

Lupus Alpha Return

Halbjahresbericht zum
28. Februar 2018

Lupus alpha 

m O N E G A 
DAS ATTRAKTIVE FONDSKONZEPT

Halbjahresbericht des Lupus Alpha Return

ZUM 28. FEBRUAR 2018

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	5
■ Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	6
■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)	
– LUPUS ALPHA RETURN I	7
– LUPUS ALPHA RETURN R	7
■ Entwicklung der Anteilklasse	
– LUPUS ALPHA RETURN I	8
– LUPUS ALPHA RETURN R	8
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	9
■ Firmenspiegel	10

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	73.594.157,27	100,44
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	47.740.341,67	65,16
Gedekte Schuldverschreibungen	36.905.818,87	50,37
Banking/Bankwesen	5.998.800,00	8,19
Staatlich garantierte Anlagen	4.835.722,80	6,60
3. Derivate	-4.216.016,02	-5,75
Aktienindex-Derivate	-4.216.016,02	-5,75
4. Forderungen	1.655.731,04	2,26
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	2.300.000,00	3,14
6. Bankguthaben	8.598.660,58	11,74
7. Sonstige Vermögensgegenstände	17.515.440,00	23,91
Termingeld	10.000.000,00	13,65
Zielfondsanteile	7.515.440,00	10,26
Rentenfonds	7.515.440,00	10,26
II. Verbindlichkeiten	-324.009,34	-0,44
Sonstige Verbindlichkeiten	-324.009,34	-0,44
III. Fondsvermögen	73.270.147,93	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							30.010.267,67	40,96		
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro							30.010.267,67	40,96		
0,2000 % DT.PFDBRBK. HYP-PFE R15250 MTN	DE000A13SWE6		EUR	1.785.000	-	- %	100,201	1.788.591,01	2,44	
0,3750 % MÜNCH.HYP. HYP.PFE S.1699 MTN	DE000MHB16J0		EUR	2.200.000	2.200.000	- %	101,250	2.227.498,57	3,04	
0,5000 % APOBANK HYP.-PFE V.18-25 MTN	XS1770021860		EUR	1.700.000	1.700.000	- %	99,159	1.685.703,94	2,30	
0,7500 % BAY.LBKA V.15-25	DE000A0Z1UH6		EUR	4.861.000	4.861.000	- %	99,480	4.835.722,80	6,60	
1,0000 % DEXIA KO.BK.DT. ÖPF S.1636 MTN	DE000DXA1NV3		EUR	10.000.000	-	- %	101,610	10.160.970,30	13,87	
1,1250 % NORD.LB PPF V.14-19 MTN	XS1033923142		EUR	1.700.000	-	- %	101,155	1.719.638,67	2,35	
1,8750 % DT.PFDBRBK. HYP-PFE R.15218 MTN	DE000A1X3LT7		EUR	2.929.000	-	- %	106,796	3.128.059,76	4,27	
2,1250 % DT.PFDBRBK. HYP-PFE R15157 MTN	DE000A1MLUW0		EUR	2.200.000	-	- %	103,133	2.268.917,53	3,10	
3,2500 % DEXIA KO.BK.DT. ÖPF S.1617 MTN	DE000DXA1M96		EUR	450.000	-	- %	109,684	493.578,00	0,67	
4,3750 % COBANK HYP.-PFE E.2308 MTN	DE000EH1A311		EUR	1.600.000	-	2.900.000 %	106,349	1.701.587,09	2,32	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							17.730.074,00	24,20		
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro							17.730.074,00	24,20		
0,0250 % KSK S.467	DE000A2BN3Z6		EUR	6.000.000	-	- %	99,980	5.998.800,00	8,19	
0,5000 % KSK KÖLN HYP-PFE E.1083	DE000A14J538		EUR	1.700.000	-	- %	99,022	1.683.374,00	2,30	
0,6250 % KSK KÖLN HYP-PFE E.1080	DE000A14J5X5		EUR	10.000.000	-	- %	100,479	10.047.900,00	13,71	
Investmentanteile							7.515.440,00	10,26		
Gesellschaftseigene Investmentanteile										
Euro							7.515.440,00	10,26		
MONEGA DÄNISCHE COV.BD. 'I'	DE000A1JSW48		ANT	74.000	67.650	54.800 EUR	101,560	7.515.440,00	10,26	
Summe Wertpapiervermögen							55.255.781,67	75,41		
Derivate							-4.216.016,02	-5,75		
Aktienindex-Derivate										
Aktienindex-Terminkontrakte							-1.609.617,53	-2,20		
DAX FUTURE 03/18		EUREX	STK	51		EUR	-28,500	-707.150,00	-0,97	
EURO STOXX 50 IND.FUT. 03/18		EUREX	STK	320		EUR	-9,000	-279.950,00	-0,38	
HANG SENG FUTURE 03/18		HFE	STK	43		HKD	-669,000	-529.420,38	-0,72	
NIKKEI 225 INDEX FUTURE 03/18		OSE	STK	42		JPY	-280,000	-349.556,85	-0,48	
S&P 500 INDEX MINI FUT. 03/18		CME	STK	125		USD	1,500	256.459,70	0,35	
Optionsrechte							-2.606.398,49	-3,56		
Optionsrechte auf Aktienindices										
CALL DAX 12600 12/18		EUREX	STK	-216		EUR	663,100	-716.148,00	-0,98	
CALL EURO STOXX 50 3300 12/18		EUREX	STK	-273		EUR	217,300	-593.229,00	-0,81	
CALL HANG SENG INDEX 29200 12/18		HFE	STK	-36		HKD	-388,000	-18.075,88	-0,02	
CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 22250 12/18		OSE	STK	-34		JPY	1.150,000	-298.746,94	-0,41	

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 28.02.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
CALL S&P 500 WEEKLY 2650 12/18		CBOE	STK	-53			USD	226,273	-982.142,67	-1,34
PUT EURO STOXX 50 3200 03/18		EUREX	STK	648			EUR	0,300	1.944,00	0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								20.898.660,58	28,52	
Bankguthaben								20.898.660,58	28,52	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	3.853.802,48		%	100,000	3.853.802,48	5,26	
Termingeld										
BANK IM BISTUM ESSEN EG			EUR	10.000.000,00		%	100,000	10.000.000,00	13,65	
Vorzeitig kündbares Termingeld										
BANK IM BISTUM ESSEN EG			EUR	2.300.000,00		%	100,000	2.300.000,00	3,14	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
KREISSPARKASSE KÖLN			HKD	3.043.663,20		%	100,000	318.384,80	0,43	
KREISSPARKASSE KÖLN			JPY	45.984.422,00		%	100,000	351.347,97	0,48	
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	4.975.931,79		%	100,000	4.075.125,33	5,56	
Sonstige Vermögensgegenstände								1.655.731,04	2,26	
ZINSANSPRÜCHE			EUR	250.348,18				250.348,18	0,34	
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	2.405,48				2.405,48	0,00	
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	1.402.977,38				1.402.977,38	1,91	
Sonstige Verbindlichkeiten								-324.009,34	-0,44	
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-285.042,62				-285.042,62	-0,39	
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-38.966,72				-38.966,72	-0,05	
Fondsvermögen							EUR	73.270.147,93	100,00^{*)}	

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

Lupus Alpha Return I

ISIN	DE000A0MS726
Fondsvermögen (EUR)	71.773.549,06
Anteilwert (EUR)	111,65
Umlaufende Anteile (STK)	642.855,00

Lupus Alpha Return R

ISIN	DE000A0MS734
Fondsvermögen (EUR)	1.496.598,87
Anteilwert (EUR)	54,50
Umlaufende Anteile (STK)	27.461,00

■ 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.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.02.2018

Hongkong Dollar	(HKD)	9,55970 = 1 (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	130,88000 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,22105 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CBOE	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
CME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
EUREX	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
HFE	Hongkong - HKEx - Hong Kong Futures Ex (HKFE)
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

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
0,0000 % BUND UNV.SCHANW. V.16-18	DE0001104636	EUR	1.300.000	1.300.000
0,0500 % BERLIN HYP HYP.-PFE S.192	DE000BHY0A64	EUR	-	500.000
1,0000 % AAREAL BK. HYP.-PFE S.174 MTN	DE000AAR0165	EUR	-	4.200.000
1,0000 % DKB ÖPF V.13-18	DE000DKB0176	EUR	-	1.000.000
4,5000 % DT.PFANDBRIEFBK. ÖPF S.573	DE0001617561	EUR	-	600.000

■ 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

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte	EUR	74.636
--------------------	-----	--------

Basiswerte: (DAX FUTURE 03/18, DAX FUTURE 09/17, DAX FUTURE 12/17, EURO STOXX 50 IND.FUT. 03/18, EURO STOXX 50 IND.FUT. 09/17, EURO STOXX 50 IND.FUT. 12/17, HANG SENG FUTURE 01/18, NIKKEI 225 INDEX FUTURE 03/18, NIKKEI 225 INDEX FUTURE 12/17, S&P 500 INDEX MINI FUT. 12/17)

Verkaufte Kontrakte	EUR	44.851
---------------------	-----	--------

Basiswerte: (S&P 500 INDEX MINI FUT. 03/18, S&P 500 INDEX MINI FUT. 12/17)

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Kaufoptionen (call)	EUR	108.000
------------------------------	-----	---------

Basiswerte: (CALL S&P 500 WEEKLY 2575 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2590 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2610 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2650 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2690 02/18)

Gekaufte Verkaufsoptionen (put)	EUR	43.776
---------------------------------	-----	--------

Basiswerte: (PUT S&P 500 WEEKLY 2680 02/18)

Verkaufte Kaufoptionen (call)	EUR	139.234
-------------------------------	-----	---------

Basiswerte: (CALL DAX 12000 12/17, CALL EURO STOXX 50 3650 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2450 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 2800 12/17, CALL S&P 500 WEEKLY 3000 02/18)

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

Lupus Alpha Return I

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	642.855,00	
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	269.812,50	0,4197097
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-5.571,95	-0,0086675
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
7. Erträge aus Investmentanteilen	159.751,13	0,2485026
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	423.991,68	0,6595448
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00	0,0000000
2. Verwaltungsvergütung	-184.929,41	-0,2876689
3. Verwahrstellenvergütung	-22.312,13	-0,0347079
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-11.775,10	-0,0183169
5. Sonstige Aufwendungen	-5.113,04	-0,0079536
Summe der Aufwendungen	-224.129,68	-0,3486473
III. Ordentlicher Nettoertrag	199.862,00	0,3108975
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	5.834.366,40	9,0757113
2. Realisierte Verluste	-2.359.545,29	-3,6704160
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	3.474.821,11	5,4052953
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	3.674.683,11	5,7161928
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-480.508,69	-0,7474605
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-1.216.945,97	-1,8930334
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-1.697.454,66	-2,6404938
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	1.977.228,45	3,0756990

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

Lupus Alpha Return R

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	27.461,00	
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	5.641,57	0,2054394
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-116,89	-0,0042566
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
7. Erträge aus Investmentanteilen	3.346,68	0,1218703
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	8.871,36	0,3230531
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00	0,0000000
2. Verwaltungsvergütung	-7.726,33	-0,2813565
3. Verwahrstellenvergütung	-466,48	-0,0169870
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-7.257,83	-0,2642959
5. Sonstige Aufwendungen	-107,01	-0,0038968
Summe der Aufwendungen	-15.557,65	-0,5665362
III. Ordentlicher Nettoertrag	-6.686,29	-0,2434831
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	122.168,33	4,4487939
2. Realisierte Verluste	-49.471,06	-1,8015025
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	72.697,27	2,6472914
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	66.010,98	2,4038083
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	-10.606,10	-0,3862241
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-24.713,06	-0,8999330
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-35.319,16	-1,2861571
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	30.691,82	1,1176512

■ Entwicklung der Anteilklasse

Lupus Alpha Return I

	EUR insgesamt
I. Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres	69.922.811,47
1. Ausschüttung für das Vorjahr	-541.759,92
2. Zwischenausschüttungen	-121.178,33
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	548.225,10
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	548.225,10
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-11.777,71
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	1.977.228,45
davon nicht realisierte Gewinne	-480.508,69
davon nicht realisierte Verluste	-1.216.945,97
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	71.773.549,06

■ Entwicklung der Anteilklasse

Lupus Alpha Return R

	EUR insgesamt
I. Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres	1.380.714,24
1. Ausschüttung für das Vorjahr	-3.990,48
2. Zwischenausschüttungen	-1.597,34
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	93.584,27
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	107.980,73
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-14.396,46
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-2.803,64
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	30.691,82
davon nicht realisierte Gewinne	-10.606,10
davon nicht realisierte Verluste	-24.713,06
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	1.496.598,87

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	75,41 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-5,75 %

Sonstige Angaben

Lupus Alpha Return I

ISIN	DE000A0MS726
Fondsvermögen (EUR)	71.773.549,06
Anteilwert (EUR)	111,65
Umlaufende Anteile (STK)	642.855,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 4,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 2,00%, derzeit 0,515%
Mindestanlagesumme (EUR)	250.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Lupus Alpha Return R

ISIN	DE000A0MS734
Fondsvermögen (EUR)	1.496.598,87
Anteilwert (EUR)	54,50
Umlaufende Anteile (STK)	27.461,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 4,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 2,00%, derzeit 1,035%
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):	96,89 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	8,86 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-5,75 %
------------------------------------	---------

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⁾
Monega Dänische Cov.Bd. 'I'	0,17000 % 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
 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

Kreissparkasse Köln
 Neumarkt 18-24, 50667 Köln
 modifiziert verfügbare haftende
 Eigenmittel: EURO 2.064.709.072,90
 (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

Lupus Alpha Return I
 WKN: A0MS72
 ISIN: DE000A0MS726

Lupus Alpha Return R
 WKN: A0MS73
 ISIN: DE000A0MS734

