

Ampega Investment GmbH
Charles-de-Gaulle-Platz 1
50679 Köln
Deutschland
(Verwaltungsgesellschaft)

Halbjahresbericht

vom 1. Dezember 2019 bis 31. Mai 2020 des

C-QUADRAT ARTS Total Return Garant

Es handelt sich um einen OGAW gemäß § 2 Abs. 1 und 2 iVm. § 50 InvFG

Halbjahresbericht

des C-QUADRAT ARTS Total Return Garant, Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 2 InvFG 2011, für das Rechnungsjahr vom 1. Dezember 2019 bis 31. Mai 2020.

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

die Ampega Investment GmbH legt hiermit den Bericht des C-QUADRAT ARTS Total Return Garant über die erste Hälfte des Rechnungsjahres 2019/2020 vor.

Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates, den Gesellschafterkreis sowie über das gezeichnete und eingezahlte Kapital finden Sie im Abschnitt „Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft“.

Köln, im Juli 2020

Ampega Investment GmbH

Die Geschäftsführung



Manfred Köberle



Jürgen Meyer

1. Zusammensetzung des Fondsvermögens

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Whrg	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
INVESTMENTZERTIFIKATE									
INVESTMENTZERTIFIKATE EURO									
DE0006289473		I.EB.R.G.G.1.5-2.5Y U.ETF	EUR	3.550	3.550		84,1160	298.611,80	0,21
FR0000978371		AXA IM EURO LIQUID. 4DEC.	EUR	77		232	44.608,1500	3.434.827,55	2,40
IE0005023910		ICS-BR ICS EUR.LIQ. ACC	EUR	31.100	31.100		136,0141	4.230.038,51	2,95
IE0031295938		GOLDMAN S.-EO LIQ.INS.ACC	EUR	1.522	1.240		12.171,4000	18.524.870,80	12,94
IE00B39VCB93		ICS-BR ICS EU.GO.LI. A	EUR	43.100	43.100		98,0473	4.225.838,63	2,95
IE00BCRY6557		ISIV-EO ULTR.BD U.ETF EOD	EUR	3.050	3.050		99,5200	303.536,00	0,21
IE00BD9MMF62		JPM I-EO ULTRA-SH.INC.EOA	EUR	3.050	3.050		99,1500	302.407,50	0,21
LU0088882138		JPM LIQ.-EO L.VNAV C CAP	EUR	316	316		13.383,8700	4.229.302,92	2,95
LU0090865873		ASL(L)-EURO FUND A2	EUR	30.290		4.900	438,1696	13.272.157,18	9,27
LU0099730524		DWS INS.-ESG EO MO.M.IC	EUR	246		812	13.861,7600	3.409.992,96	2,38
LU0128494944		PICT.-SHORT-TERM MM EUR I	EUR	149.000	149.000		138,0368	20.567.483,20	14,36
LU0136043634		SISF EURO LIQUIDITY C ACC	EUR	34.150	34.150		123,8211	4.228.490,57	2,95
LU0167237543		BNPPIC-EO 1D ST VNAV CLAS	EUR	178.964	110.051		114,4008	20.473.622,48	14,30
LU0261953490		FID.FDS-EURO C. A ACC.EUR CANDR.M.MKT.-EURO AAA I	EUR	315.500	730.000	678.000	10,5742	3.336.160,10	2,33
LU0354091901		C	EUR	4.006	4.006		1.055,7400	4.229.729,06	2,95
LU0366536638		PIC.-SOV.SH.T.MM EUR I	EUR	42.200	42.200		100,2488	4.230.499,36	2,95
LU0568620131		AF AM.F.CASH EUR 12EOC	EUR	18.550	5.300	2.100	1.000,9300	18.567.251,50	12,97
LU0721553351		UBS-MK.IB.EO G.1-3 EOAD	EUR	3.900	3.900		77,1760	300.986,40	0,21
SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE								128.165.806,52	89,50
SUMME DER NICHT ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE								0,00	0,00
OPTIONEN									
OPTIONEN CASH STYLED OPTIONS									
oC2K00003323		Garantieoption C-QUADRAT ARTS Total Return Garant	EUR	1.167.141	31.087	35.968		0,00	0,00
SUMME OPTIONEN								0,00	0,00
BANKGUTHABEN									
EUR-Guthaben								15.218.617,55	10,63
SUMME								15.218.617,55	10,63
ABGRENZUNGEN									
SONSTIGE FORDERUNGEN								0,00	0,00
ZINSENANSPRÜCHE								-11.355,13	-0,01
SOLLZINSEN								0,00	0,00

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen									
ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Whrg	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
								-172.349,87	-0,12
								1.876,06	0,00
								0,00	0,00
SUMME ABGRENZUNGEN								-181.828,94	-0,13
SUMME Fondsvermögen								143.202.595,13	100,00

ERRECHNETER WERT 3323T21 C-QUADRAT ARTS Total Return Garant (VTH) IA	EUR	122,70
ERRECHNETER WERT 3323T71 C-QUADRAT ARTS Total Return Garant (VTH) IA H	EUR	94,25
UMLAUFENDE ANTEILE 3323T21 C-QUADRAT ARTS Total Return Garant (VTH) IA	STUECK	1.167.038,930
UMLAUFENDE ANTEILE 3323T71 C-QUADRAT ARTS Total Return Garant (VTH) IA H	STUECK	60,000

UMRECHNUNGSKURSE/DEISENKURSE

VERMOEGENSWERTE IN FREMDER WAHRUNG ZU DEN DEISEN/UMRECHNUNGSKURSEN
PER 29.05.2020 IN EUR UMGERECHNET

WÄHRUNG	EINHEIT in EUR	KURS
Euro	EUR	1 = EUR 1,000000

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal
------	----------	------------	---------	---------	----------------------	----------------------

IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN

DE0005933964		ISHARES SLI UCITS ETF DE	CHF	o	5.200	5.200
LU0038279252		GAM MULT.-CH SM+M E A	CHF	o	1.680	1.680
LU0092739993		3V INV.SWISS SM.+MID CAPA	CHF	o	3.650	3.650
LU0099407156		GAM MULT.-SWISS EQ C	CHF	o	2.020	2.020
LU0132668087		UBAM-SWISS EQUITY I	CHF	o	2.380	2.380
LU1602150465		CS I.F.2-L.SWIS.OP.EQ.BSF	CHF	o	22.600	22.600

IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO

AT0000706502		ALL.PIMCO CORP.MITEIG (T)	EUR	o	56.000	56.000
AT0000739248		ALLIANZ I.OSTEU.MIT.TH.T	EUR	o		9.800
AT0000764873		AMU CENT+EAST EU BOND (T)	EUR	o		27.500
AT0000A1CTG1		KEPLER OSTEUROPA RF IT(T)	EUR	o		4.800
AT0000A1X5H0		ERSTE BD DANUBIA EUR I T	EUR	o		19.400
AT0000A1Y3A9		ERSTE BD US HY EU I A	EUR	o	22.200	22.200
FR0007009139		R-CO CONV.CONVERT.EUR. C	EUR	o		14.500
FR0010527275		LYX.WORLD WATER U.ETF D	EUR	o	60.000	141.000
FR0010674978		LA FRANCAISE SUB DEB C	EUR	o		5.630
IE00B1TXK627		ISHSII-GL.WATER DLDIS	EUR	o	9.100	62.100
IE00B7LGGZ558		ISV FRAN.GOV.BD U.ETF EOD	EUR	o	31.000	31.000
IE00BDCJYF87		BNY MGF-U.S.M.I.D.HACCCEOH	EUR	o	4.400.000	4.400.000
IE00BP8FKB21		X(IE)-FTSE D.E.XUK R.E.1C	EUR	o	51.000	51.000
IE00BWT3KN65		UBS(I)-FA.MSCI US.QU.AAHE	EUR	o	114.000	114.000
LU0196034317		JHH-JHH P.EUR.PROP.EQ.I2A	EUR	o	93.300	93.300
LU0216737063		AXA WLD-FR.EU.RE.E.S.F TH	EUR	o	19.400	19.400
LU0227144903		AXA WLD-EURO 10+LT I T.EO	EUR	o	12.400	12.400
LU0231473439		ASSCVI-SLT EU.HYB IAEO	EUR	o	144.000	144.000
LU0252965594		BGF-JAP.SM.+MIDC.OPP.D2EO	EUR	o		38.500
LU0345362361		FID.FDS-AS.PA.OP. YACCEO	EUR	o		120.000
LU0348413229		DEKALUX-PHARMATECH CF	EUR	o	13.200	13.200
LU0360481740		MSI-EUROP.PPTY NAM. Z EO	EUR	o		67.000
LU0511403627		ABSCAVI-AM.GR.PTF IAEOH	EUR	o	58.000	58.000
LU0546688564		NN(L)-HEALTH CARE PCEOHII	EUR	o	1.610	1.610
LU0572943370		JHH-J.H.H.A.P.P.E. I2EOAC	EUR	o		14.200
LU0629460832		UBS-ETF-MSCI PAC.S.R.DLAD	EUR	o		8.500
LU0772943501		NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	EUR	o	9.400	66.900
LU0823380802		BNPP EURO HY BD CC	EUR	o	5.900	5.900
LU1032541671		T.R.PR.-EUR.H.YLD BD QAEO	EUR	o	31.000	31.000
LU1047850778		DNB FD-DNB TECHNOL. IACEO	EUR	o		13.600
LU1111708787		JSS-JSS INS.BD OPP.CACCEO	EUR	o		12.700
LU1129459035		LOYS EUR.- AKTIEN EUR. I	EUR	o	5.500	5.500
LU1303941246		MANDARINE EU.MICROCAP GEO	EUR	o	5.700	9.500
LU1582979222		M+G(L)IF1-EM H.C.BEOCHACC	EUR	o	132.000	132.000
LU1587985224		BELLEVUE-BB A.A.P.HC IEO	EUR	o		7.600
LU1646950854		ASSCVI-EUR.GV BD IAEO	EUR	o	2.160	2.160
LU1665237969		M+G(L)IF1-GL.LST.INF.EOCA	EUR	o	58.000	186.500
LU1756522998		FIDELITY-US DL BD YACCEOH	EUR	o	450.000	450.000
LU1883863778		AMF-P.US H.Y.BD I2 HGDEOA	EUR	o	1.390	1.390

IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE BRITISCHE PFUND

LU0210535463		JPM-STERL.BD JPMSB AA	GBP	o	146.000	146.000
--------------	--	-----------------------	-----	---	---------	---------

IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE JAPANISCHE YEN

LU1060955660		FIDELITY-JAPAN AGGR. YAYN	JPY	o		186.000
--------------	--	---------------------------	-----	---	--	---------

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES GETÄTIGTE KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG GENANNT SIND

ISIN	Zinssatz	Wertpapier	Währung	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal
IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE US DOLLAR						
IE0002420739		PIMCO GLI.-GL.H.Y.B.INS A	USD	0		25.000
IE00BYSZ5T81		SPDR BB.7-10Y.US.T.B.UETF	USD	0	200.000	200.000
IE00BYTRRB94		SPDR MSCI WORLD H.C.UETF	USD	0	48.200	48.200
LU0129487947		JPM-TAIWAN JPMT CADL	USD	0		17.400
LU0180621947		AVIVA INV.-EM.MK.BD I DL	USD	0	6.150	6.150
LU0248021593		JPM INV-US BD FD I AC.DL	USD	0	12.900	12.900
LU0248057431		JPM-PACIF.EQU.JPMPE IADL	USD	0	7.000	7.000
LU0270815920		SISF-TAIWANESE EQU.CACCDL	USD	0		226.000
LU0475887237		NORDEA 1-US CORP. BI DL	USD	0	184.000	184.000
LU0546914754		NN(L)-US FACT.CRED. PCDL	USD	0	1.460	1.460
LU0555027738		NN(L)-US CREDIT IC DL	USD	0	87	87
LU1003376065		ASSCVI-FRT.MKT.BD IADL	USD	0		22.400
LU1160528490		CS I.F.1-CS FIN.BD QBHD	USD	0		1.220
LU1806495575		A-A.I.US C. UCITSDLA	USD	0	62.000	62.000
LU1883863851		AMF-P.US H.Y.BD I2 UH.DLA	USD	0		64.000

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.

2. Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Verwaltungsgesellschaft

Ampega Investment GmbH, Charles-de-Gaulle-Platz 1, 50679 Köln.

Geschäftsführung

Dr. Thomas Mann
Sprecher
Mitglied der Geschäftsführung der Ampega Asset Management GmbH, Köln
Manfred Köberlein
Jürgen Meyer
Ralf Pohl (bis zum 31.01.2020)

Aufsichtsrat

Harry Ploemacher
Vorsitzender
Vorsitzender der Geschäftsführung der Ampega Asset Management GmbH, Köln
Dr. Immo Querner (bis zum 31.08.2020)
stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover
Dr. Jan Wicke (ab dem 01.09.2020)
stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstandes der Talanx AG, Hannover
Norbert Eickermann
Mitglied des Vorstandes der HDI Vertriebs AG, Hannover
Prof. Dr. Alexander Kempf
Direktor des Seminars für Allgemeine BWL und
Finanzierungslehre, Köln
Dr. Dr. Günter Scheipermeier
Rechtsanwalt, Köln
Gezeichnetes Kapital: Euro 6 Mio. (Stand 31.05.2020)
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

Fondsmanagement

ARTS Asset Management GmbH, Wien

Depotbank

Raiffeisen Bank International AG, Wien

Abschlussprüfer

DeloitteAudit Wirtschaftsprüfungs GmbH, Wien