

Halbjahresbericht

Monega Short Track SGB

zum 28. Februar 2018



Halbjahresbericht des Monega Short Track SGB

ZUM 28. FEBRUAR 2018

■ 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
■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)	
– MONEGA SHORT TRACK SGB A	6
■ Entwicklung der Anteilklasse	
– MONEGA SHORT TRACK SGB A	7
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
■ Firmenspiegel	9

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	17.187.347,49	100,04
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	16.958.457,04	98,71
Gedekte Schuldverschreibungen	4.519.200,10	26,31
Anleihen supranationaler Organisationen	4.386.144,00	25,53
Agency	4.013.200,00	23,36
Regierungsanleihen	2.086.036,19	12,14
Staatlich garantierte Anlagen	1.953.876,75	11,37
3. Derivate	4.080,00	0,02
Zins-Derivate	4.080,00	0,02
4. Forderungen	61.856,42	0,36
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	162.954,03	0,95
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-7.558,78	-0,04
Sonstige Verbindlichkeiten	-7.558,78	-0,04
III. Fondsvermögen	17.179.788,71	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 28.02.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								16.958.457,04	98,71
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								16.958.457,04	98,71
0,0000 % EAA MTN V.15-18	DE000EAA0TH7		EUR	4.000.000	-	1.800.000 %	100,330	4.013.200,00	23,36
0,1250 % CIE D.FIN.FON. PFE V.15-18 MTN	FR0012790319		EUR	3.500.000	-	2.000.000 %	100,140	3.504.900,00	20,40
0,5000 % NRW.BANK V.14-18 A.16S	DE000NWB16S8		EUR	875.000	-	- %	100,200	876.750,00	5,10
1,0500 % ITALIEN B.T.P. V.14-19	IT0005069395		EUR	970.000	-	- %	102,184	991.180,06	5,77
1,1250 % CM-CIC HL PFE V.14-19 MTN	FR0011725407		EUR	1.000.000	-	- %	101,430	1.014.300,10	5,90
1,3750 % DEXIA CL MTN V.14-19	XS1045697494		EUR	1.050.000	-	- %	102,584	1.077.126,75	6,27
1,6250 % EFSF MTN V.13-20	EU000A1G0BG1		EUR	4.200.000	4.200.000	- %	104,432	4.386.144,00	25,53
4,5000 % ITALIEN B.T.P. V.04-20	IT0003644769		EUR	1.000.000	-	- %	109,486	1.094.856,13	6,37
Summe Wertpapiervermögen								16.958.457,04	98,71
Derivate								4.080,00	0,02
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte								4.080,00	0,02
EURO-SCHATZ-FUTURE 03/18		EUREX	STK	-2.300.000			EUR	4.080,00	0,02
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								162.954,03	0,95
Bankguthaben								162.954,03	0,95
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
HSBC TRINKAUS & BURKHARDT AG			EUR	162.954,03		%	100,000	162.954,03	0,95
Sonstige Vermögensgegenstände								61.856,42	0,36
ZINSANSPRÜCHE			EUR	61.856,42				61.856,42	0,36
Sonstige Verbindlichkeiten								-7.558,78	-0,04
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-3.478,78				-3.478,78	-0,02
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-4.080,00				-4.080,00	-0,02
Fondsvermögen							EUR	17.179.788,71	100,00*)

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

Monega Short Track SGB A

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	15.848.528,02
Anteilwert (EUR)	47,12
Umlaufende Anteile (STK)	336.335,00

Monega Short Track SGB T Net

ISIN	DE000A0NGFJ8
Fondsvermögen (EUR)	1.331.260,69
Anteilwert (EUR)	50,49
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 28.02.2018 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**

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

0,5000 %	XS1180277524	EUR	-	5.700.000
INST.CRÉD.OFI. MTN V.15-17				

■ **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	2.244
----------------------------	------------	--------------

Basiswerte: (EURO-SCHATZ-FUTURE 03/18, EURO-SCHATZ-FUTURE 12/17)

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

Monega Short Track SGB A

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	336.335,00	
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller	0,00	0,0000000
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	828,18	0,0024624
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	54.023,78	0,1606249
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-42,43	-0,0001262
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
7. Erträge aus Investmentanteilen	0,00	0,0000000
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	0,00	0,0000000
9. Abzug ausländischer Quellensteuer	0,00	0,0000000
10. Sonstige Erträge	0,00	0,0000000
Summe der Erträge	54.809,53	0,1629611
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00	0,0000000
2. Verwaltungsvergütung	-19.739,30	-0,0586894
3. Verwahrstellenvergütung	-980,39	-0,0029149
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-12.302,33	-0,0365776
5. Sonstige Aufwendungen	-4.601,89	-0,0136825
Summe der Aufwendungen	-37.623,91	-0,1118644
III. Ordentlicher Nettoertrag	17.185,62	0,0510967
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	2.696,39	0,0080170
2. Realisierte Verluste	-32.334,67	-0,0961383
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-29.638,28	-0,0881213
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-12.452,66	-0,0370246
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	3.735,50	0,0111065
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-56.965,40	-0,1693710
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-53.229,90	-0,1582645
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-65.682,56	-0,1952891

■ Entwicklung der Anteilklasse

Monega Short Track SGB A

	EUR
	insgesamt
I. Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres	20.940.626,18
1. Ausschüttung für das Vorjahr	-14.645,33
2. Zwischenausschüttungen	-9.559,49
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	-5.001.856,95
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	0,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-5.001.856,95
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-353,83
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-65.682,56
davon nicht realisierte Gewinne	3.735,50
davon nicht realisierte Verluste	-56.965,40
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	15.848.528,02

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen 98,71 %

Bestand der Derivate am Fondsvermögen 0,02 %

Sonstige Angaben

Monega Short Track SGB A

ISIN	DE0005321004
Fondsvermögen (EUR)	15.848.528,02
Anteilwert (EUR)	47,12
Umlaufende Anteile (STK)	336.335,00
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)	1.331.260,69
Anteilwert (EUR)	50,49
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 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):	99,98 %
- 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 31.12.2016)

gegründet: 11.12.1999

ombudsstelle.eps

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

Monega Short Track SGB A

WKN: 532100

ISIN: DE0005321004

Monega Short Track SGB T Net

WKN: A0NGFJ

ISIN: DE000A0NGFJ8

(DEVK) 08054-002/2018/04