

# C-QUADRAT ARTS Total Return Garant

## Opis funduszu

**Elastyczne wytyczne dotyczące strategii inwestowania** - Fundusz charakteryzuje się aktywnym stylem zarządzania aktywami, analizuje atrakcyjność wybieranych inwestycji oraz ustala aktualny docelowy poziom alokacji. W zależności od sytuacji na rynku fundusz może inwestować do 50% w obszarze akcji. Aby ograniczyć ryzyko w niekorzystnym okresie na giełdzie, udział akcji może zostać zredukowany do 0%. Do tego dochodzi 80-procentowa gwarancja maksymalnego notowania (udzielana przez Barclays Bank PLC, Londyn) najwyższej kiedykolwiek osiągniętej dziennej wyceny funduszu. W zależności od sytuacji rynkowej gwarant, na podstawie modelu matematycznego (CPPI), określa poziom zaangażowania aktywów funduszu w technicznym systemie handlowym firmy ARTS Asset Management.

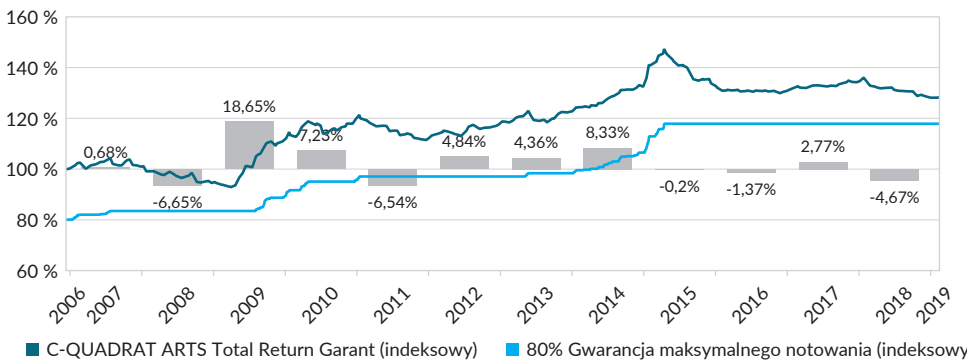
**Techniczny system handlowy** - Strategia inwestycyjna funduszu poza częścią gwarantowaną oparta jest na wolnym od prognoz rynkowych systemie Total Return, który nie posiada żadnego benchmarku. W pełni zautomatyzowany system handlowy, ukierunkowany na krótko i średnioterminowe trendy rynkowe, działa w oparciu o jasno zdefiniowane zasady ilościowe. Aktywa inwestowane są w branże i regiony wyróżniające się najsilniejszym trendem wzrostowym.

Stan na dzień: 15.02.2019



## Rozwój wartości Od założenia: +2,06 % p.a.

na dzień 15.02.2019



|     |        |       |         |       |        |            |        |
|-----|--------|-------|---------|-------|--------|------------|--------|
| YTD | 0,21 % | 1 rok | -3,01 % | 5 lat | 3,90 % | 5 lat p.a. | 0,77 % |
|-----|--------|-------|---------|-------|--------|------------|--------|

Wyniki z przeszłości nie są wystarczające do określenia przyszłych kierunków rozwoju wartości. Każda inwestycja kapitałowa wiąże się z pewnym ryzykiem. Notowania mogą zarówno rosnąć, jak i spadać. Opłaty manipulacyjne nie zostały uwzględnione. Wyniki funduszu zostały obliczone według wytycznych OeKB (Österreichische Kontrollbank). Ryzyko walutowe: W skutek notowań funduszu w Euro inwestorzy, którzy nabyli jednostki uczestnictwa w innej walucie, mogą odnotować straty z powodu ogólnych wahań kursów walut. Źródło: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

## Ratingi

Stan stycznia 2019



## WSKAŹNIKI (Od założenia)

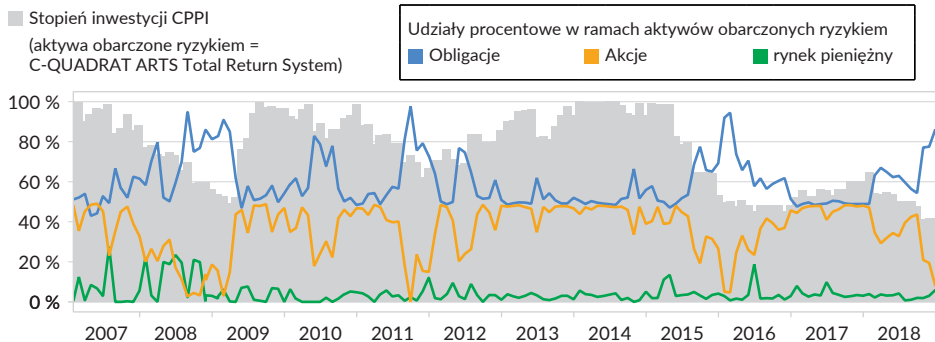
|  |                |
|--|----------------|
| Cena jednostki na dzień 15.02.2019                   | 128,19 EUR     |
| Gwarancja maksymalnego notowania na dzień 15.02.2019 | 117,88 EUR     |
| Aktywa funduszu                                      | 148,54 mln EUR |
| Zmienność  | 3,90 %         |
| Max. ost. 12 miesięcy                                | 132,85 EUR     |
| Min. ost. 12 miesięcy                                | 127,70 EUR     |
| Zmod. wskaźnik Sharpe'a                              | 0,53           |
| Max. strata  | -13,34 %       |
| Roczna stopa zwrotu 2018                             | -4,67 %        |
| Roczna stopa zwrotu 2017                             | 2,77 %         |

## DANE FUNDUSZU

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| Spółka inwestycyjna         | Ampega Investment GmbH                                      |
| Zarządzający                | ARTS Asset Management GmbH                                  |
| Bank depozytariusz funduszu | Raiffeisen Bank International AG                            |
| Gwarant                     | Barclays Bank PLC (UK)                                      |
| Dystrybucja zysków          | pełne reinwestowanie  |
| ISIN                        | AT0000A03K55  |
| WKN                         | A0LFPX  |
| Waluta funduszu             | EUR   |
| Data założenia              | 11.12.2006  |
| Opłata manipulacyjna        | do 5,00 %   |
| Opłata za zarządzanie       | 1,95 % p.a. (20 % od zysku netto wg zasady High-Water-Mark) |
| garantiegebuehr             | do 1,15 % p.a. (obecnie 0,80%)                              |
| Rok obrachunkowy            | 01.12.- 30.11.  |
| Notyfikacja                 | AT/DE/PL/SK   |

# Aktywne zarządzanie majątkiem funduszu funduszy

(31.01.2007 - 31.01.2019)



Kalkulacja wg: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

## Najlepsze pozycje

wg. wzrostu notowań za ostatnie 6M

|   |        |   |        |
|---|--------|---|--------|
| iShares Asia Property Yield UCITS.<br>stycznia - lutego Real Estate | 5,96 % | Morgan Stanley Asian Property Z (U.<br>stycznia - lutego Real Estate          | 3,48 % |
| Schroder ISF Asian Bond Total Retu.<br>listopada - lutego Bonds     | 4,60 % | BlackRock Strategic Funds - Emergi.<br>października - lutego Emerging Markets | 2,75 % |
| Xtrackers II Singapore Government.<br>listopada - stycznia Bonds    | 4,09 % | Ashmore SICAV Emerging Markets Sho.<br>października - grudnia Bonds           | 1,84 % |
| Credit Suisse (Lux) Asia Local Cur.<br>grudnia - lutego Bonds       | 4,03 % | Amundi S.F. - Euro Curve 7-10y I (.<br>grudnia - lutego Bonds                 | 1,74 % |
| Goldman Sachs Emerging Markets Deb.<br>stycznia - lutego Bonds      | 3,80 % | NN (L) Emerging Markets Debt (Hard.<br>stycznia - lutego Bonds                | 1,70 % |

W zakresie zarządzania aktywami obciążonymi ryzykiem, kierownictwo funduszu posługuje się stworzonym przez ARTS Asset Management komputerowym systemem transakcyjnym ukierunkowanym średnioterminowo na trendy rynkowe. Stanowiące podstawę funduszu C-QUADRAT ARTS Total Return Garant aktywa obciążone ryzykiem mogą być inwestowane do 50% w fundusze akcji i do 100% w fundusze papierów dłużnych lub fundusze gotówkowe. Realizacja polityki inwestycyjnej opiera się przede wszystkim na zasadzie systemu „total return”. Fundusze charakteryzujące się w perspektywie krótko- i średnioterminowej pozytywnymi trendami są najsilniej reprezentowane w portfelu inwestycyjnym.

Powyższe dane dot. składu portfela bazują na ostatnich dostępnych informacjach źródłowych i z tego powodu mogą odbiegać od stanu księgowego funduszu (stan prawny).

## Szanse / Korzyści

- **Elastyczna strategia zarządzania:** W zależności od rozwoju rynku i wytycznych w zakresie inwestowania fundusz dokonuje inwestycji w akcje, obligacje i rynek pieniężny. Zarządzający stara się lokować Państwa środki zawsze tam, gdzie rokowania na osiągnięcie zysków są najlepsze.
- **Unikanie długich faz strat:** Profesjonalna koncepcja Total Return pozwala na systematyczne zarządzanie ryzykiem – wolne od ludzkich emocji – ukierunkowane na unikanie długich faz strat.
- W skutek notowań funduszu w Euro inwestorzy, którzy nabyli jednostki uczestnictwa w innej walucie, mogą odnotować zyski z powodu ogólnych wahań kursów walut.

## Ryzyka

- Gwarant Barclays Bank PLC podlega ogólnemu, uzależnionemu od trendów rynkowych ryzyku straty (ryzyku wypłacalności), co może oznaczać, iż w przypadku straty gwarant może nie być w stanie zrealizować/dotrzymać swojej obietnicy gwarancji (gwarancji maksymalnego notowania).
- W przypadku inwestowania funduszu w określoną klasę aktywów charakteryzującą się trendem zwykłym należy liczyć się z możliwością odwrócenia trendu.
- Trendy zwykłe mogą zostać wykorzystane dopiero od momentu zainwestowania funduszu w daną klasę aktywów.
- Trendów zniżkowych można uniknąć dopiero od momentu wycofania funduszu z inwestycji w daną klasę aktywów.
- W skutek notowań funduszu w Euro inwestorzy, którzy nabyli jednostki uczestnictwa w innej walucie, mogą odnotować straty z powodu ogólnych wahań kursów walut.

Fundusz został wpisany do rejestru funduszy zagranicznych prowadzonego przez Komisję Nadzoru Finansowego w dniu 13.12.2016. Przedstawicielem Funduszu jest Moventum Sp. z o.o. z siedzibą w Warszawie, ul. Cybernetyki 21, 02-677 Warszawa. Tytuły uczestnictwa Funduszu są zbywane na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej wyłącznie inwestorom instytucjonalnym, w szczególności zakładom ubezpieczeń inwestującym w tytuły uczestnictwa Funduszu bezpośrednio lub poprzez produkty powiązane z funduszami kapitałowymi, dla których Fundusz będzie instrumentem bazowym. Fundusz nie zbywa jednostek uczestnictwa z wykorzystaniem tzw. instytucji właściciela faktycznego (ang. beneficial ownership) ani struktury nominee. Prezentowany fundusz jest funduszem zagranicznym w rozumieniu ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2004 r. Nr. 146, poz. 1546 ze zm.).

Niniejszy materiał marketingowy nie stanowi oferty publicznej, zaproszenia do złożenia oferty ani oferty sprzedaży jednostek funduszu, a jej celem nie jest nakłanianie potencjalnych inwestorów do nabywania jednostek funduszu. Ten dokument nie może zastąpić bezpośredniej usługi doradztwa inwestycyjnego.

Inwestycji w fundusz można dokonywać wyłącznie na podstawie aktualnego prospektu informacyjnego funduszu, zbadanego przez biegłego rewidenta, rocznego sprawozdania finansowego Funduszu, odpowiednich Kluczowych Informacji dla Inwestorów ("KIID") oraz Dodatkowej Informacji dla Inwestorów, które są dostępne nieodpłatnie w siedzibie Przedstawiciela Funduszu.

Wszystkie przedstawione wyniki rozwoju wartości są wartościami brutto, uwzględniającymi wszystkie opłaty związane z zarządzaniem funduszem jak również związane z reinwestycją oraz wypłatą dywidendy.

Wyniki z przeszłości nie są wystarczające do określenia przyszłych kierunków rozwoju wartości. Inwestycje oparte o fundusze inwestycyjne narażone są na ryzyko ekonomiczne oraz wahania wycen wartości, może to prowadzić do strat jak również do utraty całego zainwestowanego kapitału. Szczegółowe informacje dotyczące ryzyka zamieszczone zostały w prospekcie emisyjnym. Zmieniające się trendy mogą prowadzić do negatywnych stóp zwrotu. Podążający za trendami system handlowy może zwiększać lub zmniejszać udział poszczególnych trendów w portfelu.

## DANE KONTAKTOWE

Infolinia: +48 (519) 025251  
Email: sales@arts.co.at  
Strona internetowa: www.arts.co.at  
Przedstawicielem funduszu w Polsce jest Moventum Sp.z.o.o. E-Mail: office@moventum.com.pl