

Halbjahresbericht

Monega Ertrag

zum 31. März 2018



Halbjahresbericht des Monega Ertrag

ZUM 31. MÄRZ 2018

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	4
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6
■ Firmenspiegel	7

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	53.808.583,70	100,13
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-75.225,00	-0,14
Aktienindex-Derivate	-75.225,00	-0,14
4. Forderungen	151.870,30	0,28
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	260.031,90	0,48
7. Sonstige Vermögensgegenstände	53.471.906,50	99,50
Zielfondsanteile	53.471.906,50	99,50
Indexfonds	41.175.544,50	76,62
Rentenfonds	10.406.812,00	19,37
Gemischte Fonds	1.889.550,00	3,52
II. Verbindlichkeiten	-70.292,53	-0,13
Sonstige Verbindlichkeiten	-70.292,53	-0,13
III. Fondsvermögen	53.738.291,17	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 31.03.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Investmentanteile							53.471.906,50	99,50	
Gesellschaftseigene Investmentanteile									
Euro							12.296.362,00	22,88	
MONEGA DÄNISCHE COV.BD. 'I'	DE000A1JSW48		ANT	57.800	5.000	- EUR	103,140	5.961.492,00	11,09
MONEGA DÄNISCHE COV.BD. 'I'	DE000A141WH1		ANT	44.000	-	- EUR	101,030	4.445.320,00	8,27
WGZ CORPORATE M 'I'	DE000A1JSWX5		ANT	19.000	9.000	- EUR	99,450	1.889.550,00	3,52
Gesellschaftsfremde Investmentanteile							41.175.544,50	76,62	
Euro									
ISH.EO G.B.C.1.5-10.5Y.	DE000A0H0785		ANT	32.400	-	- EUR	121,010	3.920.724,00	7,30
ISHARES DAX	DE0005933931		ANT	34.000	-	- EUR	103,440	3.516.960,00	6,54
ISHARES-EO CORP.BD.LAR.CAP.	IE0032523478		ANT	49.000	16.000	- EUR	134,700	6.600.300,00	12,28
ISHARESIII-EO C.BD 1-5YR	IE00B4L60045		ANT	40.000	-	- EUR	110,300	4.412.000,00	8,21
ISHARESIII-EO GOV.BD	IE00B4WXJJ64		ANT	44.700	-	- EUR	123,710	5.529.837,00	10,29
LYXOR EUR.ST.50 (DR) UCITS	FR0007054358		ANT	233.000	-	- EUR	32,815	7.645.895,00	14,23
MLYX.EUROMTS 7-10Y INV.GR.	LU1287023185		ANT	19.000	-	- EUR	173,980	3.305.620,00	6,15
XTR.II EUR HY CORP.BD. '1D'	LU1109942653		ANT	85.000	-	- EUR	18,038	1.533.187,50	2,85
XTR.II EUROZ.GOV.BD. '1C'	LU0290355717		ANT	20.300	-	- EUR	232,070	4.711.021,00	8,77
Summe Wertpapiervermögen							53.471.906,50	99,50	
Derivate							-75.225,00	-0,14	
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte							-75.225,00	-0,14	
DAX FUTURE 06/18		EUREX	STK	17				-75.225,00	-0,14
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							260.031,90	0,48	
Bankguthaben							260.031,90	0,48	
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	260.031,90		%	100,000	260.031,90	0,48
Sonstige Vermögensgegenstände							151.870,30	0,28	
ZINSANSPRÜCHE			EUR	-143,70				-143,70	0,00
AUSSCHÜTTUNGSANSPRÜCHE			EUR	17.076,50				17.076,50	0,03
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	134.937,50				134.937,50	0,25
Sonstige Verbindlichkeiten							-70.292,53	-0,13	
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-24.225,00				-24.225,00	-0,05
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-46.067,53				-46.067,53	-0,09
Fondsvermögen							EUR	53.738.291,17	100,00*)
Anteilwert						EUR		59,59	
Umlaufende Anteile						STK		901.740,00	

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

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.03.2018 oder letztbekannte.

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

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

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
---------------------	------------------------------------	---------------------

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte	EUR	5.594
---------------------------	------------	--------------

Basiswerte: (DAX FUTURE 03/18)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,50 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,14 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	59,59
Umlaufende Anteile (STK)	901.740,00

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):	100,14 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-0,14 %
------------------------------------	---------

Devisentermingeschäfte:

- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %
------------------------------------	--------

Sonstige Derivate und OTC-Produkte:

- Verwahrstellen-eigene Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %

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.

Angaben zur Transparenz

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
iShares DAX	0,15000 % p.a.
iShares-EO Corp.Bd.Lar.Cap.	0,20000 % p.a.
iSharesIII-EO C.Bd 1-5yr	0,20000 % p.a.
iSharesIII-EO Gov.Bd	0,20000 % p.a.
iSh.EO G.B.C.1.5-10.5y.	0,15000 % p.a.
LYXOR EUR.ST.50 (DR) UCITS	0,25000 % p.a.
MLYX.EuroMTS 7-10Y Inv.Gr.	0,16500 % p.a.
Monega Dänische Cov.Bd. 'I'	0,17000 % p.a.
Monega Dänische Cov.Bd. 'I'	0,17000 % p.a.
WGZ Corporate M 'I'	0,35000 % p.a.
Xtr.II EUR HY Corp.Bd. '1D'	0,25000 % p.a.
Xtr.II Euroz.Gov.Bd. '1C'	0,15000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgegesellschaften bzw. ausländischen Investmentgesellschaften berechnete Verwaltungsvergütung.

Bei den Angaben zu Verwaltungsvergütungen handelt es sich um den von den Gesellschaften maximal belasteten Prozentsatz.
Quelle: WM Datenservice, Verkaufsprospekte

Im Berichtszeitraum wurden keine Ausgabeaufschläge gezahlt.
Im Berichtszeitraum wurden keine Rücknahmeabschläge gezahlt.

■ Firmenspiegel

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH
 Stolkgasse 25-45, 50667 Köln
 Telefon (02 21) 39095 - 0
 Telefax (02 21) 39095 - 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 31.12.2016)
 gegründet: 11.12.1999



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

Manfred Stevermann, stv. Vorsitzender

Vorsitzender des Vorstandes der Sparda-Bank West eG

Prof. Dr. Jochen Axer

Wirtschaftsprüfer, Steuerberater

Detlef Bierbaum

Bankier

Joachim Gallus

Hauptabteilungsleiter Kapitalanlagen der DEVK Versicherungen

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

Dietmar Scheel

Mitglied des Vorstandes der DEVK Versicherungen

Geschäftsführung

Bernhard Fünfer

Christian Finke

Verwahrstelle

HSBC Trinkaus & Burkhardt AG
 Königsallee 21/23, 40212 Düsseldorf

Eigenkapital gezeichnet und eingezahlt:	EURO	91.423.896,95
modifiziert verfügbare haftende Eigenmittel:	EURO	2.281.943.226,82

(Stand 31.12.2016)

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

WKN: 532108

ISIN: DE0005321087

(DEVK) 08040-003/2018/05