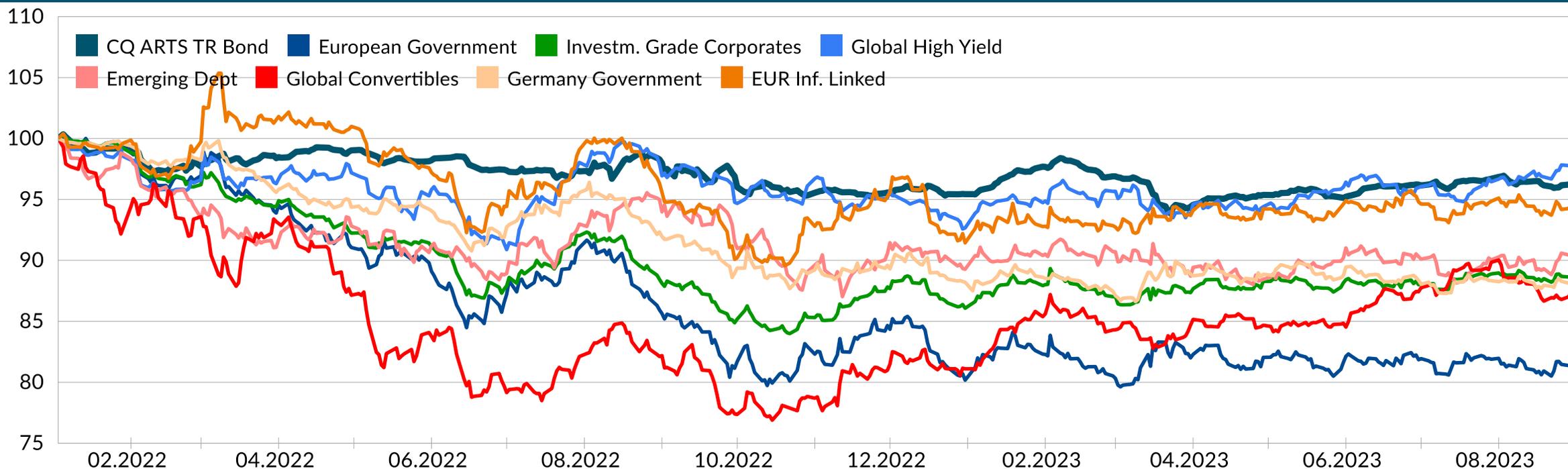
per 31.08.2023



# Globale Anleiheinvestments

Entwicklung & Kennzahlen seit 01.01.2022

per 31.08.2023



Performance 5 Jahre p.a.

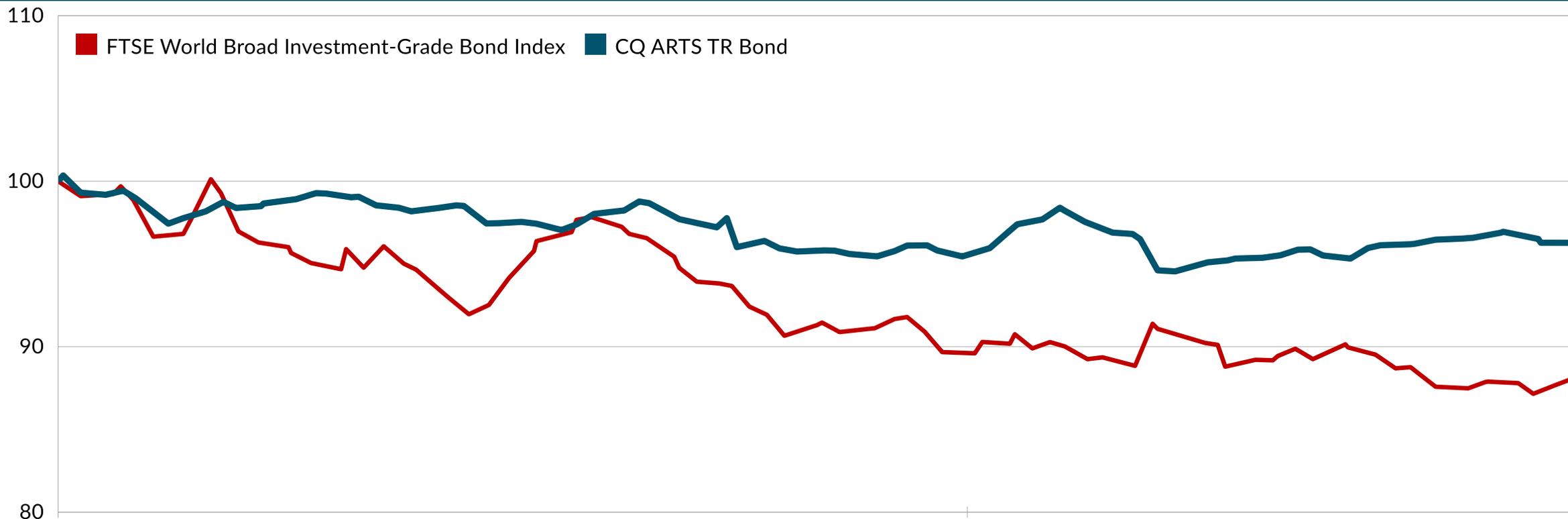
Total Return	European Government	Investm. Grade Corporates	Global High Yield	Emerging Dept	Global Convertibles	Germany Government	EUR Infl Linked
CQ ARTS TR Bond	FTSE Europe GBI	FTSE EuroBIG Corp Index	FTSE World HY Bond Index	FTSE EM Broad Bond Index	Thomson Reut. Qu.Glob.Conv	Deutscher Rentenindex REX	JP Morg. Eur. Li.Sec. Ind.Agg.
0,87%	-1,97%	-0,93%	3,86%	2,40%	4,30%	-2,20%	1,82%

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoleistung, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performance-Darstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Entwicklung & Kennzahlen seit 01.01.2022

per 31.08.2023



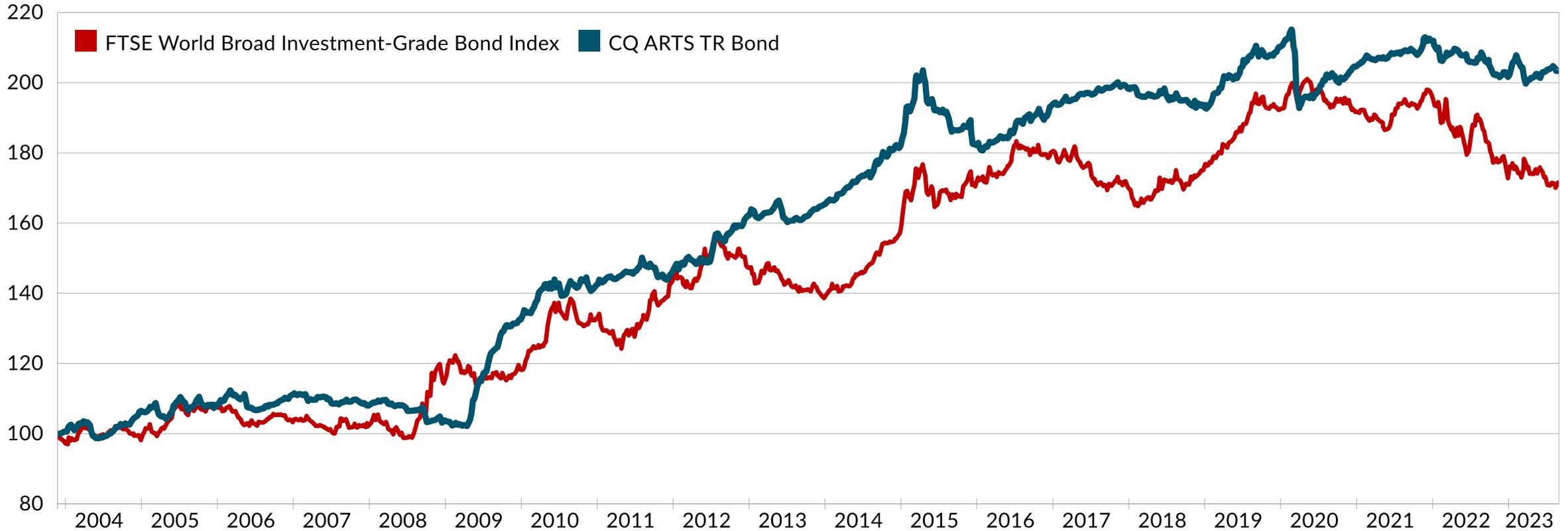
				2023							
<b>PERF. GESAMT</b>	<b>-11,88%</b>	<b>PERF. P.A.</b>	<b>-7,30%</b>	<b>Volatilität</b>	<b>7,68%</b>	<b>Max. DD</b>	<b>-13,52%</b>	<b>5 Jahre</b>	<b>0,07%</b>	<b>5 Jahre p.a.</b>	<b>0,01%</b>
<b>PERF. GESAMT</b>	<b>-3,80%</b>	<b>PERF. P.A.</b>	<b>-2,30%</b>	<b>Volatilität</b>	<b>3,42%</b>	<b>Max. DD</b>	<b>-6,47%</b>	<b>5 Jahre</b>	<b>4,44%</b>	<b>5 Jahre p.a.</b>	<b>0,87%</b>

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoleistung, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performance-Darstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Entwicklung & Kennzahlen seit 24.11.2003

per 31.08.2023



<b>PERF. GESAMT</b>	71,90%	<b>PERF. P.A.</b>	2,78%	<b>Volatilität</b>	6,26%	<b>Max. DD</b>	-15,99%	5 Jahre	0,07%	5 Jahre p.a.	0,01%
<b>PERF. GESAMT</b>	103,50%	<b>PERF. P.A.</b>	3,66%	<b>Volatilität</b>	3,63%	<b>Max. DD</b>	-11,29%	5 Jahre	4,44%	5 Jahre p.a.	0,87%

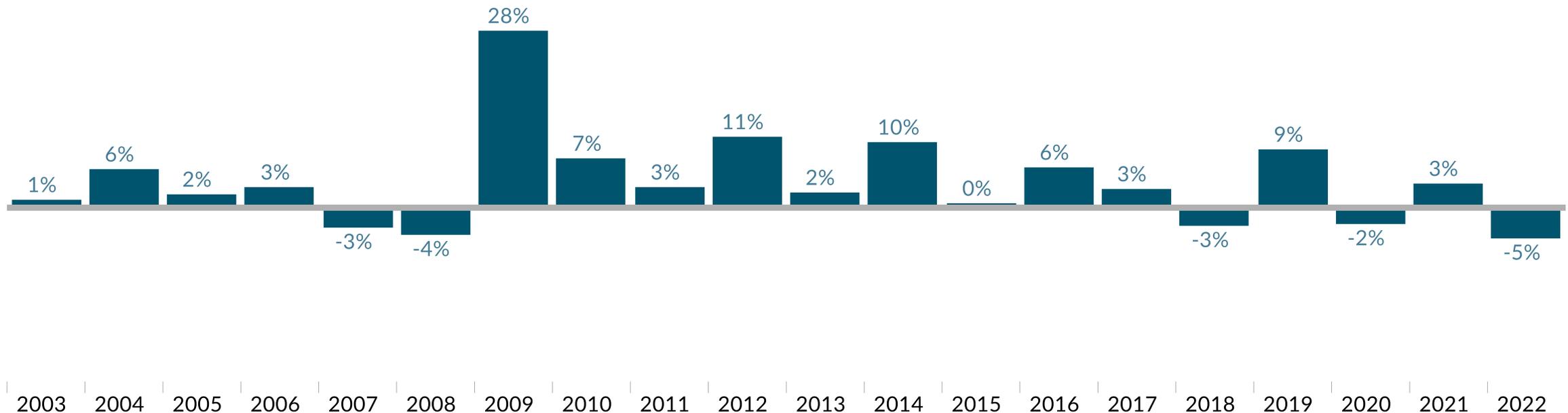
Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoleistung, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performance-Darstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Entwicklung & Kennzahlen seit 24.11.2003

per 31.08.2023

## Jährliche Erträge



<b>PERF. GESAMT</b>	103,50%	<b>PERF. P.A.</b>	3,66%	<b>Volatilität</b>	3,63%	<b>Max. DD</b>	-11,29%	<b>5 Jahre</b>	4,44%	<b>5 Jahre p.a.</b>	0,87%
---------------------	---------	-------------------	-------	--------------------	-------	----------------	---------	----------------	-------	---------------------	-------

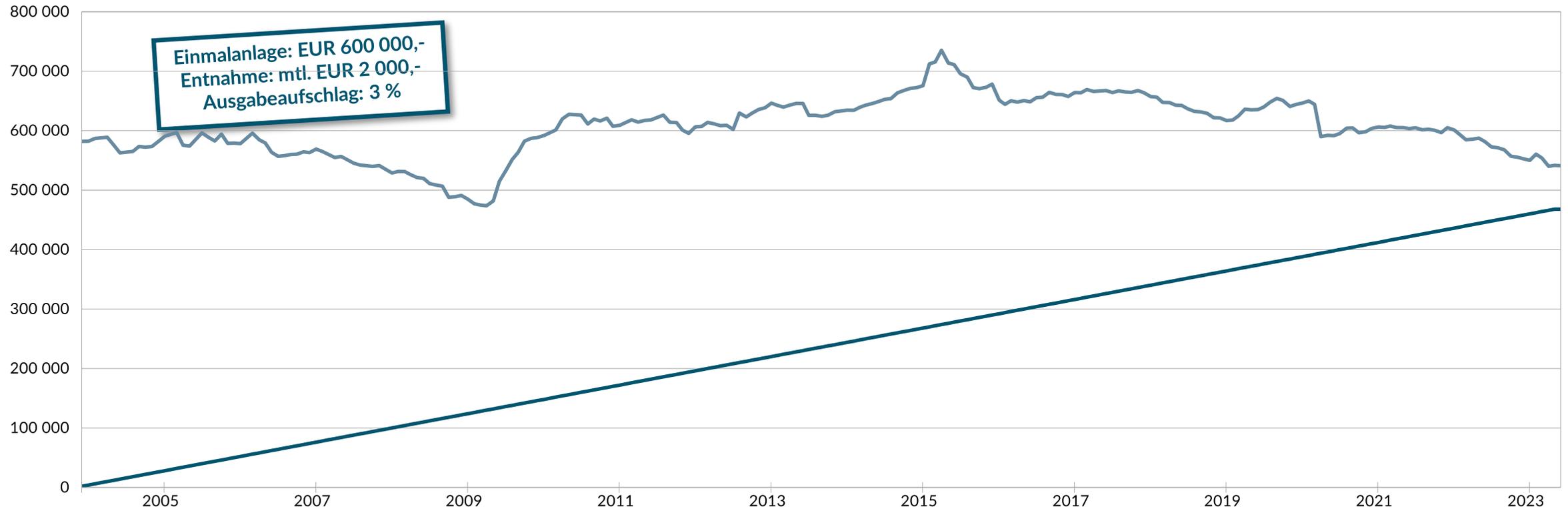
Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performance-Darstellung nicht berücksichtigt und beträgt bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR bis zu 50,- EUR. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

# Wertentwicklung Entnahmeplan

seit 24.11.2003

per 31.05.2023

## C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T



**Entnommener Wert EUR 468 000,00**

**Performance Wert EUR 72 972,23**

**Depotwert EUR 540 972,23**

**Performance in % 73,36%**

Performanceergebnisse der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Ausgabe- und Rücknahmespesen sind in der Berechnung der Performanceergebnisse nicht berücksichtigt. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Bei einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR ist vom Anleger ein Ausgabeaufschlag i.H.v. max. 30,- EUR zu bezahlen, welcher die Wertentwicklung seiner Anlage entsprechend mindert. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Weitere, individuelle, auf Anlegerebene anfallende Kosten wie zB Transaktions-, Depotkosten und Steuern mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH

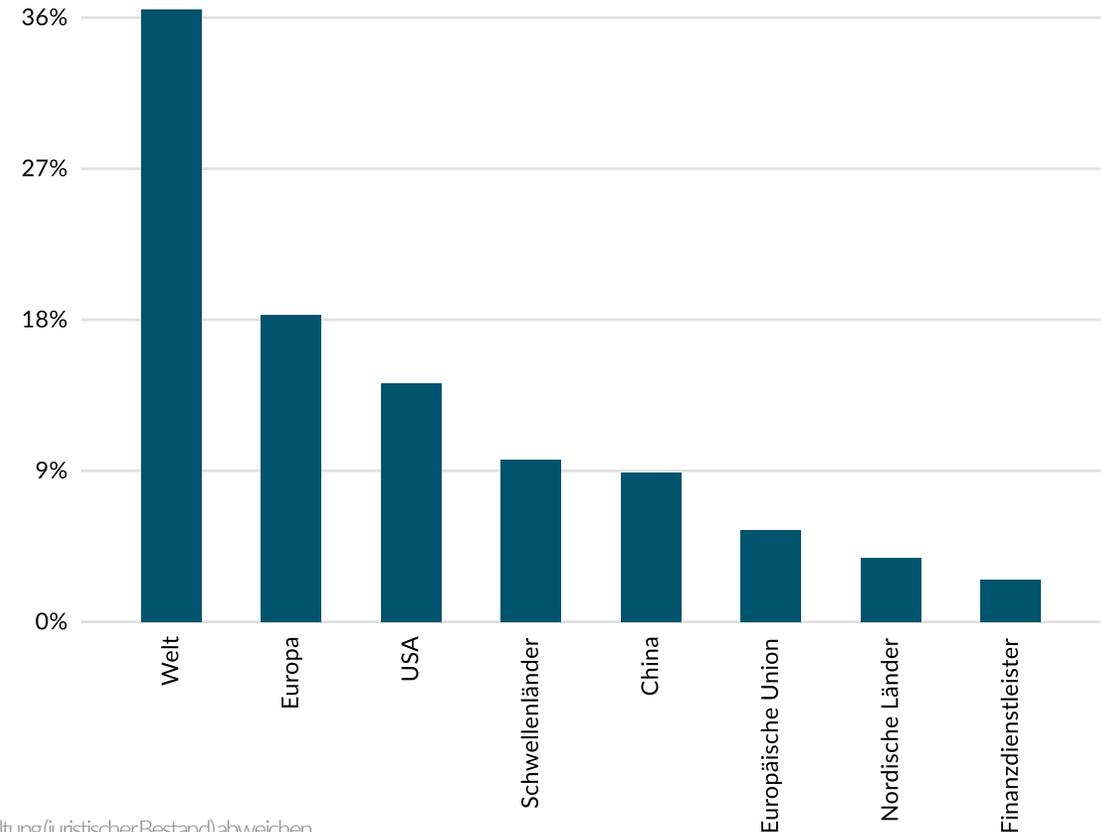
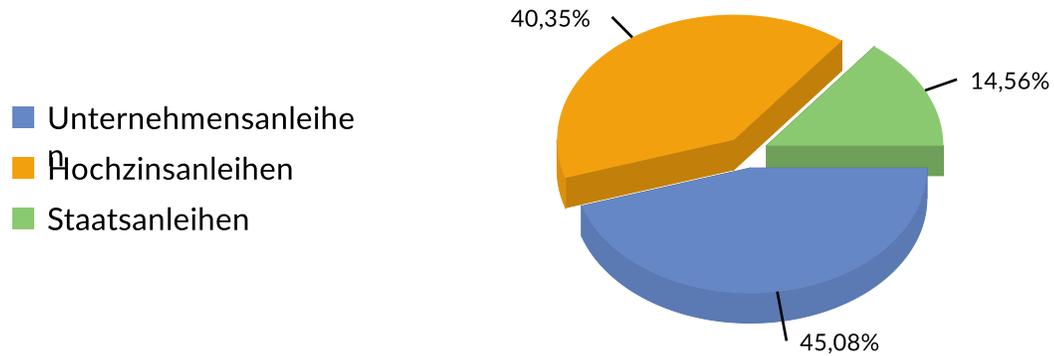
# C-QUADRAT ARTS Total Return Bond T

Fondsdaten

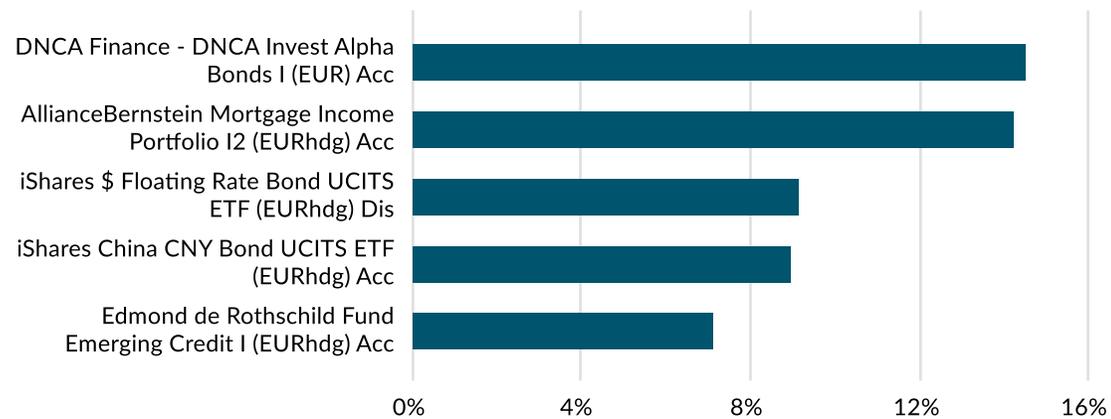
per 31.08.2023

Anleiheschuldner

Anleiheregionen



Top Positionen



## Zum elften Mal Österreichs erfolgreichster Dachfondsmanager



### Fund Award 2023



#### 1. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Global AMI (20J)  
DWS Concept ARTS Conservative (20J)  
C-QUADRAT ARTS TR Flexible (3J)

#### 2. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Dynamic (3J)

#### 3. Platz

DWS Concept ARTS Balanced (20J)  
DWS Concept ARTS Conservative (10J)

### Deutscher Fondspreis



#### 1. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Global-AMI (5J)  
C-QUADRAT ARTS TR Bond (3J, 5J)

#### 2. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Dynamic (5J)  
C-QUADRAT ARTS Best Momentum (5J)  
RAM Wachstum (5J)

#### 3. Platz

RAM Dynamisch (5J)

### Österr. Dachfonds Award



seit 2001

108 x 1. Platz

71 x 2. Platz

61 x 3. Platz

#### 1. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Bond (3J, 5J)  
C-QUADRAT ARTS TR Global AMI (3J, 5J)

#### 2. Platz

C-QUADRAT ARTS TR Bond (1J)  
C-QUADRAT ARTS TR Defensive (1J, 3J)  
C-QUADRAT ARTS TR Dynamic (5J)  
C-QUADRAT ARTS TR Flexible (3J)  
C-QUADRAT ARTS TR Vorsorge (1J)  
DWS Concept ARTS Dynamic (1J, 3J, 5J)

#### 3. Platz

C-QUADRAT ARTS TR ESG (3J)  
C-QUADRAT ARTS TR Global AMI (1J)  
DWS Concept ARTS Conservative (3J, 5J)

# Rechtshinweis & Erläuterungen

## Rechtlicher Hinweis

Diese Marketingmitteilung dient ausschließlich unverbindlichen Informationszwecken und stellt kein Angebot oder Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen dar, noch ist sie als Aufforderung anzusehen, ein Angebot zum Abschluss eines Vertrages über eine Wertpapierdienstleistung oder Nebenleistung abzugeben. Dieses Dokument kann eine Beratung durch Ihren persönlichen Anlageberater nicht ersetzen.

Alle Angaben und Inhalte dieses Dokumentes sind ohne Gewähr, vertraulich und ausschließlich für den internen Gebrauch bestimmt. Jede unautorisierte Form des Gebrauches dieses Dokumentes, insbesondere dessen Reproduktion, Verarbeitung, Weiterleitung oder Veröffentlichung ist untersagt. Der Ersteller dieses Dokumentes sowie mit ihm verbundene Unternehmen schließen jede Haftung für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der enthaltenen Informationen und geäußerten Meinungen zur Gänze aus.

Alle dargestellten Wertentwicklungen entsprechen der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht.

Performanceergebnisse der Vergangenheit, Backtestdaten sowie vergangenheits- oder zukunftsbezogene Simulationen lassen keine Rückschlüsse auf die laufende und zukünftige Entwicklung dieser Zahlen oder der diesen zugrunde liegenden Finanzinstrumente bzw. Indizes zu und sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Dies gilt insbesondere für den Einsatz von Backtest-Daten, welche immer zu hypothetischen, vergangenheitsbezogenen Darstellungen führen. Eine Kapitalanlage in Investmentfonds unterliegt allgemeinen Konjunkturrisiken und Wertschwankungen, die zu Verlusten - bis hin zum Totalverlust des eingesetzten Kapitals - führen können. Es wird ausdrücklich auf die ausführlichen Risikohinweise des Verkaufsprospektes verwiesen.

Trends können sich ändern und negative Renditeentwicklungen nach sich ziehen. Ein trendfolgendes Handelssystem kann Trends über- oder untergewichten.

Anteilsklassen in Fremdwährungen bringen ein zusätzliches Währungsrisiko mit sich, die Performance kann infolge von Währungsschwankungen fallen oder steigen.

Performanceergebnisse und simulierte Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Jede Kapitalveranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Der Fonds kann aufgrund temporär konzentrierter Investitionen in einzelne volatile Märkte eine erhöhte Volatilität aufweisen, d.h. die Anteilswerte können auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt sein. Die Performance wurde unter Anwendung der OeKB/BVI-Methode berechnet. Dargestellte Marktindizes sollen nur die Marktentwicklung im angeführten Zeitraum wiedergeben und stellen keinen Vergleich von Wertentwicklungen mit ARTS Produkten dar. Die dargestellte Wertentwicklung entspricht der Bruttoperformance, welche alle anfallenden Kosten auf Fondsebene beinhaltet und von einer Wiederanlage ev. Ausschüttungen ausgeht. Der Ausgabeaufschlag ist in der Performancedarstellung nicht berücksichtigt. Weitere auf Anlegerebene anfallende, individuelle Kosten wie zB Transaktions-, Rücknahme-, und Depotkosten, Steuern sowie Inflation mindern den Ertrag des Anlegers zusätzlich. Berechnungsquelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

Die Darstellungen in diesem Dokument sind nur allgemeiner Natur, berücksichtigen nicht die individuelle steuerliche Situation des jeweiligen Anlegers und können sich jederzeit durch gesetzliche Änderungen oder Verwaltungspraxis verändern. Für detaillierte Auskünfte zur individuellen Besteuerung des Anlegers sollte daher ein Steuerberater kontaktiert werden.

Informationen über Bandbreiten für marktübliche Entgelte der Wertpapierfirmen sind in einer Publikation der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) auf deren Homepage ([www.fma.gv.at](http://www.fma.gv.at)) veröffentlicht.

Hinweis für Endverbraucher: Den Ausgabeaufschlag kann Ihre Bank oder Ihr Vermittler erhalten. Die Verwaltungsvergütung kann eine Vertriebsprovision beinhalten, die Ihre Bank oder Ihr Vermittler ggf. teilweise erhält. Die Produkte sind bei Ihrer Bank oder Ihrer Sparkasse erhältlich.

ARTS Asset Management GmbH bezieht in ihr Dienstleistungsangebot an Sie auch Eigenprodukte ein.

Bei der Erbringung von Wertpapierdienstleistungen dürfen von ARTS Asset Management GmbH keine Kundengelder entgegengenommen werden.

Dieses Dokument wurde von ARTS Asset Management GmbH erstellt. Trotz aller Sorgfalt kann keine Haftung oder Garantie für die Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit der zur Verfügung gestellten Daten & Informationen übernommen werden.

©2023 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Details zum Morningstar Rating unter [www.morningstar.de](http://www.morningstar.de).

### Hinweis für DE

Die Tätigkeit der ARTS Asset Management GmbH in Deutschland beschränkt sich auf die Schulung und Betreuung von Vertriebspartnern/institutionellen Kunden/Interessenten und die Durchführung von Marketingmaßnahmen im Zusammenhang mit Investmentfonds. Hierdurch wird in DE keine Finanzdienstleistung (§ 1 Abs. 1 a KWG) oder erlaubnispflichtige Tätigkeit im Sinne der Gewerbeordnung (§ 34 c Gewerbeordnung) erbracht. ARTS Asset Management GmbH erbringt in Deutschland keine Anlageberatung, keine Anlage- und Abschlussvermittlung und keine Beratung oder Vermittlung von Investmentfonds/Vermögensanlagen.

Grundlage für den Kauf von Investmentanteilen ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt, das Basisinformationsblatt (PRIIP-KID) sowie der Jahresbericht und, falls älter als acht Monate, der Halbjahresbericht. Diese Unterlagen stehen dem Interessenten jeweils bei der entsprechenden Kapitalanlagegesellschaft Ampega Investment GmbH, Charles-de-Gaulle-Platz 1, D-50679 Köln, HANSAINVEST, Hanseatische Investment-GmbH, Kapstadtring 8, D-22297 Hamburg und bei der ARTS Asset Management GmbH, Schottenfeldgasse 20, A-1070 Wien, sowie am Sitz der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland, Hauck Aufhäuser Lampe Privatbank AG, Kaiserstraße 24, D-60311 Frankfurt am Main, sowie im Internet unter <https://www.ampega.de/>,

<https://www.hansainvest.com/deutsch/fondswelt/download-center/> und <https://www.arts.co.at> kostenlos in deutscher Sprache zur Verfügung. Die Darstellungen in diesem Dokument sind nur allgemeiner Natur, berücksichtigen nicht die individuelle steuerliche Situation des jeweiligen Anlegers und können sich jederzeit durch gesetzliche Änderungen oder Verwaltungspraxis verändern. Für detaillierte Auskünfte sollte daher ein Steuerberater kontaktiert werden. Folgende Datenquellen können verwendet werden: Bloomberg, Standard&Poor's (Micropal), Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, ARTS Asset Management GmbH, Tipas, Profit Web, FAIT/Software Systems, OnVista, OeKB.

## Verwendete Berechnungsmethoden

### Volatilität

Wertschwankung des Fonds (auf Tagesbasis)

### Mod. Sharpe Ratio

Verhältnis Rendite zu Volatilität (ohne Berücksichtigung des risikofreien Zinssatzes, auf Tagesbasis)

### Korrelation

Abhängigkeit des Kursverlaufes des Fonds im Verhältnis zu einem Referenzindex (auf Monatsbasis).

(1) – gleichlaufende Wertentwicklung

(-1) – gegenläufige Wertentwicklung

(0) – unabhängige Wertentwicklung

### Anteilsklassen

A = Ausschüttung; T = Thesaurierung; VT = Vollthesaurierung In- & Ausland; VT-A = Vollthesaurierung Ausland; VT-I = Vollthesaurierung Inland