

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

# Halbjahresbericht

vom 1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020 des

## **C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive**

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

# HALBJAHRESBERICHT

des **C-QUADRAT ARTS Total Return Defensive**, Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 2 InvFG 2011, für das Rechnungsjahr vom 1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020.

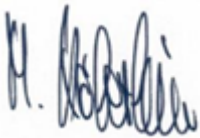
Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates sowie den Gesellschafterkreis finden sie im Abschnitt „Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft“.

Köln, im August 2020

Ampega Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Manfred Köberlein



Jürgen Meyer

# Zusammensetzung des Fondsvermögens

Fondsvermögen einschliesslich Veränderungen und aufgelöste Positionen								
ISIN	Wertpapier	Whrg	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>								
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>								
AT0000A05HR3	ERSTE BD EM CP EU R T	EUR	1.270	1.270		181,020000	229.895,40	8,06
DE000A141V76	ARAMEA GL.CONVERTIBL.PBVV	EUR	3.500	3.500		58,380000	204.330,00	7,17
DE000A2DHTX5	APUS CAPITAL REVALUE FO.I	EUR	1.500	1.500		58,890000	88.335,00	3,10
LU0165251116	LUXTOPIC-AKT.EUROPA INH.A	EUR	3.450	3.450		27,940000	96.393,00	3,38
LU0194436803	BNPP US SHORT DUR.BD CHEO	EUR	2.300	2.300		111,620000	256.726,00	9,01
LU0622306495	GSF-EM.MKTS COR.BD IA EOH	EUR	1.710	1.710		148,830000	254.499,30	8,93
LU0654799310	AVIVA INV.-E.M.C.BD IEOH	EUR	1.630	1.630		125,504100	204.571,68	7,18
LU0803997666	NN(L)-US CREDIT ICEOHI	EUR	27	66	39	6.867,680000	185.427,36	6,50
LU1075314754	FISCH U.-F.BD GL.CORP.BE	EUR	2.060	2.060		123,440000	254.286,40	8,92
LU1127970256	T. ROWE PR.-JAP.EQ. Q EUR	EUR	4.050	4.050		20,820000	84.321,00	2,96
LU1439084705	T.ROW.PR.-DY.GL.BD QHEO	EUR	24.930	26.500	1.570	9,710000	242.070,30	8,49
LU1587985224	BELLEVUE-BB A.A.P.HC IEO	EUR	380	936	556	232,520000	88.357,60	3,10
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE US DOLLAR</b>								
LU0351442933	SISF GLOB.CON.BD C AC.DL	USD	800	1.620	820	178,211500	126.773,25	4,45
LU0360484413	MSI-GLOB.CONVERT.BD Z	USD	4.450	4.450		40,140000	158.832,47	5,57
LU0403290215	UBS(L)EQ.-GR.CH.DL Q-A	USD	314	314		294,140000	82.126,94	2,88
LU0403296170	UBS(L)EQ.-CN O.DL Q-ACC	USD	409	409		248,400000	90.339,32	3,17
LU1120394736	JHH-JHH EM CORP.BD A2DL	USD	250	1.000	750	127,570000	28.358,97	0,99
LU1297691658	JPM.FDS-US HEDG.EQ.IACCDL	USD	650	650		129,560000	74.883,51	2,63
<b>INVESTMENTZERTIFIKATE DÄNISCHE KRONEN</b>								
LU0012195615	DAN.IN.SICAV-DENM.FOC. A	DKK	321	321		1.857,010000	79.980,17	2,81
<b>SUMME INVESTMENTZERTIFIKATE</b>							<b>2.830.507,67</b>	<b>99,29</b>
<b>SUMME DER NICHT ZUM AMTLICHEN HANDEL ODER EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT ZUGELASSENEN WERTPAPIERE</b>							<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>BANKGUTHABEN</b>								
EUR-Guthaben							23.085,50	0,81
<b>SUMME</b>							<b>23.085,50</b>	<b>0,81</b>
<b>ABGRENZUNGEN</b>								
SONSTIGE FORDERUNGEN							0,00	0,00
DIVIDENDENFORDERUNGEN							0,00	0,00
ZINSENANSPRÜCHE							-0,36	0,00
SOLLZINSEN							0,00	0,00
DIVERSE GEBÜHREN							-3.316,33	-0,12
FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN							541,13	0,02
LIEFERUNGS-/ZAHLUNGSGESCHÄFTE							0,00	0,00
<b>SUMME ABGRENZUNGEN</b>							<b>-2.775,56</b>	<b>-0,10</b>
<b>SUMME Fondsvermögen</b>							<b>2.850.817,61</b>	<b>100,00</b>

ERRECHNETER WERT 3328To1 C-QUADRAT ARTS Total Defensive fund of funds (AUS)	EUR	104,75
ERRECHNETER WERT 3328To2 C-QUADRAT ARTS Total Defensive fund of funds (TTH)	EUR	105,66
ERRECHNETER WERT 3328T22 C-QUADRAT ARTS Total Def. fund of fund (VTH) IT IA	EUR	108,23
ERRECHNETER WERT 3328T64 C-QUADRAT ARTS Total Defensive (TTH) IT retrofrei	EUR	95,39
UMLAUFENDE ANTEILE 3328To1 C-QUADRAT ARTS Total Defensive fund of funds (AUS)	STUECK	63,000
UMLAUFENDE ANTEILE 3328To2 C-QUADRAT ARTS Total Defensive fund of funds (TTH)	STUECK	936,760
UMLAUFENDE ANTEILE 3328T22 C-QUADRAT ARTS Total Def. fund of fund (VTH) IT IA	STUECK	25.312,000
UMLAUFENDE ANTEILE 3328T64 C-QUADRAT ARTS Total Defensive (TTH) IT retrofrei	STUECK	59,000

## UMRECHNUNGSKURSE/DEISENKURSE

VERMOEGENSWERTE IN FREMDER WAEHRUNG ZU DEN DEISEN/UMRECHNUNGSKURSEN  
PER 29.06.2020 IN EUR UMGERECHNET

WÄHRUNG	EINHEIT in EUR	KURS
Dänische Kronen	DKK 1 = EUR	7,453100
Euro	EUR 1 = EUR	1,000000
US Dollar	USD 1 = EUR	1,124600

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

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

### IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN

LU0132668087	UBAM-SWISS EQUITY I	CHF	0		199
LU0415184216	UBSLBF-GBL FLEX. QA SF	CHF	0	2.340	2.340
LU1159239273	SSGA LUX-SWITZ.IIN.EQU. P	CHF	0		880

### IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO

AT0000764873	AMU CENT+EAST EU BOND (T)	EUR	0		4.450
DE0009750125	UNI JAPAN	EUR	0		341
DE000A0YAEJ1	NORDIX RENTEN PLUS	EUR	0		2.172
DE000DK0ECS2	DEKA-UMWELTINVEST CF	EUR	0		610
FR0007009139	R-CO CONV.CONVERT.EUR. C	EUR	0		620
IE0005023910	ICS-BR ICS EUR.LIQ. ACC	EUR	0	1.060	1.060
IE0031295938	GOLDMAN S.-EO LIQ.INS.ACC	EUR	0	42	42
IE00B29M2K49	BNYM GF-L.-T.G.E.C EO DIS	EUR	0		24.900
IE00B567SW70	GAM STAR-CR.OPPS(EO)OA EO	EUR	0		14.700
IE00B6VHBN16	PFGIS.-PIM.C.SEC. INSTE OH	EUR	0		18.100
LU0039632921	UNIRENTACORP INH. A	EUR	0	3.750	3.750
LU0083138064	BNPP EURO MM EO CL.CAP	EUR	0	820	820
LU0099730524	DWS INS.-ESG EO MO.M.IC	EUR	0	22	22
LU0106820292	SISF EMERG.EUROPE C ACC	EUR	0	1.360	1.360
LU0144745956	CANDR.BDS-EO L.TERM INH.I	EUR	0	24	24
LU0156673039	CANDR.BDS-GLOBAL GOV. I	EUR	0	1.490	1.490
LU0159550820	DJE-GOLD+RESS.INH.I(EO)	EUR	0	550	550
LU0196152606	PAR.GRP L.I.-L.PR.EQ.EOIA	EUR	0	145	145
LU0280568261	AVIVA INV.-GL.CONV.IH.AEO	EUR	0	1.970	1.970
LU0291343910	SISF USD BOND C ACC EURH	EUR	0	1.700	1.700

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

ISIN	Wertpapier	Währung	Bestand	Zugänge Stk. Nominal	Abgänge Stk. Nominal
LU0345362361	FID.FDS-AS.PA.OP. YACCEO	EUR	0		2.470
LU0346388456	FID.FDS-EU.SM.C. YACC.EUR	EUR	0	3.250	3.250
LU0346390197	FID.FDS-EURO BOND Y AC.EO	EUR	0	8.000	8.000
LU0346390270	FID.FDS-EUR.H.Y.Y ACC.EUR	EUR	0		11.700
LU0358407707	UBSLBF - EUR FLEXIBLE QA	EUR	0	410	410
LU0493851454	ASHMORE-EM.MKTS COR.D.EOR	EUR	0	3.870	3.870
LU0546688564	NN(L)-HEALTH CARE PCEOHII	EUR	0	104	104
LU0568620131	AF AM.F.CASH EUR I2EOC	EUR	0	510	510
LU0748063848	SISF-EUROP.MKT.NEUTR.CAEO	EUR	0	610	610
LU0772943501	NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO	EUR	0		160
LU0823381016	BNPP EURO HY BD IC	EUR	0		560
LU0845699254	SISF-CH.LOC.CURR.BD AEOA	EUR	0	1.930	1.930
LU0934195610	ROB.GL.T.R.BD F.REG.DH EO	EUR	0	4.350	4.350
LU111708787	JSS-JSS INS.BD OPP.CACCEO	EUR	0		250
LU1160527849	CS I.F.1-CS FIN.BD QBE	EUR	0		209
LU1191877965	BGF-EUR.HI.YIELD BD D2EOD	EUR	0		11.000
LU1554272481	DPAM BDS L-GOV. GL.BEOHC	EUR	0	2.430	2.430
LU1582979222	M+G(L)IF1-EM H.C.BEOCHACC	EUR	0	25.000	25.000
LU1665237969	M+G(L)IF1-GL.LST.INF.EOCA	EUR	0		7.400

**IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE JAPANISCHE YEN**

LU0318940771	FID.FDS-JAPAN Y ACC.JPY	JPY	0		4.650
--------------	-------------------------	-----	---	--	-------

**IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE US DOLLAR**

IE0030759645	PIMCO GL I.-EM.MKTS INSA	USD	0	4.500	4.500
LU0106258741	SISF GLOB.CORP.BD C ACC	USD	0		10.900
LU0180621947	AVIVA INV.-EM.MK.BD I DL	USD	0	1.010	1.010
LU0209137388	JHH-J.H.H.GL.PR.EQ. A2A	USD	0		320
LU0248063595	JPM-US.AG.BD JPMUAB IADL	USD	0	2.260	2.260
LU0249553388	AB FCP I-EMER.M.DEBT I2DL	USD	0	8.200	8.200
LU0270815920	SISF-TAIWANESE EQU.CACCDL	USD	0		2.290
LU0346392052	FID.FDS-TAIWAN FD YACC.DL	USD	0		2.180
LU0360479504	MSI-EM.MKTS DEBT NAM.Z DL	USD	0	6.500	6.500
LU0605515963	FIDEL.FDS-GL.DIVID.YACCDL	USD	0		2.800
LU0896351102	FID.FDS-GBL BD FD YACCDL	USD	0	19.800	19.800
LU0981989386	G.SACHS-GL EQ.P.P.IA DL	USD	0		4.800
LU1332517231	JSS-JSS BD-T.RTN GL.CDLA	USD	0	2.500	2.500
LU1480985222	LO-ASIA VALUE BOND DLPUHC	USD	0		1.740

**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.

# Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft

## Verwaltungsgesellschaft

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

Die Ampega Investment GmbH gehört zur  
Ampega Asset Management GmbH.

## Geschäftsführung

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

Manfred Köberlein

Jürgen Meyer

Ralf Pohl (bis 31.01.2020)

## Aufsichtsrat, Stammkapital

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 30.06.2020)  
Das gezeichnete Kapital ist voll eingezahlt.

## Vertriebsstellen

Neben der Depotbank/Verwahrstelle können weitere  
Vertriebsstellen benannt werden.

## Fondsmanagement

ARTS Asset Management GmbH, Wien

## Depotbank

Raiffeisen Bank International AG, Wien

## Abschlussprüfer

DeloitteAudit Wirtschaftsprüfung GmbH, Wien