

Halbjahresbericht

ARIAD Active Allocation

zum 31. Juli 2016

Halbjahresbericht des ARIAD Active Allocation

ZUM 31. JULI 2016

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	4
■ Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	5
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6
■ Firmenspiegel	7

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	14.894.906,31	100,74
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-317.361,01	-2,15
Aktienindex-Derivate	-317.361,01	-2,15
4. Forderungen	-229,50	0,00
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	10.800.000,00	73,05
6. Bankguthaben	4.412.496,82	29,84
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-110.077,73	-0,74
Sonstige Verbindlichkeiten	-110.077,73	-0,74
III. Fondsvermögen	14.784.828,58	100,00^{*)}

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2016	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Derivate								-317.361,01	-2,15
Aktienindex-Derivate									
Optionsrechte								-317.361,01	-2,15
Optionsrechte auf Aktienindices									
CALL EURO STOXX 50 3100 08/16		EUREX	STK	-250			EUR 8,600	-21.500,00	-0,15
CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 17500 08/16		OSE	STK	-50			JPY 46,000	-20.010,44	-0,14
PUT EURO STOXX 50 2500 12/16		EUREX	STK	-500			EUR 39,600	-198.000,00	-1,34
PUT EURO STOXX 50 2700 09/16		EUREX	STK	-250			EUR 20,700	-51.750,00	-0,35
PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 15500 08/16		OSE	STK	-50			JPY 60,000	-26.100,57	-0,18
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								15.212.496,82	102,89
Bankguthaben								15.212.496,82	102,89
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	4.078.401,74			% 100,000	4.078.401,74	27,59
Vorzeitig kündbares Termingeld									
HSH NORDBANK AG			EUR	2.700.000,00			% 100,000	2.700.000,00	18,26
DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE FRANKFURT			EUR	2.700.000,00			% 100,000	2.700.000,00	18,26
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL GENOSSENSCHAFTSBANK			EUR	2.700.000,00			% 100,000	2.700.000,00	18,26
UNICREDIT BANK AG			EUR	2.700.000,00			% 100,000	2.700.000,00	18,26
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			JPY	38.400.888,00			% 100,000	334.095,08	2,26
Sonstige Vermögensgegenstände								-229,50	0,00
ZINSANSPRÜCHE			EUR	-229,50				-229,50	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								-110.077,73	-0,74
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-108.512,93				-108.512,93	-0,73
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.564,80				-1.564,80	-0,01
Fondsvermögen							EUR	14.784.828,58	100,00^{*)}

^{*)} Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

ARIAD Active Allocation (I)

ISIN	DE000A14N7U1
Fondsvermögen (EUR)	14.784.828,58
Anteilwert (EUR)	105,58
Umlaufende Anteile (STK)	140.030,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.07.2016 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.07.2016

Japanische Yen	(JPY)	114,94000 = 1 (EUR)
----------------	-------	---------------------

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

EUREX Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)

OSE Osaka - Osaka Securities Ex - Options and Futures

Im Berichtszeitraum haben gegebenenfalls Kapitalmaßnahmen und eventuelle unterjährige Änderungen der Stammdaten eines Wertpapiers stattgefunden. Diese Kapitalmaßnahmen und die Umbuchungen aufgrund von Stammdatenänderungen sind ohne Umsatzzahlen in der "Vermögensaufstellung" und in den "Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen" enthalten.

■ **Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Volumen in 1.000
---------------------	------------------------------	------------------

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Kaufoptionen (call)	EUR	7.000
-------------------------------------	------------	--------------

Basiswerte: (CALL EURO STOXX 50 2800 07/16)

Verkaufte Kaufoptionen (call)	EUR	91.456
--------------------------------------	------------	---------------

Basiswerte: (CALL EURO STOXX 50 3000 07/16, CALL EURO STOXX 50 3050 02/16, CALL EURO STOXX 50 3100 03/16, CALL EURO STOXX 50 3100 06/16, CALL EURO STOXX 50 3150 06/16, CALL EURO STOXX 50 3200 04/16, CALL EURO STOXX 50 3200 05/16, CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 17500 06/16, CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 18000 04/16, CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 18000 05/16)

Verkaufte Verkaufsoptionen (put)	EUR	76.613
---	------------	---------------

Basiswerte: (PUT EURO STOXX 50 2800 03/16, PUT EURO STOXX 50 2900 03/16, PUT EURO STOXX 50 2900 04/16, PUT EURO STOXX 50 2900 05/16, PUT EURO STOXX 50 2950 06/16, PUT EURO STOXX 50 3000 05/16, PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 15500 04/16, PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 15500 06/16, PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 16000 05/16)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	105,58
Umlaufende Anteile (STK)	140.030,00

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	0,00 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-2,15 %

ARIAD Active Allocation (I)

ISIN	DE000A14N7U1
Fondsvermögen (EUR)	14.784.828,58
Anteilwert (EUR)	105,58
Umlaufende Anteile (STK)	140.030,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 4,00 %, derzeit 0,00 %
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,80 %, derzeit 1,10 %
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände, die zum Handel an Börsen zugelassen sind oder in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet. Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Die Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils letzten verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände werden unter Zugrundelegung der tagesaktuellen Devisenkurse Reuters Fixing 09:00 Uhr GMT der Währung in Euro umgerechnet.

Die Anteilwertermittlung erfolgt auf der Grundlage der gesetzlichen Regelungen von KAGB und KARBV.

Für die nachfolgend genannten Assetklassen wurden zum Stichtag des Sondervermögens mittels der angewendeten Bewertungsgrundsätze folgende Bewertungsquellen herangezogen:

Wertpapiere und Geldanlagen:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	102,9 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,0 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,0 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-2,1 %
------------------------------------	--------

Devisentermingeschäfte:

- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,0 %
------------------------------------	-------

Sonstige Derivate und OTC-Produkte:

- Verwahrstellen-eigene Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,0 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,0 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf das Fondsvolumen. Evtl. Ungenauigkeiten der angegebenen Prozentsätze ergeben sich durch die Tatsache, dass Assetklassen mit einem Anteil am Fondsvolumen von weniger als 0,1 % nicht explizit angegeben werden. Zudem ergeben sich weitere Ungenauigkeiten vor dem Hintergrund, dass im Fondsvolumen als Bezugsgröße zur Ermittlung der Prozentsätze neben den Assetklassen auch Forderungen (z. B. Stückzinsen, Dividendenansprüche) und Verbindlichkeiten (z. B. Kostenabgrenzungen) berücksichtigt sind.

■ Firmenspiegel

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH

Stolkgasse 25-45, 50667 Köln,

Telefon (02 21) 390 95 - 0

Telefax (02 21) 390 95 - 400

E-Mail: info@monega.de

Internet: www.monega.de

gezeichnetes und eingezahltes Kapital: EURO 5,2 Mio.

haftendes Eigenkapital: EURO 5,2 Mio.

(Stand 31.12.2015)

gegründet: 09.10.2000



Gesellschafter

DEVK Rückversicherungs- und
Beteiligungs-Aktiengesellschaft, Köln

Sparda-Beteiligungs GmbH, Frankfurt

Sal. Oppenheim jr. & Cie. AG & Co. KGaA, Köln

Aufsichtsrat

Bernd Zens, Vorsitzender

Mitglied des Vorstandes der DEVK Versicherungen

Prof. Dr. Jochen Axer

Wirtschaftsprüfer, Steuerberater

Detlef Bierbaum

Bankier

Friedrich W. Gieseler

Vorsitzender des Vorstandes der DEVK Versicherungen i.R.

Martin Laubisch

Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der

Sparda-Bank Berlin eG

Ralf Müller

Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der

Sparda-Bank München eG

Hans-Joachim Nagel

Generalbevollmächtigter Bankenvertrieb, DEVK

Versicherungen

Manfred Stevermann

Vorsitzender des Vorstandes der Sparda-Bank West eG

Prof. Dr. Joachim Wuermeling

Vorsitzender des Vorstandes des Verbandes der

Sparda-Banken e.V.

Geschäftsführung

Bernhard Fünfer

Christian Finke

Verwahrstelle

Kreissparkasse Köln

– Anstalt des öffentlichen Rechts –

Neumarkt 18-24

50667 Köln

Eigenmittel haftend: 2.064.709.072,90 Euro

(Stand 15.02.2016)

Wirtschaftsprüfer

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Tersteegenstraße 19-31, 40474 Düsseldorf

Zuständige Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)

Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main

Sonstige Angaben

ARIAD Active Allocation (I)

WKN: A14N7U

ISIN: DE000A14N7U1

