

# Halbjahresbericht

## Monega Short Track SGB

zum 28. Februar 2019



# Halbjahresbericht des Monega Short Track SGB

ZUM 28. FEBRUAR 2019

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

## ■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>15.700.658,13</b>	<b>100,04</b>
<b>1. Aktien</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>2. Anleihen</b>	<b>15.107.896,08</b>	<b>96,26</b>
Regierungsanleihen	5.909.584,80	37,65
Anleihen supranationaler Organisationen	4.316.231,64	27,50
Staatlich garantierte Anlagen	4.069.455,00	25,93
Gedeckte Schuldverschreibungen	812.624,64	5,18
<b>3. Derivate</b>	<b>2.455,00</b>	<b>0,02</b>
Zins-Derivate	2.455,00	0,02
<b>4. Forderungen</b>	<b>69.343,29</b>	<b>0,44</b>
<b>5. Kurzfristig liquidierbare     Anlagen</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>520.963,76</b>	<b>3,32</b>
<b>7. Sonstige     Vermögensgegenstände</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-5.550,25</b>	<b>-0,04</b>
Sonstige Verbindlichkeiten	-5.550,25	-0,04
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>15.695.107,88</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

<sup>\*)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

## ■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2019	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>15.107.896,08</b>	<b>96,26</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
<b>Euro</b>								<b>15.107.896,08</b>	<b>96,26</b>
0,1250 % CCCIF MTN V.15-20	FR0012497451		EUR	3.000.000	-	-	% 100,330	3.009.900,00	19,18
0,5000 % LETTLAND MTN V.15-20	XS1333704713		EUR	2.300.000	2.300.000	-	% 100,800	2.318.400,00	14,77
1,0500 % ITALIEN B.T.P. V.14-19	IT0005069395		EUR	970.000	-	-	% 100,710	976.887,00	6,22
1,1250 % SK KÖLNBONN HYP.-PFE 13-20 MTN	DE000SK00644		EUR	800.000	-	-	% 101,578	812.624,64	5,18
1,3750 % DEXIA CL MTN V.14-19	XS1045697494		EUR	1.050.000	-	-	% 100,910	1.059.555,00	6,75
1,6250 % EFSF MTN V.13-20	EU000A1G0BG1		EUR	4.200.000	-	-	% 102,767	4.316.231,64	27,50
2,6250 % LETTLAND MTN V.14-21	XS1017763100		EUR	1.500.000	1.500.000	-	% 104,992	1.574.873,70	10,03
4,5000 % ITALIEN B.T.P. V.04-20	IT0003644769		EUR	1.000.000	-	-	% 103,942	1.039.424,10	6,62
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>15.107.896,08</b>	<b>96,26</b>
<b>Derivate</b>								<b>2.455,00</b>	<b>0,02</b>
<b>Zins-Derivate</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>								<b>2.455,00</b>	<b>0,02</b>
EURO-SCHATZ-FUTURE 03/19		EUREX	STK	-1.900.000			EUR	2.455,00	0,02
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>								<b>520.963,76</b>	<b>3,32</b>
<b>Bankguthaben</b>								<b>520.963,76</b>	<b>3,32</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
<b>Verwahrstelle</b>									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	520.963,76			% 100,000	520.963,76	3,32
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>69.343,29</b>	<b>0,44</b>
ZINSANSPRÜCHE			EUR	68.963,29				68.963,29	0,44
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	380,00				380,00	0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>-5.550,25</b>	<b>-0,04</b>
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-3.095,25				-3.095,25	-0,02
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-2.455,00				-2.455,00	-0,02
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>15.695.107,88</b>	<b>100,00<sup>*)</sup></b>

<sup>\*)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

### Monega Short Track SGB A

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	14.386.872,13
Anteilwert (EUR)	46,35
Umlaufende Anteile (STK)	310.383,00

---

Monega Short Track SGB T Net

ISIN	DE000A0NGFJ8
Fondsvermögen (EUR)	1.308.235,75
Anteilwert (EUR)	49,61
Umlaufende Anteile (STK)	26.369,00

## ■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.02.2019 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**

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

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

**Börsengehandelte Wertpapiere**

**Verzinsliche Wertpapiere**

**Euro**

1,1250 % CM-CIC HL PFE V.14-19 MTN	FR0011725407	EUR	-	1.000.000
------------------------------------	--------------	-----	---	-----------

**Nicht notierte Wertpapiere**

**Verzinsliche Wertpapiere**

**Euro**

0,0000 % EAA MTN V.15-18	DE000EAA0TH7	EUR	-	2.900.000
--------------------------	--------------	-----	---	-----------

■ **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**

**Zinsterminkontrakte**

**Verkaufte Kontrakte** **EUR** **1.903**

Basiswerte: (EURO-SCHATZ-FUTURE 03/19, EURO-SCHATZ-FUTURE 12/18)

## ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen** 96,26 %

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen** 0,02 %

#### Sonstige Angaben

#### Monega Short Track SGB A

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	14.386.872,13
Anteilwert (EUR)	46,35
Umlaufende Anteile (STK)	310.383,00
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)	1.308.235,75
Anteilwert (EUR)	49,61
Umlaufende Anteile (STK)	26.369,00
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 16:00 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):	99,98 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

#### Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	0,02 %
------------------------------------	--------

#### 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.

## ■ 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 31.12.2017)  
 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  
 Ulrich Gericke  
 Managing Director der HSBC Trinkaus & Burkhardt AG  
 Martin Laubisch  
 Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der Sparda-Bank  
 Berlin eG  
 Martin Risse  
 Stellvertretender Vorsitzender des Vorstandes der Barmenia  
 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 2.390.897.946,05  
 (Stand 31.12.2018)

### 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: AONGFJ  
 ISIN: DE000A0NGFJ8



