

Halbjahresbericht

Monega Short Track SGB

zum 29. Februar 2016



Halbjahresbericht des Monega Short Track SGB

ZUM 29. FEBRUAR 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	31.667.887,83	100,02
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	29.423.534,95	92,93
Staatlich garantierte Anlagen	11.057.366,62	34,93
Reguläre Pfandbriefe	7.033.100,00	22,21
Nicht pfandbrieflich besicherte Anlagewerte	6.468.480,00	20,43
Jumbo-Pfandbriefe	2.041.000,00	6,45
Agency	1.809.540,00	5,72
Regierungsanleihen	1.014.048,33	3,20
3. Derivate	0,00	0,00
4. Forderungen	210.508,23	0,66
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	2.002.398,02	6,32
6. Bankguthaben	31.446,63	0,10
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-6.554,10	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten	-6.554,10	-0,02
III. Fondsvermögen	31.661.333,73	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 29.02.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								20.914.054,95	66,06
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								20.914.054,95	66,06
0,5000 % EAA MTN V.13-16	DE000EAA0SV0		EUR	1.800.000	-	- %	100,530	1.809.540,00	5,72
0,5000 % INST.CRÉD.OFI. MTN V.15-17	XS1180277524		EUR	7.000.000	4.000.000	- %	100,597	7.041.766,62	22,24
0,8750 % DT.PFD.BRBK. HYP-PFE 13-17 MTN	DE000A1RFBY7		EUR	2.000.000	-	- %	100,880	2.017.600,00	6,37
1,0000 % DEXIA CL MTN V.13-16	XS0951560969		EUR	4.000.000	-	- %	100,390	4.015.600,00	12,68
1,1250 % HSH HYP.-PFE V.12-16 MTN	DE000HSH3065		EUR	5.000.000	-	- %	100,310	5.015.500,00	15,84
1,1500 % ITALIEN BTP V.14-17	IT0005023459		EUR	1.000.000	-	- %	101,405	1.014.048,33	3,20
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								8.509.480,00	26,88
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								8.509.480,00	26,88
2,6250 % AIB MORTG.BK. COV. V.13-16 MTN	XS0880288211		EUR	6.400.000	6.400.000	- %	101,070	6.468.480,00	20,43
3,6250 % BANKIA HYP.-PFE 09-16	ES0414950776		EUR	2.000.000	2.000.000	- %	102,050	2.041.000,00	6,45
Summe Wertpapiervermögen								29.423.534,95	92,93
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								2.033.844,65	6,42
Bankguthaben								2.033.844,65	6,42
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	31.446,63		%	100,000	31.446,63	0,10
Vorzeitig kündbares Termingeld									
UNICREDIT BANK AG			EUR	2.002.398,02		%	100,000	2.002.398,02	6,32
Sonstige Vermögensgegenstände								210.508,23	0,66
ZINSANSPRÜCHE			EUR	210.508,23				210.508,23	0,66
Sonstige Verbindlichkeiten								-6.554,10	-0,02
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-6.554,10				-6.554,10	-0,02
Fondsvermögen							EUR	31.661.333,73	100,00^{*)}

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

Monega Short Track SGB -A-

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	29.083.626,46
Anteilwert (EUR)	48,13
Umlaufende Anteile (STK)	604.262,00

Monega Short Track SGB T -Net-

ISIN	DE000A0NGFJ8
Fondsvermögen (EUR)	2.577.707,27
Anteilwert (EUR)	51,80
Umlaufende Anteile (STK)	49.759,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.02.2016 oder letztbekannte.

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:**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und
Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Verkäufe/ Zugänge Abgänge
---------------------	------	------------------------------------	-------------------------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

2,2500 % BNP PUBL. PFE V.10- 15 MTN	FR0010955377	EUR	- 1.500.000
---	--------------	-----	-------------

2,3000 %

HYPOBK.FFM

ÖPF

EM.HBE0ER	DE000HBE0ER0	EUR	- 4.000.000
-----------	--------------	-----	-------------

2,7500 %

ITALIEN B.T.P.

V.12-15	IT0004880990	EUR	- 3.000.000
---------	--------------	-----	-------------

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

2,6250 %

UNICREDIT

COV. V.10-15

MTN	IT0004638737	EUR	- 6.500.000
-----	--------------	-----	-------------

Nichtnotierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

1,0000 %

INST.CRÉD.OFI.

MTN V.14-15	XS1017789089	EUR	- 5.000.000
-------------	--------------	-----	-------------

2,0000 %

AAREAL BK.

HYP.-PFE S.123

MTN	DE000AAR0124	EUR	- 725.000
-----	--------------	-----	-----------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	92,93 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,00 %

Monega Short Track SGB -A-

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	29.083.626,46
Anteilwert (EUR)	48,13
Umlaufende Anteile (STK)	604.262,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,00 %, derzeit 1,00 %
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,50 %, derzeit 0,25 %
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Monega Short Track SGB T -Net-

ISIN	DE000A0NGFJ8
Fondsvermögen (EUR)	2.577.707,27
Anteilwert (EUR)	51,80
Umlaufende Anteile (STK)	49.759,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,00 %, derzeit 0,00 %
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,50 %, derzeit 0,41 %
Mindestanlagesumme (EUR)	keine
Ertragsverwendung	Thesaurierung

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):	99,4 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,0 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,0 %

Börsengehandelte Derivate:

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

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) 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 31.12.2015)

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

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

HSBC Trinkaus & Burkhardt AG

Königsallee 21/23, 40212 Düsseldorf

Eigenkapital gezeichnet

und eingezahlt: EURO 91.423.896,95

modifiziert verfügbare

haftende Eigenmittel: EURO 2.080.530.217,66

(Stand 31.12.2015)

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

Monega Short Track SGB -A- :

WKN: 532100

ISIN: DE0005321004

Monega Short Track SGB T -Net- :

WKN: A0NGFJ

ISIN: DE000A0NGFJ8

(DEVK) 08054-002/2016/04