

# Rechenschaftsbericht

## C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced

1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023

OGAW-Sondervermögen





# RECHENSCHAFTSBERICHT

des **C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced**,  
Miteigentumsfonds gemäß § 2 Abs. 2 InvFG 2011, für das Rechnungsjahr vom 1. Januar 2023 bis 31. Dezember 2023.

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

die Ampega Investment GmbH legt hiermit den Bericht des **C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced** über das abgelaufene Rechnungsjahr vor. Dem Rechenschaftsbericht wurde die Preisberechnung vom 29.12.2023 zu Grunde gelegt.

Nähere Angaben über die Geschäftsführung, die Zusammensetzung des Aufsichtsrates sowie den Gesellschafterkreis finden Sie im Abschnitt "Angaben zu der Kapitalverwaltungsgesellschaft".

## Angaben zur Mitarbeitervergütung

|  |      |        |
|--|------|--------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns) | TEUR | 10.426 |
| davon feste Vergütung  | TEUR | 8.062  |
| davon variable Vergütung   | TEUR | 2.365  |
| Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen  | TEUR | n.a.   |
| Zahl der Mitarbeiter der KVG (ohne Risikoträger anderer Gesellschaften des Talanx-Konzerns)  |      | 84     |
| Höhe des gezahlten Carried Interest  | TEUR | n.a.   |
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütungen Risktaker  | TEUR | 4.160  |
| davon Geschäftsleiter  | TEUR | 1.526  |
| davon andere Führungskräfte  | TEUR | 2.204  |
| davon andere Risikoträger  | TEUR | n.a.   |
| davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen   | TEUR | 430    |
| davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe   | TEUR | n.a.   |

Die Angaben zu den Vergütungen sind dem zuletzt festgestellten Jahresabschluss der KVG entnommen und werden aus den Entgeltabrechnungsdaten des Jahres ermittelt. Zur Grundvergütung können Mitarbeiter und Geschäftsleiter eine leistungsorientierte Vergütung erhalten. Nähere Hinweise und Erläuterungen zum Vergütungssystem der Gesellschaft sind auf der Internetseite der Gesellschaft ([www.ampega.com](http://www.ampega.com)) erhältlich. Die Vergütung, die Risikoträger im Jahr von anderen Gesellschaften des Talanx Konzerns erhielten, wurde bei der Ermittlung der Vergütungen einbezogen.

Die jährliche Überprüfung der Vergütungspolitik durch die Gesellschaft hat ergeben, dass Änderungen der Vergütungspolitik nicht erforderlich sind.

Wesentliche Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik fanden daher im Berichtszeitraum nicht statt.

Vom Unternehmen ARTS Asset Management GmbH, an die das Portfoliomanagement ausgelagert ist, wurden uns folgende Informationen zur Mitarbeitervergütung übermittelt:

|  |      |       |
|--|------|-------|
| Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Auslagerungsunternehmen gezahlten Mitarbeitervergütung | TEUR | 3.362 |
| davon feste Vergütung  | TEUR | 3.304 |
| davon variable Vergütung   | TEUR | 58    |

|   |      |
|---|------|
| Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen | n.a. |
|---|------|

|   |    |
|---|----|
| Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens | 41 |
|---|----|

Stand: 31.12.2022

Köln, am 29. April 2024

Ampega Investment GmbH  
Die Geschäftsführung



Dr. Dirk Erdmann



Stefan Kampmeyer



Dr. Thomas Mann



Jürgen Meyer



Djam Mohebbi-Ahari

# Vergleichende Übersicht über die letzten vier Rechnungsjahre des Fonds

| Fondsvermögen gesamt in EUR |                |
|-----------------------------|----------------|
| 31.12.2023                  | 216.730.455,49 |
| 31.12.2022                  | 227.039.489,47 |
| 31.12.2021                  | 252.147.353,90 |
| 31.12.2020                  | 240.773.816,55 |
| 31.12.2019                  | 261.188.767,45 |

| Thesaurierungsfonds AT0000634704 in EUR | Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil | Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag | Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG |
|---|--|--------------------------------------|--------------------------------|
| <b>Geschäftsjahr</b>                    |  |                                      |                                |
| 31.12.2023                              | 203,01                                   | -3,3859                              | 0,0386                         |
| 31.12.2022                              | 199,45                                   | -5,7822                              | 0,0000                         |
| 31.12.2021                              | 217,29                                   | 23,8369                              | 3,8038                         |
| 31.12.2020                              | 196,44                                   | -0,9050                              | 0,0000                         |
| 31.12.2019                              | 187,91                                   | 7,9100                               | 0,0000                         |

| Vollthesaurierungsfonds AT0000A08EU8 in EUR | Errechneter Wert je Vollthesaurierungsanteil | Zur Vollthesaurierung verwendeter Ertrag |
|---|--|--|
| <b>Geschäftsjahr</b>                        |  |  |
| 31.12.2023                                  | 213,45                                       | -3,5048                                  |
| 31.12.2022                                  | 209,68                                       | -6,0404                                  |
| 31.12.2021                                  | 224,36                                       | 28,5947                                  |
| 31.12.2020                                  | 202,78                                       | -0,9204                                  |
| 31.12.2019                                  | 193,96                                       | 8,1400                                   |

| Vollthesaurierungsfonds AT0000A08EV6 in EUR | Errechneter Wert je Vollthesaurierungsanteil | Zur Vollthesaurierung verwendeter Ertrag |
|---|--|--|
| <b>Geschäftsjahr</b>                        |  |  |
| 31.12.2023                                  | 213,59                                       | -3,5347                                  |
| 31.12.2022                                  | 209,85                                       | -6,1125                                  |
| 31.12.2021                                  | 224,61                                       | 28,5552                                  |
| 31.12.2020                                  | 203,07                                       | -0,8441                                  |
| 31.12.2019                                  | 194,16                                       | 8,2000                                   |

| Thesaurierungsfonds AT0000A06P08 in PLN | Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil | Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag | Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG |
|---|--|--------------------------------------|--------------------------------|
| <b>Geschäftsjahr</b>                    |  |                                      |                                |
| 31.12.2023                              | 863,13                                   | -15,5887                             | 0,1691                         |
| 31.12.2022                              | 915,47                                   | -28,6549                             | 0,0000                         |
| 31.12.2021                              | 978,68                                   | 102,3845                             | 15,8759                        |
| 31.12.2020                              | 892,55                                   | -16,7994                             | 0,0000                         |
| 31.12.2019                              | 800,24                                   | 33,8700                              | 0,0000                         |

| Thesaurierungsfonds AT0000A0XH66 in CHF | Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil | Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag | Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG |
|---|--|--------------------------------------|--------------------------------|
| <b>Geschäftsjahr</b>                    |  |                                      |                                |
| 31.12.2023                              | 109,26                                   | -1,1807                              | 0,0203                         |
| 31.12.2022                              | 110,36                                   | 2,4704                               | 0,4898                         |
| 31.12.2021                              | 121,33                                   | 17,2448                              | 2,1096                         |
| 31.12.2020                              | 109,56                                   | 0,0361                               | 0,0000                         |
| 31.12.2019                              | 105,61                                   | 7,5900                               | 0,0000                         |

| Vollthesaurierungsfonds AT0000A139C4 in CZK | Errechneter Wert je Vollthesaurierungsanteil | Zur Vollthesaurierung verwendeter Ertrag |
|---|--|--|
| <b>Geschäftsjahr</b>                        |  |  |
| 31.12.2023                                  | 1.304,02                                     | 0,9092                                   |
| 31.12.2022                                  | 1.244,19                                     | 85,2929                                  |
| 31.12.2021                                  | 1.267,07                                     | 198,8115                                 |
| 31.12.2020                                  | 1.137,34                                     | -36,1844                                 |
| 31.12.2019                                  | 1.089,55                                     | 75,6400                                  |

| Vollthesaurierungsfonds AT0000A1H6A3 in PLN hedged | Errechneter Wert je Vollthesaurierungsanteil | Zur Vollthesaurierung verwendeter Ertrag |
|--|--|--|
| <b>Geschäftsjahr</b>                               |  |  |
| 31.12.2023   | 128,61                                       | 10,7079                                  |
| 31.12.2022   | 122,62                                       | 2,3717                                   |
| 31.12.2021   | 124,16                                       | 9,2871                                   |
| 31.12.2020   | 112,31                                       | -4,5416                                  |
| 31.12.2019   | 107,65                                       | 6,3100                                   |

| Thesaurierungsfonds AT0000A218G7 in EUR | Errechneter Wert je Thesaurierungsanteil | Zur Thesaurierung verwendeter Ertrag | Auszahlung gem. § 58 (2) InvFG |
|---|--|--------------------------------------|--------------------------------|
| <b>Geschäftsjahr</b>                    |  |                                      |                                |
| 31.12.2023                              | 108,50                                   | -0,9575                              | 0,0195                         |
| 31.12.2022                              | 105,76                                   | -2,2305                              | 0,0000                         |
| 31.12.2021                              | 114,67                                   | 12,4318                              | 2,3222                         |
| 31.12.2020                              | 103,49                                   | -0,7756                              | 0,0000                         |
| 31.12.2019                              | 99,92                                    | 4,1800                               | 0,6400                         |

# Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens

## Wertentwicklung im Rechnungsjahr (Fonds Performance)

Ermittlung der Werte nach OeKB-Berechnungsmethode pro Anteil in Fondswährung ohne Berücksichtigung eines Ausgabeaufschlages.

|   |          |
|---|----------|
| <b>Thesaurierungsanteil (AT0000634704)</b>  |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 199,48   |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 203,01   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | 3,56     |
| Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                                 | 1,78     |
| <b>Vollthesaurierungsanteil I (AT0000A08EU8)</b>  |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 209,68   |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 213,45   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | 3,77     |
| Wertentwicklung eines Vollthesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                             | 1,80     |
| <b>Vollthesaurierungsanteil IA (AT0000A08EV6)</b>   |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 209,85   |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 213,59   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | 3,74     |
| Wertentwicklung eines Vollthesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                             | 1,78     |
| <b>Thesaurierungsanteil PLN (AT0000A06P08)</b>  |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 915,47   |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 863,13   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | -52,34   |
| Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                                 | -5,72    |
| <b>Thesaurierungsanteil CHF (AT0000A0XH66)</b>  |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 110,36   |
| Auszahlung am 02.05.2023 (errechneter Wert: 109,16) von CHF 0,4898 (entspricht 0,004487 Anteilen) |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 109,26   |
| Gesamtwert inkl. durch Auszahlung erworbene Anteile (1,0045 * 109,26)                             | 109,75   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | -0,61    |
| Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                                 | -0,55    |
| <b>Vollthesaurierungsanteil IA CZK (AT0000A139C4)</b>   |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 1.244,19 |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 1.304,02 |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | 59,83    |
| Wertentwicklung eines Vollthesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                             | 4,81     |
| <b>Vollthesaurierungsanteil A PLN H (AT0000A1H6A3)</b>  |          |
| Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres  | 122,62   |
| Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres  | 128,61   |
| Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil   | 5,99     |
| Wertentwicklung eines Vollthesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %                             | 4,89     |

---

**Thesaurierungsanteil H (AT0000A218G7)**

|  |        |
|--|--------|
| <b>Errechneter Wert je Anteil am Beginn des Rechnungsjahres</b>          | 105,76 |
| <b>Errechneter Wert je Anteil am Ende des Rechnungsjahres</b>            | 108,50 |
| <b>Nettoertrag / Nettominderung pro Anteil</b>                           | 2,74   |
| <b>Wertentwicklung eines Thesaurierungsanteils im Rechnungsjahr in %</b> | 2,59   |

---

## Fondsergebnis

Ertragsrechnung für den Zeitraum vom 01.01.2023 bis 31.12.2023

| Ertragsrechnung<br>Kontogruppe/Konto                          | EUR            | EUR                  |
|---|----------------|----------------------|
| <b>A) Realisiertes Fondsergebnis (exkl. Ertragsausgleich)</b> |                | <b>-3.005.215,64</b> |
| <b>Ordentliches Fondsergebnis</b>                             |                | <b>-2.347.674,76</b> |
| <b>Erträge (ohne Kursergebnis)</b>                            |                | <b>2.238.910,55</b>  |
| Dividendenergebnis aus Subfonds                               | 620.705,47     |                      |
| Ergebnis Subfonds (inkl. tats. gefl. Ausschüt)                | 1.332.156,43   |                      |
| Sonstige Erträge (inkl. Tax Reclaim)                          | 43.115,48      |                      |
| Zinsaufwendungen (inkl. negativer Habenzinsen)                | 41.863,28      |                      |
| Zinsergebnis aus Cash Collateral                              | 82,22          |                      |
| Zinserträge   | 200.987,67     |                      |
| <b>Aufwendungen</b>   |                | <b>-4.586.585,31</b> |
| Zulassungskosten Ausland                                      | -22.961,19     |                      |
| Depotbankgebühren   | -112.383,39    |                      |
| Depotgebühren   | -62.366,39     |                      |
| Wirtschaftsprüfungskosten                                     | -14.058,71     |                      |
| Verwaltungskostenrückvergütung                                | 68.941,61      |                      |
| Verwaltungsgebühren   | -4.347.899,95  |                      |
| Pflicht- bzw. Veröffentlichungskosten                         | -23.483,00     |                      |
| Performancegebühren   | -72.374,29     |                      |
| <b>Realisiertes Kursergebnis</b>                              |                | <b>-657.540,88</b>   |
| ausschüttungsgleiche Erträge                                  | 1.351.481,90   |                      |
| Realisierte Gewinne   | 7.249.282,61   |                      |
| Verluste aus derivativen Instrumenten                         | -1.354.951,09  |                      |
| Realisierte Verluste  | -10.010.799,15 |                      |
| Gewinne aus derivativen Instrumenten                          | 2.107.444,85   |                      |
| <b>B) Nicht realisiertes Fondsergebnis</b>                    |                | <b>7.472.842,32</b>  |
| Veränderung des nicht realisierten Kursergebnisses            | 7.554.824,01   |                      |
| Veränderung der Dividendenforderungen                         | -81.981,69     |                      |
| <b>C) Ertragsausgleich</b>                                    |                | <b>145.552,23</b>    |
| Ertragsausgleich für Erträge des Rechnungsjahres              | 145.552,23     |                      |
| <b>Fondsergebnis gesamt</b>                                   |                | <b>4.613.178,91</b>  |

Das Ergebnis des Rechnungsjahres beinhaltet explizit ausgewiesene Transaktionskosten in Höhe von 343.919,78 EUR



## Entwicklung des Fondsvermögens

| Entwicklung des Fondsvermögens   |                | Vermögen in EUR       |
|--|----------------|-----------------------|
| <b>Fondsvermögen am 31.12.2022 (1.526.791,615 Anteile)</b>               |                | <b>227.039.489,47</b> |
| Auszahlung am 02.05.2023 (CHF 0,4898 x 14.342,77 Thesaurierungsanteilen) |                | -7.114,01             |
| <b>Mittelveränderung</b>   |                | <b>-14.915.098,88</b> |
| aus Zertifikatsabsatz  | 7.336.890,79   |                       |
| aus Zertifikatrücknahmen   | -22.106.437,44 |                       |
| Anteiliger Ertragsausgleich  | -145.552,23    |                       |
| <b>Fondsergebnis gesamt</b>  |                | <b>4.613.178,91</b>   |
| <b>Fondsvermögen am 31.12.2023 (1.437.105,259 Anteile)</b>               |                | <b>216.730.455,49</b> |

# Finanzmärkte und Anlagepolitik

## Finanzmärkte

Die internationalen Aktienindizes starteten ambivalent in die erste Handelswoche des Börsenjahres 2023. Während europäische Indizes den Jänner mit einer regelrechten Aufwärtsrally eröffneten, konnten weder US-amerikanische noch fernöstliche Indizes daran anschließen. So erreichte der EuroSTOXX 50 eine Steigerung von über 10 %. Aber auch der deutsche DAX konnte mit über 9% glänzen. Während US-amerikanische Indizes zur Mitte des Jäners aufholten, konnte der japanische Aktienindex Nikkei 225 hier nicht Schritt halten. Bis in den Mai hatten US-amerikanische als auch Werte aus Fernost immer wieder mit Abwärtsbewegungen zu kämpfen, so konnten ebendiese nicht mehr an ihre zwischenzeitlich positiven Tendenzen anschließen und mussten entsprechende Verluste hinnehmen, die trotz immer wieder aufkeimenden Erholungen nicht kompensiert werden konnten. Von medialer Seite stand neben den Zinserhöhungen der europäischen Zentralbank als auch der amerikanischen Fed sowie den geopolitischen Spannungen zwischen USA und China, vor allem die Notübernahme der Schweizer Großbank Credit Suisse durch die UBS, sowie den schon zuvor stattgefundenen Zusammenbruch der Silicon Valley Bank SVB und die daraus resultierenden Ängste einer erneuten „Bankenkrise“ im Vordergrund. Darüber hinaus wurden die anhaltenden Spannungen im Ukraine-Konflikt und die erste Abwicklung eines Flüssiggas-Handels (LNG) in Yuan medial beleuchtet. Vor diesem Hintergrund musste beispielsweise der EuroSTOXX 50 in der Spitze 6,46 % an Wert einbüßen, in Japan der Nikkei 225 ebenfalls knapp 6% und in Übersee der S&P 500 knapp 5 %. Anfang Juni konnten Aktienindizes aus Europa und Übersee wieder Aufwärtsbewegungen verzeichnen, allen voran jedoch der japanische Nikkei 225, der in der Spitze einen Anstieg von 9,12 % aufwies. Aber auch US-amerikanische Technologiewerte konnten in dieser Phase überzeugen. Der Sommer hingegen verlief zweigeteilt. Während in der ersten Hälfte des Sommers eine positive Stimmung vorherrschte, konnte der August nicht an diese anschließen und so konnte auch eine Aufwärtsbewegung gegen Ende des Sommers die negativen Tendenzen nicht wettmachen. Vordergründig waren hier der leichte Rückgang der Inflation, die erneute Zinsanhebung der Notenbanken EZB und Fed, welche weitere Zinsanhebungen für das Jahr 2023 vorhersagten, sowie die schwächelnde Wirtschaft Chinas. Anfang September kam es zu einer erneuten Abwärtsbewegung, allein Indizes aus Fernost, wie beispielsweise der japanische Nikkei 225, konnten im September zwischenzeitlich positive Tendenzen aufweisen. Anschließend kam es im Oktober zu einer Kehrtwende und Indizes aus Fernost büßten hier wiederum die positive Wertentwicklung ein. Vor allem europäische Handelsplätze lagen in der negativen

Stimmung voran, wobei auch die US-amerikanischen Indizes folgten. Überschattet wurde dieser Zeitraum vor allem von dem Anschlag auf ein Musikfestival in Israel und dem darauffolgenden aufflammenden Konflikt im Nahen Osten. In den letzten beiden Monaten der Berichtsperiode konnte eine Erholung verzeichnet werden. Neben neuen Höchstständen in Übersee, stieg auch der EuroSTOXX 50 erstmals seit 2007 über 4500 Punkte. Allein fernöstliche Indizes, wie der Nikkei 225, konnten nicht daran anschließen. Dieser musste in der ersten Hälfte des Dezembers mehr als 3%-Punkte einbüßen. Medial war neben dem Nahostkonflikt die Aussicht auf womöglich endende Zinsanhebungen der Zentralbanken präsent.

## Anlagepolitik

Der C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced verfügt über flexible Anlagerichtlinien. Er kann bis zu 50% in Aktienfonds und bis zu 100% in Anleihen- und Geldmarktfonds bzw. geldmarktnahe Fonds investieren. Bei der Umsetzung der Anlagepolitik wird verstärkt einem "Total Return Ansatz" gefolgt. Hierbei nutzt das Fondsmanagement ein von ARTS Asset Management entwickeltes technisches Handelsprogramm mit einer kurz- bis mittelfristig trendfolgenden Ausrichtung. Jene Fonds, die ein kurz- bis mittelfristig positives Trendverhalten zeigen, werden im Portfolio am stärksten gewichtet. Die Anlagestrategie orientiert sich nicht an einer Benchmark, angestrebt wird vielmehr längerfristig in allen Marktphasen einen absoluten Wertzuwachs zu erwirtschaften. Der Fonds wird aktiv gemanagt. In negativen Börsenzeiten kann der Aktienfondsanteil bis auf Null reduziert werden. In einem solchen Fall werden die Gelder größtenteils in Investmentfonds mit kurzlaufenden Festgeldern, Anleihen und Produkten mit starker Negativkorrelation zu den klassischen Aktienindizes investiert.

# Zusammensetzung des Fondsvermögens

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung                        | ISIN         | Währung | Bestand<br>31.12.2023 | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs                | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|--|--------------|---------|-----------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|-----------------------|------------------------------|
|  |              |         |                       |                    |                       | im Berichtszeitraum |                       |                              |
| <b>INVESTMENTZERTIFIKATE</b>               |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>208.662.590,27</b> | <b>96,28</b>                 |
| <b>INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>          |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>197.383.003,58</b> | <b>91,07</b>                 |
| AB FCP I-EURO.P.INC.I2                     | LU0249549782 | EUR     | 360.000               | 360.000            | 0                     | 14,2000             | 5.112.000,00          | 2,36                         |
| ACATIS IFK VALUE RENTEN A                  | DE000A0X7582 | EUR     | 31.100                | 212.000            | 180.900               | 40,8200             | 1.269.502,00          | 0,59                         |
| ALLIANZ INV OSTEU RF (T)                   | AT0000739255 | EUR     | 39.000                | 0                  | 0                     | 0,0000              | 1,00                  | 0,00                         |
| AMPEGA CR.OPPS R.FDS I(A)                  | DE000A2QFHD8 | EUR     | 23.200                | 37.800             | 14.600                | 94,4700             | 2.191.704,00          | 1,01                         |
| ASS.CR.-A.C.SUBD.A.COCCO I                 | LU0990655838 | EUR     | 3.850                 | 9.950              | 6.100                 | 839,2000            | 3.230.920,00          | 1,49                         |
| BGF-EMER.MKTS BD D2ACCEOH                  | LU0827877399 | EUR     | 182.000               | 182.000            | 0                     | 16,1800             | 2.944.760,00          | 1,36                         |
| BL.STR.-B.EM.MK.SH.D.D2EH                  | LU1706560163 | EUR     | 40.500                | 40.500             | 0                     | 107,1700            | 4.340.385,00          | 2,00                         |
| COMGEST MONDE I                            | FR0011007251 | EUR     | 165.000               | 166.650            | 1.650                 | 32,1200             | 5.299.800,00          | 2,45                         |
| DWS I.EO HY CORP. FC                       | LU0616840772 | EUR     | 31.500                | 60.500             | 29.000                | 174,3500            | 5.492.025,00          | 2,53                         |
| FID.FDS-EO CORP.BDS YA EO                  | LU0370787359 | EUR     | 288.000               | 288.000            | 0                     | 33,2100             | 9.564.480,00          | 4,41                         |
| FID.II-MSCI JAPAN I.PEOHA                  | IE00BYX5NH74 | EUR     | 192.000               | 330.000            | 138.000               | 7,7688              | 1.491.609,60          | 0,69                         |
| GS E.M.D.HC ICEOHI                         | LU0555020725 | EUR     | 580                   | 580                | 0                     | 5.090,6600          | 2.952.582,80          | 1,36                         |
| HSBC EURO CRED.SUB.BD ID                   | DE000A0HORA1 | EUR     | 77.000                | 77.000             | 0                     | 65,5300             | 5.045.810,00          | 2,33                         |
| ISHSIV-MSCI INDIA UC.ETF                   | IE00BZCQB185 | EUR     | 1.140.000             | 1.140.000          | 0                     | 7,7830              | 8.872.620,00          | 4,09                         |
| ISHSIV-EM DIVID.U.ETF DLD                  | IE00B652H904 | EUR     | 380.000               | 380.000            | 0                     | 13,3340             | 5.066.920,00          | 2,34                         |
| ISIV-E.MSCI WMF U.ETF DLA                  | IE00BP3QZ825 | EUR     | 246.000               | 246.000            | 0                     | 55,7100             | 13.704.660,00         | 6,32                         |
| ISIV-MWMFEETF DLA                          | IE000L5NW549 | EUR     | 2.330.000             | 2.330.000          | 0                     | 4,1165              | 9.591.445,00          | 4,43                         |
| JPM-EO.H.Y SH.DUR.B CAEO                   | LU1533169881 | EUR     | 24.000                | 28.000             | 24.200                | 115,5150            | 2.772.360,00          | 1,28                         |
| JPM-GL.SUS.EQ.JPMGSRCD EOH                 | LU1420294560 | EUR     | 6.900                 | 6.900              | 0                     | 222,8000            | 1.537.320,00          | 0,71                         |
| JPM.FDS-US HED.EQ.CACCEOH                  | LU1297691492 | EUR     | 17.300                | 26.500             | 9.200                 | 146,2800            | 2.530.644,00          | 1,17                         |
| LA FRANCAISE SUB DEB C                     | FR0010674978 | EUR     | 2.280                 | 3.950              | 6.540                 | 2.246,4300          | 5.121.860,40          | 2,36                         |
| LIF-600 MEDIA EOA                          | LU1834988195 | EUR     | 104.000               | 170.000            | 66.000                | 56,7330             | 5.900.232,00          | 2,72                         |
| MAGNA UMB.FD-M.N.FR.GA EO                  | IE00BFTW8Z27 | EUR     | 236.000               | 440.000            | 204.000               | 22,6190             | 5.338.084,00          | 2,46                         |
| MAN-GL.INV.G.OP I HGDEOA                   | IE000VA5W9H0 | EUR     | 86.600                | 86.600             | 0                     | 107,0900            | 9.273.994,00          | 4,28                         |
| NORDEA 1-EUR.FIN.DBT BIEO                  | LU0772943501 | EUR     | 73.600                | 118.000            | 44.400                | 192,8534            | 14.194.010,24         | 6,55                         |
| OAKSEMUF-FIERA OEMS A1EOA                  | IE00BKTNQ673 | EUR     | 250.000               | 250.000            | 0                     | 13,6010             | 3.400.250,00          | 1,57                         |
| PFGIS.-PIM.C.SEC. INSTEOH                  | IE00B6VHBN16 | EUR     | 345.000               | 345.000            | 0                     | 14,5000             | 5.002.500,00          | 2,31                         |
| ROBECO C.G.F.-R.F.I.B.I EO                 | LU0622664224 | EUR     | 57.650                | 57.650             | 0                     | 176,6800            | 10.185.602,00         | 4,70                         |
| ROBECO EUROP.HGH YLD IHEO                  | LU0226955762 | EUR     | 19.100                | 28.200             | 29.200                | 264,7600            | 5.056.916,00          | 2,33                         |
| SISF-EO CREDIT CONV.CA EO                  | LU0995119822 | EUR     | 9.600                 | 39.000             | 29.400                | 135,0529            | 1.296.507,84          | 0,60                         |
| SISF-FRONT.MKTS EQ.C A EO                  | LU0968301142 | EUR     | 23.000                | 23.000             | 0                     | 224,6459            | 5.166.855,70          | 2,38                         |
| VONTOBEL-US EQUITY HI-EOH                  | LU0368557038 | EUR     | 12.200                | 12.200             | 0                     | 433,0800            | 5.283.576,00          | 2,44                         |
| WMF(I)-W.EO HI.YI.BD SUNH                  | IE00BJRHVH04 | EUR     | 785.000               | 785.000            | 0                     | 12,0662             | 9.471.967,00          | 4,37                         |
| X(IE)-MSCI WRLD MOM. 1CDL                  | IE00BL25JP72 | EUR     | 420.000               | 420.000            | 0                     | 46,8550             | 19.679.100,00         | 9,08                         |
| <b>INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR</b>   |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>11.279.586,69</b>  | <b>5,20</b>                  |
| GS-INDIA EQUITY I ACC DL                   | LU0333811072 | USD     | 210.000               | 210.000            | 0                     | 40,9800             | 7.749.133,31          | 3,58                         |
| MSI-INDIAN EQUITY NA.Z DL                  | LU0360485733 | USD     | 44.500                | 44.500             | 0                     | 71,4900             | 2.864.621,13          | 1,32                         |
| T.ROWE P.-FRON.MK.EQ.Q DL                  | LU1079764939 | USD     | 52.000                | 106.000            | 54.000                | 14,2200             | 665.832,25            | 0,31                         |
| <b>DEVISENTERMINGESCHAEFTE</b>             |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>-47.753,61</b>     | <b>-0,02</b>                 |
| DTG EUR CHF 05.01.24                       | DTG173701    | EUR     | -1.462.985            | 0                  | 1.462.985             | 0,9284              | 39.554,16             | 0,02                         |
| DTG EUR CZK 05.01.24                       | DTG173697    | EUR     | -15.609.210           | 0                  | 15.609.210            | 24,7308             | -107.552,19           | -0,05                        |
| DTG EUR PLN 05.01.24                       | DTG173695    | EUR     | -3.442.799            | 0                  | 3.442.799             | 4,3315              | 20.244,42             | 0,01                         |
| <b>BANKGUTHABEN</b>                        |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>8.490.907,97</b>   | <b>3,92</b>                  |
| <b>EUR-Guthaben</b>                        |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>8.488.013,05</b>   | <b>3,92</b>                  |
| EUR-Guthaben                               |              |         |                       |                    |                       |                     | 8.488.013,05          | 3,92                         |
| <b>GUTHABEN IN SONSTIGEN EU-WAEHRUNGEN</b> |              |         |                       |                    |                       |                     | <b>1.517,03</b>       | <b>0,00</b>                  |
| CZK  |              |         |                       |                    |                       |                     | 511,40                | 0,00                         |

## Vermögensaufstellung zum 31.12.2023

| Gattungsbezeichnung  | ISIN | Währung | Bestand<br>31.12.2023 | Käufe /<br>Zugänge  | Verkäufe /<br>Abgänge | Kurs | Kurswert<br>in EUR    | % des<br>Fonds-<br>vermögens |
|--|------|---------|-----------------------|---------------------|-----------------------|------|-----------------------|------------------------------|
|  |      |         |                       | im Berichtszeitraum |                       |      |                       |                              |
| PLN  |      |         |                       |                     |                       |      | 1.005,63              | 0,00                         |
| <b>GUTHABEN/VERBINDLICHKEITEN IN NICHT-EU-WAEHRUNGEN</b>                     |      |         |                       |                     |                       |      | <b>1.377,89</b>       | <b>0,00</b>                  |
| CHF  |      |         |                       |                     |                       |      | 1.377,89              | 0,00                         |
| <b>ABGRENZUNGEN</b>  |      |         |                       |                     |                       |      | <b>-375.289,14</b>    | <b>-0,17</b>                 |
| DIVERSE GEBÜHREN   |      |         |                       |                     |                       |      | -454.180,58           | -0,21                        |
| FORDERUNGEN BESTANDSPROVISIONEN  |      |         |                       |                     |                       |      | 1.929,54              | 0,00                         |
| ZIFO_COL CASH_COLL_ERHALT_IG   |      |         |                       |                     |                       |      | -195,11               | -0,00                        |
| ZINSEANSPRÜCHE   |      |         |                       |                     |                       |      | 77.157,01             | 0,04                         |
| <b>Fondsvermögen</b>   |      |         |                       |                     |                       | EUR  | <b>216.730.455,49</b> | <b>100,00<sup>1)</sup></b>   |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH)                 |      |         |                       |                     |                       | EUR  | 203,01                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) I               |      |         |                       |                     |                       | EUR  | 213,45                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA              |      |         |                       |                     |                       | EUR  | 213,59                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) PLN             |      |         |                       |                     |                       | PLN  | 863,13                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) CHF             |      |         |                       |                     |                       | CHF  | 109,26                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA CZK          |      |         |                       |                     |                       | CZK  | 1.304,02              |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) A PLN H         |      |         |                       |                     |                       | PLN  | 128,61                |                              |
| Anteilwert Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) H               |      |         |                       |                     |                       | EUR  | 108,50                |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH)         |      |         |                       |                     |                       | STK  | 772.198,800           |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) I       |      |         |                       |                     |                       | STK  | 9.944,710             |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA      |      |         |                       |                     |                       | STK  | 78.885,451            |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) PLN     |      |         |                       |                     |                       | STK  | 50.803,000            |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) CHF     |      |         |                       |                     |                       | STK  | 12.908,621            |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) IA CZK  |      |         |                       |                     |                       | STK  | 301.628,783           |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) A PLN H |      |         |                       |                     |                       | STK  | 119.660,000           |                              |
| Umlaufende Anteile Klasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (TTH) H       |      |         |                       |                     |                       | STK  | 91.075,894            |                              |

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

## Devisenkurse (in Mengennotiz) per 28.12.2023

|                     |       |          |           |
|---------------------|-------|----------|-----------|
| Euro                | (EUR) | 1,00000  | = 1 (EUR) |
| Polnische Zloty     | (PLN) | 4,33025  | = 1 (EUR) |
| Schweizer Franken   | (CHF) | 0,92880  | = 1 (EUR) |
| Tschechische Kronen | (CZK) | 24,71900 | = 1 (EUR) |
| US Dollar           | (USD) | 1,11055  | = 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 /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|--|--------------|---------|--------------------|-----------------------|
| <b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE SCHWEIZER FRANKEN</b>   |              |         |                    |                       |
| AXA WF-SWITZERL.EQU. FT  | LU0087657408 | CHF     | 67.600             | 67.600                |
| LO FDS.-SF CR.BD(FOR.)NA   | LU0209983930 | CHF     | 365.000            | 365.000               |
| SISF SWISS EQUITY C ACC  | LU0106244444 | CHF     | 52.000             | 52.000                |
| VONTOBEL-SU.SF.BD I-SF   | LU0278084768 | CHF     | 39.500             | 39.500                |
| <b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE TSCHECHISCHE KRONEN</b> |              |         |                    |                       |
| GS CZ CROWN BD PCCZK   | LU0082087437 | CZK     | 98.500             | 98.500                |
| <b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE EURO</b>                |              |         |                    |                       |
| A.C.-ASS.CR.SE.ESG I   | LU0890803710 | EUR     | 5.900              | 5.900                 |
| AB FCP I-GL.HGH.YLD.I2HEO  | LU0448042472 | EUR     | 200.000            | 200.000               |
| AB FCP I-MORTG.INC. I2EOH  | LU1699968225 | EUR     | 680.000            | 680.000               |
| AB S.I-EM COR.DT P.I2AEOH  | LU0736563544 | EUR     | 0                  | 270.000               |
| ABSALON-EM CORP.DEBT.I EO  | LU1138630998 | EUR     | 76                 | 76                    |
| ABSALON-GLBL HIGH YL.I EO  | LU1138630212 | EUR     | 180                | 180                   |
| AF-AF.EQU.JAPTARG. IEOHC   | LU0797053906 | EUR     | 2.040              | 2.040                 |
| AF-AM.F.EM CO.BD IEOHC   | LU0755947800 | EUR     | 0                  | 6.000                 |
| AF-AMU.F.E.HY BD IEOC  | LU0119109980 | EUR     | 0                  | 1.290                 |
| AGIF-EUROPEQU.VAL. A EO  | LU1143163779 | EUR     | 9.100              | 9.100                 |
| AIS-AM.JAPT.EOCDHC   | LU1681037864 | EUR     | 6.900              | 6.900                 |
| ALLIANZ INV. NACH. RFD (A)   | AT0000A19NT8 | EUR     | 47.000             | 47.000                |
| AMF-E.M.S.T.BD I2 HGDEOA   | LU1882464198 | EUR     | 5.000              | 5.000                 |
| AMF-STRAT.BD I2 UH.EOA   | LU1883302660 | EUR     | 0                  | 95.500                |
| AMUNDI EO L.RAT.SRI ICAP3  | FR0007038138 | EUR     | 29                 | 29                    |
| AMUNDI ETF STOXX EURO.50   | FR0010790980 | EUR     | 8.600              | 80.600                |
| AMUNDI GERMAN EQUITY H DA  | DE000A0RL2F6 | EUR     | 24.100             | 24.100                |
| APOLLO NACH.HIGH YIELD T   | AT0000496179 | EUR     | 52.000             | 52.000                |
| ASHMORE-EM.MKTS L.C.B.EOR  | LU0493866056 | EUR     | 108.000            | 108.000               |

## 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 /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|---------------------------|--------------|---------|--------------------|-----------------------|
| ASSCVI-EM.CO.BD IAHEO     | LU0700927352 | EUR     | 0                  | 240.000               |
| AXA WLD-EURO STR.BDS ITEO | LU0227128450 | EUR     | 0                  | 30.500                |
| BANTL.SEL.-BANT.RET. IA   | LU0109659770 | EUR     | 41.000             | 41.000                |
| BGF-E.MKT.CORP.BD D2C EOH | LU1728038495 | EUR     | 0                  | 530.000               |
| BGF-EUROPEAN VALUE D2 EO  | LU0329592454 | EUR     | 51.000             | 51.000                |
| BGF-SUST.EM.COR.BD D2EOAH | LU1817796326 | EUR     | 0                  | 345.000               |
| BLACK.ST.-FIX.INC.STR.DEO | LU0438336421 | EUR     | 0                  | 38.500                |
| BLUEBAY FDS-EM.HY.C.B.IEO | LU0720470953 | EUR     | 19.200             | 19.200                |
| BLUEBAY-H.Y.ESG BD I-EO   | LU0242579596 | EUR     | 20.500             | 20.500                |
| BLUEBAY-I.G.ABS.RTN B.IEO | LU0627763740 | EUR     | 39.000             | 49.700                |
| BNPP LOCAL EM BD IRHEOC   | LU0823386916 | EUR     | 58.000             | 58.000                |
| BNPP US SHORT DUR.BD CHEO | LU0194436803 | EUR     | 41.000             | 41.000                |
| BNYMGF-G.SH.-D.H.Y.B.HEOH | IE00BD5CTX77 | EUR     | 4.750.000          | 4.750.000             |
| CANDR.BDS-EUR HY INH.I    | LU0144746509 | EUR     | 0                  | 3.950                 |
| CANDR.BDS-GLOBAL GOV.IEOH | LU0391256509 | EUR     | 69.500             | 69.500                |
| CS I.F.1-CS FIN.BD IBEO   | LU1160526791 | EUR     | 0                  | 9.650                 |
| DEKA-EUROPASELECT CF      | DE0009786186 | EUR     | 17.300             | 17.300                |
| DEKA-EUROPAVALUE CF       | LU0100187060 | EUR     | 60.000             | 60.000                |
| DNCA INV.-ALPHA BDS I EO  | LU1694789378 | EUR     | 24.600             | 89.400                |
| DNCA INV.-VALUE EUROPE I  | LU0284395984 | EUR     | 47.200             | 47.200                |
| DPAM BDS L-GOV. GL.FEOHA  | LU1554272481 | EUR     | 34.500             | 34.500                |
| DPAM L-BDS.EM SUST.FCEO   | LU0907928062 | EUR     | 25.000             | 25.000                |
| DWS INS.-ESG EO MO.M.IC   | LU0099730524 | EUR     | 1.960              | 1.960                 |
| DWS QI EUROP.EQUITY TFC   | DE000DWS25Q1 | EUR     | 29.500             | 29.500                |
| DWS QI EUROZONE EQUITY RC | DE0009778563 | EUR     | 37.500             | 37.500                |
| EDRF-EMERGING CDT I EO    | LU1080016071 | EUR     | 41.500             | 41.500                |
| FID.FDS-GL INDUSTR.YACCIO | LU0346389181 | EUR     | 0                  | 71.500                |
| FID.II-S+P 500 IDX PEOHA  | IE00BYX5N110 | EUR     | 640.000            | 640.000               |
| GAM M.B.-LOC.EM.BD BEOCAP | LU0256064774 | EUR     | 31.000             | 31.000                |
| GEN.INV.- EURO BOND BXEO  | LU0145476148 | EUR     | 24.100             | 24.100                |
| GEN.INV.-C.+E.EUR.BD BXEO | LU0145480769 | EUR     | 47.100             | 79.100                |
| GSF-EM.MKTS COR.BD IA EOH | LU0622306495 | EUR     | 0                  | 36.000                |
| HSBC GIF-EURO HGH YLD I C | LU0165129072 | EUR     | 0                  | 29.500                |
| INVESCO-INV.EURO EQ.CA.EO | LU1240329117 | EUR     | 146.000            | 146.000               |
| INVESCO-JAP.EQ.AD.CEOHCAP | LU0955866511 | EUR     | 216.000            | 216.000               |
| INVESCOMI STXE600 HEALC A | IE00B5MJYY16 | EUR     | 7.000              | 7.000                 |
| INVESCOMI STXE600 UTILITY | IE00B5MTXK03 | EUR     | 25.000             | 25.000                |
| IQAM SRI SPARTRUST M (AT) | AT0000AONVC5 | EUR     | 44.500             | 44.500                |
| ISH.STOXX EUROPE 50 U.ETF | DE0005933949 | EUR     | 0                  | 174.000               |
| ISH3-I.JPM.EMLGB.UETF DLD | IE00B5M4WH52 | EUR     | 180.000            | 180.000               |
| ISHSII-EO FR BD ESG EOD   | IE00BF5GB717 | EUR     | 3.710.000          | 3.710.000             |
| ISHSIV-ISH.C HGDEO ACC    | IE00BKT6VQ12 | EUR     | 3.660.000          | 3.660.000             |
| ISHSVII-MSCI E.DL H.ACC   | IE00BWZN1T31 | EUR     | 0                  | 940.000               |
| JAMS-JP.ST.AB.RE.BD IAEOH | IE00BLP58Q81 | EUR     | 0                  | 242.000               |
| JAMS-MERIAN G.DY.BD AEOHA | IE00B553LK51 | EUR     | 0                  | 207.000               |
| JPM FDS-EU.SEL.EQ.I AC.EO | LU0247995813 | EUR     | 19.000             | 19.000                |
| JPM-E.M.C.B JPMEMCB IAEOH | LU1306423655 | EUR     | 0                  | 52.000                |
| JPM-EO.HYB.JPMEHYB IAEO   | LU0248062605 | EUR     | 0                  | 48.500                |
| JPM-GLOB REI EQ EUR HDG A | IE0000UW95D6 | EUR     | 275.000            | 275.000               |
| JSS-JSS S.BD.TR GL.IEOAH  | LU1332518478 | EUR     | 54.600             | 54.600                |
| KATHREIN S.EM L BD(I)(T)  | AT0000A2HU91 | EUR     | 9.300              | 9.300                 |
| LA FRANCAISE-TRESORERIE I | FR0010609115 | EUR     | 165                | 165                   |
| LIF-600 INSURA. EOA       | LU1834987973 | EUR     | 86.000             | 86.000                |
| LOYS - LOYS GLOBAL S      | LU0277768098 | EUR     | 4.450              | 4.450                 |

## 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 /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|--|--------------|---------|--------------------|-----------------------|
| LYX I.-L.MSCIEMU VA. D   | LU1598690169 | EUR     | 56.000             | 56.000                |
| LYXOR FTSE MIB(DR)U.ETF D  | FR0010010827 | EUR     | 198.000            | 198.000               |
| LYXOR IF-LYX.SM.O.R.UECEIO   | LU1190417599 | EUR     | 0                  | 90.500                |
| M+G(L)1-E.IN.L.COR. CAEO   | LU1582984222 | EUR     | 0                  | 197.000               |
| M+G1-PAEUSUPAAL EOAC   | LU1670717674 | EUR     | 158.000            | 158.000               |
| MFVI-M.GLG G.EM.D.TR.ILHE  | IE00BD3B6G86 | EUR     | 0                  | 4.600                 |
| MUF-AMU.IBEX 35 UE DIS   | FR0010251744 | EUR     | 152.000            | 152.000               |
| MUF-AMU.MSCI INDIA2 UEOA   | FR0010361683 | EUR     | 380.000            | 380.000               |
| MUL-LYX.EO 2-10Y I.EX. A   | LU1390062245 | EUR     | 285.400            | 285.400               |
| N.B.I.FD.E.M.D.L.C.ACCIEO  | IE00B975F507 | EUR     | 370.000            | 370.000               |
| NIFLI-OST.EUR.H.INC. IAEO  | LU0556616935 | EUR     | 0                  | 34.400                |
| NORDEA 1-FLEX.FI BI-EO   | LU0915363070 | EUR     | 11.000             | 11.000                |
| R.(L)F.III-R.Q.LSDD. I EO  | LU0230242686 | EUR     | 6.000              | 6.000                 |
| SISF E.M.D.A.R.C ACC E HD  | LU0177222394 | EUR     | 363.000            | 363.000               |
| SISF EURO HIGH YIELD CAEO  | LU0849400030 | EUR     | 32.500             | 32.500                |
| SPDR MSCI EUR.CO.SER.UETF  | IE00BKWQ0N82 | EUR     | 50.700             | 50.700                |
| SPDR MSCI EUR.UTIL.UETF  | IE00BKWQ0P07 | EUR     | 23.700             | 23.700                |
| UBAM-DYNAMIC EURO BD I CP  | LU0132662635 | EUR     | 5.200              | 5.200                 |
| UBS FDSO-CMCI CO.CR.SF AHE   | IE00BMC5DV85 | EUR     | 80.600             | 169.600               |
| UBS FDSO-MSCI ACW.SF AAHE  | IE00BYM11K57 | EUR     | 122.000            | 122.000               |
| UBS(I).ETF-SP500 UE AAEOH  | IE00BD34DK07 | EUR     | 275.000            | 275.000               |
| UBSLFS-F.MSCI EMU LV EOAD  | LU1215454460 | EUR     | 146.000            | 146.000               |
| UBSLFS-MSCI EMU VAL. EOAA  | LU0950669845 | EUR     | 460.000            | 460.000               |
| UNIRENTA OSTEUROPA A   | LU0097169550 | EUR     | 351.500            | 351.500               |
| VANECK MSTR.DM DIV.UC.ETF  | NL0011683594 | EUR     | 0                  | 260.000               |
| VANGU. FTSE JPU ETF EOHA   | IE00BFMXY33  | EUR     | 132.000            | 132.000               |
| VON.TW.FOUR M.E.A.B.S.IEO  | LU1602255561 | EUR     | 26.500             | 26.500                |
| XTR.II EU.GO.BD S.D.S. 1C  | LU0321463258 | EUR     | 20.600             | 20.600                |
| XTR.II IT.GOV.BD0-15W. 1C  | LU0613540268 | EUR     | 0                  | 178.000               |
| XTR.MSCI EUR.COMM.SERV.1C  | LU0292104030 | EUR     | 50.500             | 50.500                |
| XTR.MSCIEUUTESGSC 1C   | LU0292104899 | EUR     | 60.500             | 60.500                |
| <b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE BRITISCHE PFUND</b> |              |         |                    |                       |
| PFI ETF-P.LS SH.MA.LSI   | IE00B622SG73 | GBP     | 99.000             | 99.000                |
| <b>IN SONSTIGE ORGANISIERTE MÄRKTE EINBEZOGENE INVESTMENTZERTIFIKATE U.S. DOLLAR</b>     |              |         |                    |                       |
| AXA WLD-GL.HGH Y.N.F T.DL  | LU0184631215 | USD     | 15.000             | 15.000                |
| BGF-USD H.YLD BD D ACC.DL  | LU0552552704 | USD     | 82.000             | 82.000                |
| HSBC GIF-GL.EM.MESGLDICDL  | LU0992595826 | USD     | 1.680.000          | 1.680.000             |
| ISHS V-M.WHCS ESG ETF DLD  | IE00BJ5JNZ06 | USD     | 0                  | 3.010.000             |
| MSI-INTL EQU.(E.US) Z  | LU1121079674 | USD     | 87.000             | 87.000                |
| PGIF-F.U.EM F.I.I DL ACC   | IE00BD2ZKP80 | USD     | 460.000            | 460.000               |
| SISF GL.HIGH YLD C ACC   | LU0189893794 | USD     | 95.000             | 95.000                |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                               | ISIN      | Währung | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|---|-----------|---------|--------------------|-----------------------|
| <b>DEISENTERMINGESCHAEFTE SCHWEIZER FRANKEN</b>   |           |         |                    |                       |
| DTG EUR CHF 01.12.23                              | DTG172721 | CHF     | 1.373.000          | 1.373.000             |
| DTG EUR CHF 01.12.23                              | DTG173700 | CHF     | 1.373.000          | 1.373.000             |
| DTG EUR CHF 03.11.23                              | DTG171898 | CHF     | 1.404.000          | 1.404.000             |
| DTG EUR CHF 03.11.23                              | DTG172720 | CHF     | 1.404.000          | 1.404.000             |
| DTG EUR CHF 06.01.23                              | DTG158103 | CHF     | 0                  | 84.000                |
| DTG EUR CHF 06.01.23                              | DTG158669 | CHF     | 84.000             | 84.000                |
| DTG EUR CHF 06.10.23                              | DTG171099 | CHF     | 1.434.000          | 1.434.000             |
| DTG EUR CHF 06.10.23                              | DTG171897 | CHF     | 1.434.000          | 1.434.000             |
| DTG EUR CHF 08.09.23                              | DTG170110 | CHF     | 1.429.000          | 1.429.000             |
| DTG EUR CHF 08.09.23                              | DTG171098 | CHF     | 1.429.000          | 1.429.000             |
| DTG EUR CHF 10.02.23                              | DTG158670 | CHF     | 82.000             | 82.000                |
| DTG EUR CHF 10.02.23                              | DTG158891 | CHF     | 1.441.000          | 1.441.000             |
| DTG EUR CHF 10.02.23                              | DTG160723 | CHF     | 1.523.000          | 1.523.000             |
| DTG EUR CHF 10.03.23                              | DTG160724 | CHF     | 1.569.000          | 1.569.000             |
| DTG EUR CHF 10.03.23                              | DTG162512 | CHF     | 1.569.000          | 1.569.000             |
| DTG EUR CHF 11.08.23                              | DTG169199 | CHF     | 1.412.000          | 1.412.000             |
| DTG EUR CHF 11.08.23                              | DTG170109 | CHF     | 1.412.000          | 1.412.000             |
| DTG EUR CHF 12.05.23                              | DTG163994 | CHF     | 1.560.000          | 1.560.000             |
| DTG EUR CHF 12.05.23                              | DTG165746 | CHF     | 1.560.000          | 1.560.000             |
| DTG EUR CHF 13.01.23                              | DTG158225 | CHF     | 0                  | 1.432.000             |
| DTG EUR CHF 13.01.23                              | DTG158890 | CHF     | 1.432.000          | 1.432.000             |
| DTG EUR CHF 14.04.23                              | DTG162513 | CHF     | 1.591.000          | 1.591.000             |
| DTG EUR CHF 14.04.23                              | DTG163993 | CHF     | 1.591.000          | 1.591.000             |
| DTG EUR CHF 14.07.23                              | DTG167818 | CHF     | 1.569.000          | 1.569.000             |
| DTG EUR CHF 14.07.23                              | DTG168826 | CHF     | 117.000            | 117.000               |
| DTG EUR CHF 14.07.23                              | DTG169198 | CHF     | 1.452.000          | 1.452.000             |
| DTG EUR CHF 16.06.23                              | DTG165747 | CHF     | 1.573.000          | 1.573.000             |
| DTG EUR CHF 16.06.23                              | DTG167817 | CHF     | 1.573.000          | 1.573.000             |
| <b>DEISENTERMINGESCHAEFTE TSCHECHISCHE KRONEN</b> |           |         |                    |                       |
| DTG EUR CZK 01.12.23                              | DTG172711 | CZK     | 380.410.000        | 380.410.000           |
| DTG EUR CZK 01.12.23                              | DTG173696 | CZK     | 380.410.000        | 380.410.000           |
| DTG EUR CZK 03.11.23                              | DTG171890 | CZK     | 384.860.000        | 384.860.000           |
| DTG EUR CZK 03.11.23                              | DTG172710 | CZK     | 384.860.000        | 384.860.000           |
| DTG EUR CZK 06.10.23                              | DTG171097 | CZK     | 391.400.000        | 391.400.000           |
| DTG EUR CZK 06.10.23                              | DTG171889 | CZK     | 391.400.000        | 391.400.000           |
| DTG EUR CZK 08.09.23                              | DTG170112 | CZK     | 390.340.000        | 390.340.000           |
| DTG EUR CZK 08.09.23                              | DTG171096 | CZK     | 390.340.000        | 390.340.000           |
| DTG EUR CZK 10.02.23                              | DTG158889 | CZK     | 398.660.000        | 398.660.000           |
| DTG EUR CZK 10.02.23                              | DTG160719 | CZK     | 398.660.000        | 398.660.000           |
| DTG EUR CZK 10.03.23                              | DTG160720 | CZK     | 403.290.000        | 403.290.000           |
| DTG EUR CZK 10.03.23                              | DTG162514 | CZK     | 403.290.000        | 403.290.000           |
| DTG EUR CZK 11.08.23                              | DTG169209 | CZK     | 386.690.000        | 386.690.000           |
| DTG EUR CZK 11.08.23                              | DTG170111 | CZK     | 386.690.000        | 386.690.000           |
| DTG EUR CZK 12.05.23                              | DTG163984 | CZK     | 388.420.000        | 388.420.000           |
| DTG EUR CZK 12.05.23                              | DTG165742 | CZK     | 388.420.000        | 388.420.000           |
| DTG EUR CZK 13.01.23                              | DTG158221 | CZK     | 0                  | 396.400.000           |
| DTG EUR CZK 13.01.23                              | DTG158888 | CZK     | 396.400.000        | 396.400.000           |
| DTG EUR CZK 14.04.23                              | DTG162515 | CZK     | 398.910.000        | 398.910.000           |
| DTG EUR CZK 14.04.23                              | DTG163983 | CZK     | 398.910.000        | 398.910.000           |
| DTG EUR CZK 14.07.23                              | DTG167820 | CZK     | 390.530.000        | 390.530.000           |
| DTG EUR CZK 14.07.23                              | DTG169208 | CZK     | 390.530.000        | 390.530.000           |
| DTG EUR CZK 16.06.23                              | DTG165743 | CZK     | 391.580.000        | 391.580.000           |
| DTG EUR CZK 16.06.23                              | DTG167819 | CZK     | 391.580.000        | 391.580.000           |



## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                | ISIN      | Währung | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|------------------------------------|-----------|---------|--------------------|-----------------------|
| <b>DEISENTERMINGESCHAEFTE EURO</b> |           |         |                    |                       |
| DTG EUR CHF 01.12.23               | DTG172721 | EUR     | 1.433.613          | 1.433.613             |
| DTG EUR CHF 01.12.23               | DTG173700 | EUR     | 1.436.042          | 1.436.042             |
| DTG EUR CHF 03.11.23               | DTG171898 | EUR     | 1.460.401          | 1.460.401             |
| DTG EUR CHF 03.11.23               | DTG172720 | EUR     | 1.462.805          | 1.462.805             |
| DTG EUR CHF 06.01.23               | DTG158103 | EUR     | 85.353             | 0                     |
| DTG EUR CHF 06.01.23               | DTG158669 | EUR     | 85.305             | 85.305                |
| DTG EUR CHF 06.10.23               | DTG171099 | EUR     | 1.503.822          | 1.503.822             |
| DTG EUR CHF 06.10.23               | DTG171897 | EUR     | 1.488.478          | 1.488.478             |
| DTG EUR CHF 08.09.23               | DTG170110 | EUR     | 1.486.730          | 1.486.730             |
| DTG EUR CHF 08.09.23               | DTG171098 | EUR     | 1.495.865          | 1.495.865             |
| DTG EUR CHF 10.02.23               | DTG158670 | EUR     | 83.402             | 83.402                |
| DTG EUR CHF 10.02.23               | DTG158891 | EUR     | 1.436.948          | 1.436.948             |
| DTG EUR CHF 10.02.23               | DTG160723 | EUR     | 1.544.155          | 1.544.155             |
| DTG EUR CHF 10.03.23               | DTG160724 | EUR     | 1.593.330          | 1.593.330             |
| DTG EUR CHF 10.03.23               | DTG162512 | EUR     | 1.582.930          | 1.582.930             |
| DTG EUR CHF 11.08.23               | DTG169199 | EUR     | 1.469.089          | 1.469.089             |
| DTG EUR CHF 11.08.23               | DTG170109 | EUR     | 1.466.251          | 1.466.251             |
| DTG EUR CHF 12.05.23               | DTG163994 | EUR     | 1.586.349          | 1.586.349             |
| DTG EUR CHF 12.05.23               | DTG165746 | EUR     | 1.597.215          | 1.597.215             |
| DTG EUR CHF 13.01.23               | DTG158225 | EUR     | 1.456.439          | 0                     |
| DTG EUR CHF 13.01.23               | DTG158890 | EUR     | 1.426.153          | 1.426.153             |
| DTG EUR CHF 14.04.23               | DTG162513 | EUR     | 1.608.240          | 1.608.240             |
| DTG EUR CHF 14.04.23               | DTG163993 | EUR     | 1.614.901          | 1.614.901             |
| DTG EUR CHF 14.07.23               | DTG167818 | EUR     | 1.606.627          | 1.606.627             |
| DTG EUR CHF 14.07.23               | DTG168826 | EUR     | 119.803            | 119.803               |
| DTG EUR CHF 14.07.23               | DTG169198 | EUR     | 1.507.945          | 1.507.945             |
| DTG EUR CHF 16.06.23               | DTG165747 | EUR     | 1.615.156          | 1.615.156             |
| DTG EUR CHF 16.06.23               | DTG167817 | EUR     | 1.607.891          | 1.607.891             |
| DTG EUR CZK 01.12.23               | DTG172711 | EUR     | 15.379.733         | 15.379.733            |
| DTG EUR CZK 01.12.23               | DTG173696 | EUR     | 15.520.604         | 15.520.604            |
| DTG EUR CZK 03.11.23               | DTG171890 | EUR     | 15.742.563         | 15.742.563            |
| DTG EUR CZK 03.11.23               | DTG172710 | EUR     | 15.589.582         | 15.589.582            |
| DTG EUR CZK 06.10.23               | DTG171097 | EUR     | 16.062.049         | 16.062.049            |
| DTG EUR CZK 06.10.23               | DTG171889 | EUR     | 16.041.641         | 16.041.641            |
| DTG EUR CZK 08.09.23               | DTG170112 | EUR     | 16.052.343         | 16.052.343            |
| DTG EUR CZK 08.09.23               | DTG171096 | EUR     | 16.052.805         | 16.052.805            |
| DTG EUR CZK 10.02.23               | DTG158889 | EUR     | 16.539.369         | 16.539.369            |
| DTG EUR CZK 10.02.23               | DTG160719 | EUR     | 16.777.913         | 16.777.913            |
| DTG EUR CZK 10.03.23               | DTG160720 | EUR     | 16.920.785         | 16.920.785            |
| DTG EUR CZK 10.03.23               | DTG162514 | EUR     | 17.065.420         | 17.065.420            |
| DTG EUR CZK 11.08.23               | DTG169209 | EUR     | 16.211.854         | 16.211.854            |
| DTG EUR CZK 11.08.23               | DTG170111 | EUR     | 15.936.122         | 15.936.122            |
| DTG EUR CZK 12.05.23               | DTG163984 | EUR     | 16.590.496         | 16.590.496            |
| DTG EUR CZK 12.05.23               | DTG165742 | EUR     | 16.570.819         | 16.570.819            |
| DTG EUR CZK 13.01.23               | DTG158221 | EUR     | 16.291.973         | 0                     |
| DTG EUR CZK 13.01.23               | DTG158888 | EUR     | 16.504.288         | 16.504.288            |
| DTG EUR CZK 14.04.23               | DTG162515 | EUR     | 16.818.730         | 16.818.730            |
| DTG EUR CZK 14.04.23               | DTG163983 | EUR     | 17.083.940         | 17.083.940            |
| DTG EUR CZK 14.07.23               | DTG167820 | EUR     | 16.383.835         | 16.383.835            |
| DTG EUR CZK 14.07.23               | DTG169208 | EUR     | 16.408.824         | 16.408.824            |
| DTG EUR CZK 16.06.23               | DTG165743 | EUR     | 16.654.474         | 16.654.474            |
| DTG EUR CZK 16.06.23               | DTG167819 | EUR     | 16.466.779         | 16.466.779            |
| DTG EUR PLN 01.12.23               | DTG172715 | EUR     | 3.298.243          | 3.298.243             |
| DTG EUR PLN 01.12.23               | DTG173694 | EUR     | 3.395.992          | 3.395.992             |

## Derivate

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

| Gattungsbezeichnung                           | ISIN      | Währung | Käufe /<br>Zugänge | Verkäufe /<br>Abgänge |
|---|-----------|---------|--------------------|-----------------------|
| DTG EUR PLN 03.11.23                          | DTG171896 | EUR     | 3.236.353          | 3.236.353             |
| DTG EUR PLN 03.11.23                          | DTG172714 | EUR     | 3.337.734          | 3.337.734             |
| DTG EUR PLN 06.10.23                          | DTG171093 | EUR     | 3.401.742          | 3.401.742             |
| DTG EUR PLN 06.10.23                          | DTG171895 | EUR     | 3.391.484          | 3.391.484             |
| DTG EUR PLN 08.09.23                          | DTG170106 | EUR     | 3.461.562          | 3.461.562             |
| DTG EUR PLN 08.09.23                          | DTG171092 | EUR     | 3.388.886          | 3.388.886             |
| DTG EUR PLN 10.02.23                          | DTG158885 | EUR     | 3.316.408          | 3.316.408             |
| DTG EUR PLN 10.02.23                          | DTG160717 | EUR     | 3.291.860          | 3.291.860             |
| DTG EUR PLN 10.03.23                          | DTG160718 | EUR     | 3.346.207          | 3.346.207             |
| DTG EUR PLN 10.03.23                          | DTG162506 | EUR     | 3.397.623          | 3.397.623             |
| DTG EUR PLN 11.08.23                          | DTG169203 | EUR     | 3.446.718          | 3.446.718             |
| DTG EUR PLN 11.08.23                          | DTG170105 | EUR     | 3.430.028          | 3.430.028             |
| DTG EUR PLN 12.05.23                          | DTG163992 | EUR     | 3.345.319          | 3.345.319             |
| DTG EUR PLN 12.05.23                          | DTG165748 | EUR     | 3.449.410          | 3.449.410             |
| DTG EUR PLN 13.01.23                          | DTG158219 | EUR     | 3.296.178          | 0                     |
| DTG EUR PLN 13.01.23                          | DTG158884 | EUR     | 3.309.021          | 3.309.021             |
| DTG EUR PLN 14.04.23                          | DTG162507 | EUR     | 3.379.566          | 3.379.566             |
| DTG EUR PLN 14.04.23                          | DTG163991 | EUR     | 3.416.321          | 3.416.321             |
| DTG EUR PLN 14.07.23                          | DTG167814 | EUR     | 3.459.658          | 3.459.658             |
| DTG EUR PLN 14.07.23                          | DTG169202 | EUR     | 3.486.197          | 3.486.197             |
| DTG EUR PLN 16.06.23                          | DTG165749 | EUR     | 3.464.823          | 3.464.823             |
| DTG EUR PLN 16.06.23                          | DTG167813 | EUR     | 3.529.939          | 3.529.939             |
| <b>DEISENTERMINGESCHAEFTE POLNISCHE ZLOTY</b> |           |         |                    |                       |
| DTG EUR PLN 01.12.23                          | DTG172715 | PLN     | 14.760.000         | 14.760.000            |
| DTG EUR PLN 01.12.23                          | DTG173694 | PLN     | 14.760.000         | 14.760.000            |
| DTG EUR PLN 03.11.23                          | DTG171896 | PLN     | 14.918.000         | 14.918.000            |
| DTG EUR PLN 03.11.23                          | DTG172714 | PLN     | 14.918.000         | 14.918.000            |
| DTG EUR PLN 06.10.23                          | DTG171093 | PLN     | 15.611.000         | 15.611.000            |
| DTG EUR PLN 06.10.23                          | DTG171895 | PLN     | 15.611.000         | 15.611.000            |
| DTG EUR PLN 08.09.23                          | DTG170106 | PLN     | 15.515.000         | 15.515.000            |
| DTG EUR PLN 08.09.23                          | DTG171092 | PLN     | 15.515.000         | 15.515.000            |
| DTG EUR PLN 10.02.23                          | DTG158885 | PLN     | 15.610.000         | 15.610.000            |
| DTG EUR PLN 10.02.23                          | DTG160717 | PLN     | 15.610.000         | 15.610.000            |
| DTG EUR PLN 10.03.23                          | DTG160718 | PLN     | 15.925.000         | 15.925.000            |
| DTG EUR PLN 10.03.23                          | DTG162506 | PLN     | 15.925.000         | 15.925.000            |
| DTG EUR PLN 11.08.23                          | DTG169203 | PLN     | 15.336.000         | 15.336.000            |
| DTG EUR PLN 11.08.23                          | DTG170105 | PLN     | 15.336.000         | 15.336.000            |
| DTG EUR PLN 12.05.23                          | DTG163992 | PLN     | 15.621.000         | 15.621.000            |
| DTG EUR PLN 12.05.23                          | DTG165748 | PLN     | 15.621.000         | 15.621.000            |
| DTG EUR PLN 13.01.23                          | DTG158219 | PLN     | 0                  | 15.516.000            |
| DTG EUR PLN 13.01.23                          | DTG158884 | PLN     | 15.516.000         | 15.516.000            |
| DTG EUR PLN 14.04.23                          | DTG162507 | PLN     | 15.904.000         | 15.904.000            |
| DTG EUR PLN 14.04.23                          | DTG163991 | PLN     | 15.904.000         | 15.904.000            |
| DTG EUR PLN 14.07.23                          | DTG167814 | PLN     | 15.470.000         | 15.470.000            |
| DTG EUR PLN 14.07.23                          | DTG169202 | PLN     | 15.470.000         | 15.470.000            |
| DTG EUR PLN 16.06.23                          | DTG165749 | PLN     | 15.740.000         | 15.740.000            |
| DTG EUR PLN 16.06.23                          | DTG167813 | PLN     | 15.740.000         | 15.740.000            |

## 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 Balanced (VTH) CZK wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 1.308.135,56 CZK ( 0,333 % des Netto-Inventarwertes) eingehoben. Für die Anteilklasse C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced (VTH) A PLN H wurde in der Berichtsperiode eine erfolgsbezogene Vergütung (Performance Fee) in Höhe von 83.357,15 PLN ( 0,542 % 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.

Den enthaltenen Unterfonds, die nicht in eigener Verwaltung stehen, wurden von deren jeweils verwaltenden Kapitalanlagegesellschaften Verwaltungsentschädigungen zwischen 0,2 % und 1,72 % p. a. verrechnet. Für den Kauf der Anteile wurden von diesen Fondsgesellschaften keine Ausgabeaufschläge in Rechnung gestellt.

# Bestätigungsvermerk

## Bericht zum Rechenschaftsbericht

### Prüfungsurteil

Wir haben den Rechenschaftsbericht der Ampega Investment GmbH, über den von ihr verwalteten

C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced, Miteigentumsfonds gemäß Investmentfondsgesetz 2011 idGF (InvFG)

bestehend aus der Vermögensaufstellung zum 31. Dezember 2023, der Ertragsrechnung für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr und den sonstigen in Anlage I Schema B Investmentfondsgesetz 2011 (InvFG 2011) vorgesehenen Angaben, geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht der Rechenschaftsbericht den gesetzlichen Vorschriften und vermittelt ein möglichst getreues Bild der Vermögens- und Finanzlage zum 31. Dezember 2023 sowie der Ertragslage des Fonds für das an diesem Stichtag endende Rechnungsjahr in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung gemäß § 49 Abs 5 InvFG 2011 in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Diese Grundsätze erfordern die Anwendung der International Standards on Auditing (ISA). Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt "Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts" unseres Bestätigungsvermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Gesellschaft unabhängig in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und wir haben unsere sonstigen beruflichen Pflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

### Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen alle Informationen im Rechenschaftsbericht, ausgenommen die Vermögensaufstellung, die Ertragsrechnung, die sonsti-

gen in Anlage I Schema B InvFG 2011 vorgesehenen Angaben und den Bestätigungsvermerk.

Unser Prüfungsurteil zum Rechenschaftsbericht erstreckt sich nicht auf diese sonstigen Informationen und wir geben dazu keine Art der Zusicherung.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Rechenschaftsberichts haben wir die Verantwortlichkeit, diese sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zum Rechenschaftsbericht oder zu unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf der Grundlage der von uns zu den vor dem Datum des Bestätigungsvermerks des Abschlussprüfers erlangten sonstigen Informationen durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

### Verantwortlichkeiten der gesetzlichen Vertreter und des Aufsichtsrats für den Rechenschaftsbericht

Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Aufstellung des Rechenschaftsberichts und dafür, dass dieser in Übereinstimmung mit den österreichischen unternehmensrechtlichen Vorschriften und den Bestimmungen des InvFG 2011 ein möglichst getreues Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage des Fonds vermittelt. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachten, um die Aufstellung eines Rechenschaftsberichts zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Der Aufsichtsrat ist verantwortlich für die Überwachung des Rechnungslegungsprozesses der Gesellschaft betreffend den von ihr verwalteten Fonds.

### Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Rechenschaftsberichts

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Rechenschaftsbericht als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist und einen Bestätigungsvermerk zu

erteilen, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieses Rechenschaftsberichts getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit den österreichischen Grundsätzen ordnungsmäßiger Abschlussprüfung, die die Anwendung der ISA erfordern, üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung.

Darüber hinaus gilt:

- Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Rechenschaftsbericht, planen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken, führen sie durch und erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- Wir gewinnen ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- Wir beurteilen die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängende Angaben.
- Wir beurteilen die Gesamtdarstellung, den Aufbau und den Inhalt des Rechenschaftsberichts einschließlich der Angaben sowie ob der Rechenschaftsbericht die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse in einer Weise wiedergibt, dass ein möglichst getreues Bild erreicht wird.

Wir tauschen uns mit dem Aufsichtsrat unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung erkennen, aus.

Wien, am 29. April 2024

Deloitte Audit Wirtschaftsprüfungs GmbH

Dipl.-Kffr. Karen Burghardt  
Wirtschaftsprüferin

## Anhang gemäß Offenlegungsverordnung

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts:

C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5299003BG980I9OJQG18

## Ökologische- und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es \_% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



## Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Dieses Finanzprodukt trägt zu keinem Umweltziel im Sinne von Art. 9 der Taxonomieverordnung bei.

Der C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced strebt moderates Kapitalwachstum an.

Die Anlagestrategie des C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced wird aktiv gemanagt und orientiert sich nicht an einer Benchmark. Es wird vielmehr, auf langfristige Sicht gesehen, angestrebt einen absoluten Wertzuwachs zu erwirtschaften.

Für den Fonds durften nachstehende Vermögenswerte nach Maßgabe des InvFG ausgewählt werden.

Der Investmentfonds veranlagte zumindest 51 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds, die nach Art. 8 oder 9 gem. Verordnung (EU) 2019/2088 („Offenlegungsverordnung“) eingestuft sind. Dabei war der Erwerb von Aktienfonds auf 50 vH des Fondsvermögens begrenzt. Dabei konnten auch Anteile an Investmentfonds erworben werden, die eine – im Verhältnis zu einer bestimmten Marktentwicklung – neutrale oder gegenläufige Wertentwicklung anstreben.

Der direkte Erwerb von Aktien und Aktien gleichen Wertpapieren sowie von Anleihen war in Summe mit 49 vH des Fondsvermögens begrenzt, wobei die gesamte Aktienquote, d.h. Aktien und Aktien gleichen Wertpapiere sowie Aktienfonds, 50 vH des Fondsvermögens nicht überschritten wurde. Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) durften bis zu 49 vH des Fondsvermögens erworben werden.

Derivative Instrumente durften als Teil der Anlagestrategie bis zu 49 vH des Fondsvermögens (Berechnung nach Marktpreisen) und zur Absicherung eingesetzt werden.

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten durften bis zu 49 vH des Fondsvermögens gehalten werden. Es war kein Mindestbankguthaben zu halten.

### ● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

#### Indikator

Fonds, die gemäß Artikel 8 oder 9 der OffVO klassifiziert sind

#### Beschreibung

Als nachhaltig gelten die Fonds, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben und die Prinzipien der guten Unternehmensführung beachten oder eine nachhaltige Investition anstreben. Dabei wird insbesondere darauf geachtet, dass ausschließlich in Zielfonds investiert wird, welche als Fonds gemäß Artikel 8 oder 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (OffVO) klassifiziert und als solche beworben werden.

#### Methodik

Überprüfung, ob die Fonds gemäß OffVO nach Artikel 8 oder 9 klassifiziert sind.

#### Indikator

Fonds, die nach MiFID-II klassifiziert sind

#### Beschreibung

Es wird in Zielfonds investiert, die nach Artikel 2 Nr. 7 der delegierten Verordnung (EU) 2017/565 (geändert durch Delegierte Verordnung 2021/1253) (MiFID-II)

- (a) einen Mindestanteil in ökologisch nachhaltige Investitionen im Sinne von Artikel 2 Nummer 1 der Verordnung (EU) 2020/852;
- (b) einen Mindestanteil in nachhaltige Investitionen im Sinne von Artikel 2 Nummer 17 der Verordnung (EU) 2019/2088;
- (c) eine Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren vorweisen oder einer Kombination dessen entsprechen.

#### Methodik

Überprüfung, ob die Fonds gemäß Offenlegungsverordnung nach Artikel 8 oder 9 klassifiziert sind. Ausgewiesen wird der marktgewichtete prozentuale Anteil.

#### ● ESG Kennzahlen

| Referenzstichtag   | 31.12.2023 |
|--|------------|
| Fonds, die gemäß Artikel 8 oder 9 der OffVO klassifiziert sind | 58,30 %    |
| Fonds, die nach MiFID-II klassifiziert sind                    | 32,27 %    |
| Anteil Investitionen mit E/S-Merkmal                           | 58,26%     |
| Anteil der sonstigen Investitionen                             | 41,74%     |

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



#### Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Steuerung nach den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impact) ist in diesem Fonds kein Bestandteil der Anlagestrategie.





**Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?**

Zu den Hauptinvestitionen zählen die 15 Positionen des Wertpapiervermögens mit dem höchsten Durchschnittswert der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:

01.01.2023 - 31.12.2023

| Größte Investitionen  | Sektor                       | In % der Vermögenswerte | Land      |
|---|------------------------------|-------------------------|-----------|
| UBS ETF CMCI Commodity Carry SF UCITS ETF (IE00BMC5DV85)          | Treuhand- und sonstige Fonds | 4,41%                   | Irland    |
| DWS Invest - Euro High Yield Corporates FC (LU0616840772)         | Treuhand- und sonstige Fonds | 3,58%                   | Luxemburg |
| AB - Mortgage Income Portfolio-I2 (LU1699968225)                  | Treuhand- und sonstige Fonds | 2,87%                   | Luxemburg |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF (IE00BKT6VQ12)                   | Treuhand- und sonstige Fonds | 2,52%                   | Irland    |
| Lyxor EUR 2-10Y Inflation Expectations UCITS ETF (LU1390062245)   | Treuhand- und sonstige Fonds | 2,15%                   | Luxemburg |
| JPM Europe High Yield Short Duration Bond (LU1533169881)          | Treuhand- und sonstige Fonds | 2,02%                   | Luxemburg |
| UniEuroAspirant A (LU0097169550)                                  | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,91%                   | Luxemburg |
| Generali Investments SICAV - Central & Eastern Eur (LU0145480769) | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,68%                   | Luxemburg |
| Deutsche Institutional-ESG Money Plus IC (LU0099730524)           | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,63%                   | Luxemburg |
| UBS ETF MSCI ACWI SF UCITS ETF (IE00BYM1K57)                      | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,51%                   | Irland    |
| DNCA Invest - Value Europe (LU0284395984)                         | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,51%                   | Luxemburg |
| Invesco Euro Equity Fund (LU1240329117)                           | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,50%                   | Luxemburg |
| HSBC Global Investment Funds - Global Emerging Mar (LU0992595826) | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,46%                   | Luxemburg |
| M&G Lux Investment Funds 1 - M&G Lux Pan European (LU1670717674)  | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,37%                   | Luxemburg |
| Robeco European High Yield Bonds Class I (LU0226955762)           | Treuhand- und sonstige Fonds | 1,35%                   | Luxemburg |



**Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?**

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

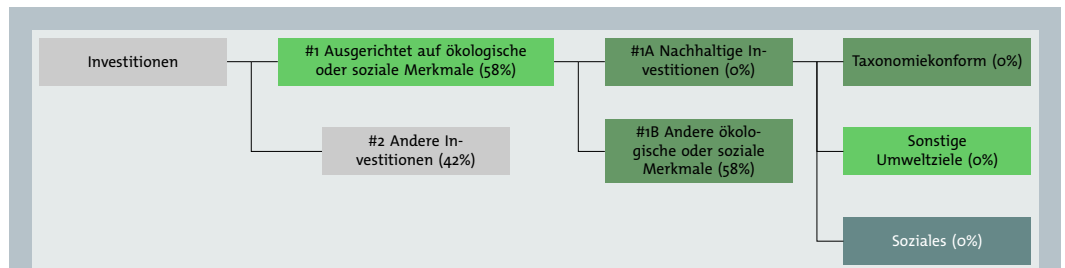
● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensgegenstände des Fonds werden in nachstehender Grafik in verschiedene Kategorien unterteilt. Der jeweilige Anteil am Fondsvermögen wird in Prozent dargestellt. Mit „Investitionen“ werden alle für den Fonds erwerbbaaren Vermögensgegenstände erfasst.

Die Kategorie „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ umfasst diejenigen Vermögensgegenstände, die im Rahmen der Anlagestrategie zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt werden.

Die Kategorie „#2 Andere Investitionen“ umfasst z. B. Derivate, Bankguthaben oder Finanzinstrumente, für die nicht genügend Daten vorliegen, um sie für die nachhaltige Anlagestrategie des

Fonds bewerten zu können.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### ● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Es wird für alle Positionen des Wertpapiervermögens der Durchschnitt der Kurswerte über alle Bewertungsstichtage je Wirtschaftssektor gebildet. Die Bewertungsstichtage sind die letzten Bewertungstage eines jeden Monats im Berichtszeitraum einschließlich des Berichtsstichtages. Die Angabe erfolgt in Prozent des durchschnittlichen Fondsvermögens über alle Berichtsstichtage.

| Branche   | Anteil |
|---|--------|
| Treuhand- und sonstige Fonds                    | 89,41% |
| Erbringung von sonstigen Finanzdienstleistungen | 5,33%  |
| Fondsmanagement                                 | 2,36%  |
| Beteiligungsgesellschaften                      | 0,26%  |



### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hat keine nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel nach EU-Taxonomieverordnung getätigt. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.

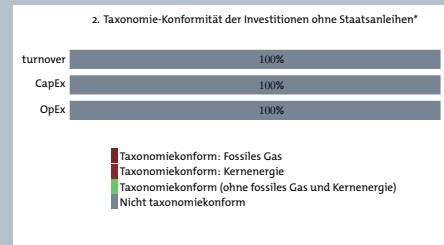
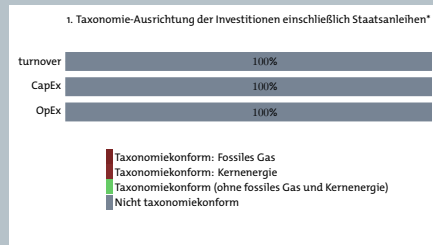
**Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

- Ja
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

Taxonmiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

In den nachstehenden Diagrammen ist in abgesetzter Farbe der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Für diesen Fonds wurden keine Investitionen getätigt, die in Übergangstätigkeiten oder ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind. Der Mindestanteil taxonomiekonformer Investitionen wird daher zum Berichtsstichtag mit 0 Prozent ausgewiesen.

**Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Unter #2 „Andere Investitionen“ fielen Investitionen, die nicht zu ökologischen oder sozialen Merkmalen beitragen. Hierunter fallen beispielsweise Derivate, Investitionen zu Diversifikationszwecken, Investitionen, für die keine Daten vorliegen, oder Barmittel zur Liquiditätssteuerung. Beim Erwerb dieser Vermögensgegenstände wurde mit Ausnahme der Mindestausschlüsse, welche für Investitionen zu Diversifikationszwecke greifen, kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz berücksichtigt.

**Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Fonds wandte Ausschlusskriterien an.

Investitionen in Unternehmen, die gegen den UN-Global Compact verstoßen, galten als nicht investierbar. Abgedeckt wurden in diesem Zusammenhang auch die Themenbereiche Zwangsarbeit, Kinderarbeit und Diskriminierung. Als Bewertungsrichtlinien für Kontroversen im Bereich der Umweltprobleme wurden u.a. das Prinzip der besten verfügbaren Technik (BVT) sowie internationale Umweltgesetzgebungen herangezogen. Investitionen in Unternehmen, die im Zusammenhang mit geächteten Waffen (gemäß „Ottawa-Konvention“, „Oslo-Konvention“ und den UN-Konventionen „UN BWC“, „UN CWC“) stehen, wurden nicht getätigt. Investitionen in Unternehmen, die einen signifikanten Umsatzanteil aus der Verstromung von Kohle oder Gewinnung von Ölsanden generieren, waren ausgeschlossen.

Bei Investitionen in Staaten wurden Länder mit einer niedrigen Nachhaltigkeitsbewertung ausgeschlossen. Dimensionen der Bewertung umfassen Umwelt-, Soziale- und Regierungsaktivitäten, die internationalen Konventionen und Normen entsprechen. Hierfür wurde eine Analyse relevanter Kontroversen, wie beispielsweise Korruption, Umweltverschmutzung oder Meinungsfreiheit zu Grunde gelegt.

Staaten, die gegen globale Normen wie den „Freedom House Index“ verstoßen, wurden zudem ausgeschlossen. Der Investmentfonds veranlagt mindestens 51 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds, die nach Art. 8 oder 9 gem. Offenlegungsverordnung eingestuft sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

**Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Für diesen Fonds nicht einschlägig.

## Steuerliche Behandlung

Mit Inkrafttreten des neuen Meldeschemas (ab 06.06.2016) wird die steuerliche Behandlung von der Österreichischen Kontrollbank (OeKB) erstellt und auf [www.profitweb.at](http://www.profitweb.at) veröffentlicht. Die Steuerdateien stehen für sämtliche Fonds zum Download zur Verfügung. Hinsichtlich Detailangaben zu den anrechenbaren bzw. rückerstattbaren ausländischen Steuern verweisen wir auf die Homepage [www.profitweb.at](http://www.profitweb.at)

## Berechnungsmethode des Gesamtrisikos: Value-at-Risk

Vergleichsvermögen: KEINES, da absoluter VaR von 14 %

Risikomodell:

Multi-Faktor-Modell mit Monte Carlo Simulation

Minimum VaR: 1,50 %

Durchschnitt VaR: 3,71 %

Maximum VaR: 5,94 %

## Angaben zur Transparenz gemäß Verordnung (EU) 2020/852 bzw. Angaben nach Art. 11 Offenlegungsverordnung

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Die Steuerung nach den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (Principal Adverse Impact) ist in diesem Fonds kein Bestandteil der Anlagestrategie.

Die Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich der Auswirkungen von Emittenten auf Nachhaltigkeitsfaktoren, ist jedoch ein integraler Bestandteil der Investitionsanalyse des

Fonds. Zu den Nachhaltigkeitsfaktoren gehören Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, die Achtung der Menschenrechte, sowie die Bekämpfung von Korruption und Bestechung. Für Investments, die entsprechend den der Überwachung zugrundeliegenden ESG-Daten als kontroverse Waffenhersteller klassifiziert sind, gilt ein absoluter Ausschluss. Ein derartiger Ausschluss gilt - vorbehaltlich vereinbarter Limite - auch für Anlagen von bzw. mit Bezug zu Emittenten, die gemäß den von der Gesellschaft verwendeten Daten mit den UN Global Compact Kriterien nicht konform sind.

Gemäß der festgestellten wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen auf Ebene der Gesellschaft werden für die verschiedenen Assetklassen in diesem Zusammenhang Maßnahmen definiert, um die nachteiligen Nachhaltigkeitsauswirkungen zu reduzieren. Zusätzlich ist die Gesellschaft Unterzeichner der Principles for Responsible Investment (PRI) und verpflichtet sich damit zum Ausbau nachhaltiger Geldanlagen und zur Einhaltung der sechs, durch die UN aufgestellten Prinzipien für verantwortliches Investieren.

## Fondsbestimmungen gemäß InvFG 2011

Die Fondsbestimmungen für den Investmentfonds **C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced**, Miteigentumsfonds gemäß **Investmentfondsgesetz 2011 idgF (InvFG)**, wurden von der Finanzmarktaufsicht (FMA) genehmigt.

Der Investmentfonds ist ein Organismus zur gemeinsamen Veranlagung in Wertpapieren (OGAW) und wird von der Ampega Investment GmbH (nachstehend „Verwaltungsgesellschaft“ genannt) mit Sitz in Köln/Deutschland verwaltet.

### Artikel 1 Miteigentumsanteile

Die Miteigentumsanteile werden durch Anteilscheine (Zertifikate) mit Wertpapiercharakter verkörpert, die auf Inhaber lauten.

Die Anteilscheine werden in Sammelurkunden je Anteilsgattung dargestellt. Effektive Stücke können daher nicht ausgefolgt werden.

### Artikel 2 Depotbank (Verwahrstelle)

Die für den Investmentfonds bestellte Depotbank (Verwahrstelle) ist die Raiffeisen Bank International AG, Wien.

Zahlstelle für Anteilscheine ist die Depotbank (Verwahrstelle).

### Artikel 3 Veranlagungsinstrumente und -grundsätze

#### Für den Investmentfonds dürfen nachstehende Vermögenswerte nach Maßgabe des InvFG ausgewählt werden.

Die Anlagestrategie des C-QUADRAT ARTS Total Return Balanced orientiert sich an keiner Benchmark. Es wird vielmehr, auf langfristige Sicht gesehen, angestrebt einen absoluten Wertzuwachs zu erwirtschaften.

Der Investmentfonds veranlagt zumindest **51 vH** des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds, wobei der Erwerb von Aktienfonds mit 50 vH des Fondsvermögens begrenzt ist. Dabei können auch Anteile an Investmentfonds erworben werden, die eine – im Verhältnis zu einer bestimmten Marktentwicklung - neutrale oder gegenläufige Wertentwicklung anstreben.

Der direkte Erwerb von Aktien und Aktien gleichen Wertpapieren sowie von Anleihen ist in Summe mit **49 vH** des Fondsvermögens begrenzt, wobei die gesamte Aktienquote, dh Aktien und Aktien gleichen Wertpapieren sowie Aktienfonds, **50 vH** des Fondsvermögens nicht überschreitet.

Die nachfolgenden Veranlagungsinstrumente werden unter Einhaltung des obig beschriebenen Veranlagungsschwerpunkts für das Fondsvermögen erworben.

#### Wertpapiere

Wertpapiere (einschließlich Wertpapiere mit eingebetteten derivativen Instrumenten) dürfen bis zu **49 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### Geldmarktinstrumente

Nicht anwendbar.

#### Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Der Erwerb nicht voll eingezahlter Wertpapiere und von Bezugsrechten auf solche Instrumente oder von nicht voll eingezahlten anderen Finanzinstrumenten ist **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens zulässig.

Wertpapiere dürfen erworben werden, wenn sie den Kriterien betreffend die Notiz oder den Handel an einem geregelten Markt oder einer Wertpapierbörse gemäß InvFG entsprechen.

Wertpapiere, die die im vorstehenden Absatz genannten Kriterien nicht erfüllen, dürfen insgesamt **bis zu 10 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### Anteile an Investmentfonds

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen jeweils **bis zu 20 vH** des Fondsvermögens und **insgesamt im gesetzlichen Rahmen** erworben werden, sofern diese (OGAW bzw. OGA) ihrerseits jeweils zu nicht mehr als 10 vH des Fondsvermögens in Anteile anderer Investmentfonds investieren.

Anteile an OGA dürfen insgesamt **bis zu 30 vH** des Fondsvermögens erworben werden.

#### Derivative Instrumente

Derivative Instrumente dürfen als Teil der Anlagestrategie **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens (Berechnung nach Marktpreisen) und zur Absicherung eingesetzt werden.

#### Risiko-Messmethode des Investmentfonds

Der Investmentfonds wendet folgende Risikomessmethode an:

- Value at Risk
- **absoluter VaR**

Der VaR-Wert wird gemäß dem 4. Hauptstück der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und MeldeV idgF ermittelt.

Der zuordenbare Risikobetrag für das Gesamtrisiko, ermittelt als Value-at-Risk-Wert von im Fonds getätigten Veranlagungen, ist auf maximal **14 vH** des Nettoinventarwertes des Fondsvermögens beschränkt (absoluter VaR).

#### Sichteinlagen oder kündbare Einlagen

Sichteinlagen und kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten können **bis zu 49 vH** des Fondsvermögens gehalten werden.

Es ist kein Mindestbankguthaben zu halten.

#### Vorübergehend aufgenommene Kredite

Die Verwaltungsgesellschaft darf für Rechnung des Investmentfonds vorübergehend Kredite **bis zur Höhe von 10 vH** des Fondsvermögens aufnehmen.

#### Pensionsgeschäfte

Nicht anwendbar.

#### Wertpapierleihe

Nicht anwendbar.

Der Erwerb von Veranlagungsinstrumenten ist nur einheitlich für den ganzen Investmentfonds und nicht für eine einzelne Anteilsgattung oder eine Gruppe von Anteilsgattungen zulässig. Dies gilt jedoch nicht für Währungssicherungsgeschäfte. Diese können auch ausschließlich zugunsten einer einzigen Anteilsgattung abgeschlossen werden. Ausgaben und Einnahmen aufgrund eines Währungssicherungsgeschäfts werden ausschließlich der betreffenden Anteilsgattung zugeordnet.

#### Artikel 4 Modalitäten der Ausgabe und Rücknahme

Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in EUR.

Der Wert der Anteile wird bankarbeitstäglich ermittelt.

#### Ausgabe und Ausgabeaufschlag

Der Ausgabepreis ergibt sich aus dem Anteilswert zuzüglich eines Aufschlages pro Anteil in Höhe von **bis zu 5 vH** zur Deckung der Ausgabekosten der Verwaltungsgesellschaft, aufgerundet auf den nächsten Cent. Für die retrofreie Anteilklasse „H“ wird derzeit kein Ausgabeaufschlag erhoben.

Die Ausgabe der Anteile ist grundsätzlich nicht beschränkt, die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch vor, die Ausgabe von Anteilscheinen vorübergehend oder vollständig einzustellen.

#### Rücknahme und Rücknahmeabschlag

Der Rücknahmepreis ergibt sich aus dem Anteilswert abgerundet auf den nächsten Cent. Es fällt kein Rücknahmeabschlag an.

Auf Verlangen eines Anteilhabers ist diesem sein Anteil an dem Investmentfonds zum jeweiligen Rücknahmepreis gegen Rückgabe des Anteilscheines auszus zahlen.

#### Artikel 5 Rechnungsjahr

Das Rechnungsjahr des Investmentfonds entspricht dem Kalenderjahr.

#### Artikel 6 Anteilsgattungen und Ertragnisverwendung

Fur den Investmentfonds konnen sowohl Thesaurierungsanteilscheine mit KEST-Auszahlung als auch Thesaurierungsanteilscheine ohne KEST-Auszahlung ausgegeben werden. Fur diesen Investmentfonds konnen verschiedene Gattungen von Anteilscheinen ausgegeben werden. Die Bildung der Anteilsgattungen sowie die Ausgabe von Anteilen einer Anteilsgattung liegen im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft.

#### Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen mit KEST-Auszahlung (Thesaurierer)

Die wahrend des Rechnungsjahres vereinnahmten Ertragnisse nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschuttet. Es ist bei Thesaurierungsanteilscheinen ab 01.01. der gema InvFG ermittelte Betrag auszus zahlen, der zutreffendenfalls zur Deckung einer auf den ausschuttungsgleichen Ertrag des Anteilscheines entfallenden Kapitalertragsteuerabfuhrpflicht zu verwenden ist.

#### Ertragnisverwendung bei Thesaurierungsanteilscheinen ohne KEST-Auszahlung (Vollthesaurierer)

Die wahrend des Rechnungsjahres vereinnahmten Ertragnisse nach Deckung der Kosten werden nicht ausgeschuttet. Es wird keine Auszahlung gema InvFG vorgenommen. Der fur das Unterbleiben der KEST-Auszahlung auf den Jahresertrag gema InvFG magebliche Zeitpunkt ist jeweils der 01.01. des folgenden Rechnungsjahres.

Die Verwaltungsgesellschaft stellt durch Erbringung entsprechender Nachweise von den depotfuhrenden Stellen sicher, dass die Anteilscheine im Auszahlungszeitpunkt nur von Anteilhabern gehalten werden konnen, die entweder nicht der inlandischen Einkommen- oder Korperschaftsteuer unterliegen oder bei denen die Voraussetzungen fur eine Befreiung gema § 94 des Einkommensteuergesetzes bzw. fur eine Befreiung von der Kapitalertragsteuer vorliegen.

Werden diese Voraussetzungen zum Auszahlungszeitpunkt nicht erfullt, ist der gema InvFG ermittelte Betrag durch Gutschrift des jeweils depotfuhrenden Kreditinstituts auszus zahlen.

#### Artikel 7 Verwaltungsgebuhr, Ersatz von Aufwendungen, Abwicklungsgebuhr

Die Verwaltungsgesellschaft erhalt fur ihre Verwaltungstatigkeit eine jahrliche Vergutung bis zu einer Hohe von **2,00 vH** p.a. des Fondsvermogens, die aufgrund der Monatsendwerte errechnet wird.

Zusatzlich erhalt die Verwaltungsgesellschaft monatlich eine variable Verwaltungsgebuhr (Performancefee, erfolgsabhangige Vergutung) in Hohe von **20 vH** der Nettoperformance (= Wertentwicklung des Anteilswertes) gegenuber der sogenannten „High-Water-Mark“. Die „High-Water-Mark“ entspricht jenem Anteilswert zum Ende jenes vergangenen Monats, zu dem zuletzt eine Performancefee ausbezahlt wurde und wird auf Basis des durchschnittlichen Fondsvolumens laufend abgegrenzt und beeinflusst erfolgswirksam den ermittelten Rechenwert. Bei der Berechnung wird die Anzahl der sich am Ende des relevanten Monats im Umlauf befindlichen Anteile in Betracht gezogen.

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf Ersatz aller durch die Verwaltung entstandenen Aufwendungen.

Die Kosten bei Einfuhrung neuer Anteilsgattungen fur bestehende Sondervermogen werden zu Lasten der Anteilspreise der neuen Anteilsgattungen in Rechnung gestellt.

Bei Abwicklung des Investmentfonds erhalt die abwickelnde Stelle eine Vergutung von **0,50 vH** des Fondsvermogens.

Nahere Angaben und Erlauterungen zu diesem Investmentfonds finden sich im Prospekt.



# Anhang

## Liste der Börsen mit amtlichem Handel und von organisierten Märkten

### 1. Börsen mit amtlichem Handel und organisierten Märkten in den Mitgliedstaaten des EWR sowie Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR, die als gleichwertig mit geregelten Märkten gelten

Jeder Mitgliedstaat hat ein aktuelles Verzeichnis der von ihm genehmigten Märkte zu führen. Dieses Verzeichnis ist den anderen Mitgliedstaaten und der Kommission zu übermitteln.

Die Kommission ist gemäß dieser Bestimmung verpflichtet, einmal jährlich ein Verzeichnis der ihr mitgeteilten geregelten Märkte zu veröffentlichen.

Infolge verringerter Zugangsschranken und der Spezialisierung in Handelssegmente ist das Verzeichnis der „geregelten Märkte“ größeren Veränderungen unterworfen. Die Kommission wird daher neben der jährlichen Veröffentlichung eines Verzeichnisses im Amtsblatt der Europäischen Union eine aktualisierte Fassung auf ihrer offiziellen Internetseite zugänglich machen.

1.1. Das aktuell gültige Verzeichnis der geregelten Märkte finden Sie unter [https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma\\_registers\\_upreg](https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_upreg) <sup>1)</sup>

1.2. Folgende Börsen sind unter das Verzeichnis der geregelten Märkte zu subsumieren:

- 1.2.1. Luxemburg: Euro MTF Luxemburg
- 1.2.2. Schweiz: SIX Swiss Exchange AG, BX Swiss AG<sup>2)</sup>

1.3. Gemäß § 67 Abs. 2 Z2 InvFG anerkannte Märkte im EWR:  
Märkte im EWR, die von den jeweils zuständigen Aufsichtsbehörden als anerkannte Märkte eingestuft werden.

<sup>1)</sup> Zum Öffnen des Verzeichnisses in der Spalte links unter „Entity Type“ die Einschränkung auf „Regulated market“ auswählen und auf „Search“ (bzw. auf „Show table columns“ und „Update“) klicken. Der Link kann durch die ESMA geändert werden. Der Link kann durch die ESMA geändert werden.

<sup>2)</sup> Im Fall des Auslaufens der Börsenäquivalenz für die Schweiz sind die SIX Swiss Exchange AG und die BX Swiss AG bis auf Weiteres unter Punkt 2 „Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR“ zu subsumieren.

**HINWEIS**

Mit dem erwarteten Ausscheiden des Vereinigten Königreichs Großbritanniens und Nordirland (GB) aus der EU verliert GB seinen Status als EWR-Mitgliedstaat und in weiterer Folge verlieren auch die dort ansässigen Börsen / geregelten Märkte ihren Status als EWR-Börsen / geregelte Märkte. Für diesen Fall weisen wir darauf hin, dass die in GB ansässigen Börsen und geregelten Märkte

Cboe Europe Equities Regulated Market – Integrated Book Segment, London Metal Exchange, Cboe Europe Equities Regulated Market – Reference Price Book Segment, Cboe Europe Equities Regulated Market – Off-Book Segment, London Stock Exchange Regulated Market (derivatives), NEX Exchange Main Board (non-equity), London Stock Exchange Regulated Market, NEX Exchange Main Board (equity), Euronext London Regulated Market, ICE FUTURES EUROPE, ICE FUTURES EUROPE - AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - FINANCIAL PRODUCTS DIVISION, ICE FUTURES EUROPE - EQUITY PRODUCTS DIVISION und Gibraltar Stock Exchange

als in diesen Fondsbestimmungen ausdrücklich vorgesehene Börsen bzw. anerkannte geregelte Märkte eines Drittlandes im Sinne des InvFG 2011 bzw. der OGAW-RL gelten.

**2. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten des EWR**

- |      |                      |   |
|------|----------------------|---|
| 2.1. | Bosnien Herzegowina: | Sarajevo, Banja Luka  |
| 2.2. | Montenegro:          | Podgorica   |
| 2.3. | Russland:            | Moskau (RTS Stock Exchange); Moscow Interbank Currency Exchange (MICEX) |
| 2.4. | Serbien:             | Belgrad   |
| 2.5. | Türkei:              | Istanbul (betr. Stock Market nur "National Market")                     |

**3. Börsen in außereuropäischen Ländern**

- |       |                               |   |
|-------|-------------------------------|---|
| 3.1.  | Australien:                   | Sydney, Hobart, Melbourne, Perth  |
| 3.2.  | Argentinien:                  | Buenos Aires  |
| 3.3.  | Brasilien:                    | Rio de Janeiro, Sao Paulo   |
| 3.4.  | Chile:                        | Santiago  |
| 3.5.  | China:                        | Shanghai Stock Exchange, Shenzhen Stock Exchange  |
| 3.6.  | Hongkong:                     | Hongkong Stock Exchange   |
| 3.7.  | Indien:                       | Mumbai  |
| 3.8.  | Indonien:                     | Jakarta   |
| 3.9.  | Israel:                       | Tel Aviv  |
| 3.10. | Japan:                        | Tokyo, Osaka, Nagoya, Kyoto, Fukuoka, Niigata, Sapporo, Hiroshima   |
| 3.11. | Kanada:                       | Toronto, Vancouver, Montreal  |
| 3.12. | Kolumbien:                    | Bolsa de Valores de Colombia  |
| 3.13. | Korea:                        | Korea Exchange (Seoul, Busan)   |
| 3.14. | Malaysia:                     | Kuala Lumpur, Bursa Malaysia Berhad   |
| 3.15. | Mexiko:                       | Mexico City   |
| 3.16. | Neuseeland:                   | Wellington, Christchurch / Invercargill, Auckland   |
| 3.17. | Peru:                         | Bolsa de Valores de Lima  |
| 3.18. | Philippinen:                  | Manila  |
| 3.19. | Singapur:                     | Singapur Stock Exchange   |
| 3.20. | Südafrika:                    | Johannesburg  |
| 3.21. | Taiwan:                       | Taipeh  |
| 3.22. | Thailand:                     | Bangkok   |
| 3.23. | USA:                          | New York, American Stock Exchange (AMEX), New York Stock Exchange (NYSE), Los Angeles / Pacific Stock Exchange, San Francisco / Pacific Stock Exchange, Philadelphia, Chicago, Boston, Cincinnati |
| 3.24. | Venezuela:                    | Caracas   |
| 3.25. | Vereinigte Arabische Emirate: | Abu Dhabi Securities Exchange (ADX)   |

#### 4. Organisierte Märkte in Ländern außerhalb der Mitgliedstaaten der Europäischen Gemeinschaft

- 4.1. Japan: Over the Counter Market
- 4.2. Kanada: Over the Counter Market
- 4.3. Korea: Over the Counter Market
- 4.4. Schweiz: SWX-Swiss Exchange, BX Berne eXchange; Over the Counter Market der Mitglieder der International Capital Market Association (ICMA), Zürich
- 4.5. USA: Over the Counter Market (unter behördlicher Beaufsichtigung wie z.B. durch SEC, FINRA)

#### 5. Börsen mit Futures und Options Märkten

- 5.1. Argentinien: Bolsa de Comercio de Buenos Aires
- 5.2. Australien: Australien Options Market, Australian Securities Exchange (ASX)
- 5.3. Brasilien: Bolsa Brasileira de Futuros, Bolsa de Mercadorias & Futuros, Rio de Janeiro Stock Exchange, Sao Paulo Stock Exchange
- 5.4. Hongkong: Hong Kong Futures Exchange Ltd.
- 5.5. Japan: Osaka Securities Exchange, Tokyo International Financial Futures Exchange, Tokyo Stock Exchange
- 5.6. Kanada: Montreal Exchange, Toronto Futures Exchange
- 5.7. Korea: Korea Exchange (KRX)
- 5.8. Mexiko: Mercado Mexicano de Derivados
- 5.9. Neuseeland: New Zealand Futures & Options Exchange
- 5.10. Philippinen: Maninal International Futures Exchange
- 5.11. Singapur: The Singapore Exchange Limited (SGX)
- 5.12. Slowakei: RM-System Slovakia
- 5.13. Südafrika: Johannesburg Stock Exchange (JSE), South African Futures Exchange (SAFEX)
- 5.14. Schweiz: EUREX
- 5.15. Türkei: TurkDEX
- 5.16. USA: Amercian Stock Exchange, Chicago Board Options Exchange, Chicago, Board of Trade, Chicago Mercantile Exchange, Comex, FINEX, Mid America Commodity Exchange, ICE Future US Inc. New York, Pacific Stock Exchange, Philadelphia Stock Exchange, New York Stock Exchange, Boston Options Exchange (BOX)

# 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 31.12.2023)  
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](mailto:fonds@ampega.com)  
Web [www.ampega.com](http://www.ampega.com)