

Halbjahresbericht

WGZ Corporate M

zum 30. April 2018

Halbjahresbericht des WGZ Corporate M

ZUM 30. APRIL 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
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7
■ Firmenspiegel	8

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	36.692.368,64	100,88
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	34.708.332,40	95,42
Basisindustrie	5.875.596,64	16,15
Automobil	4.333.005,96	11,91
Handel	4.321.236,23	11,88
Gesundheitswesen	3.918.580,88	10,77
Medien	3.007.746,46	8,27
Investitionsgüter	2.517.500,55	6,92
Konsumgüter	2.317.447,63	6,37
Technologie & Elektronik	2.060.025,25	5,66
Telekommunikation	1.593.178,45	4,38
Versicherungen	1.007.536,40	2,77
Transportwesen	1.004.422,79	2,76
Finanzsektor	1.003.300,00	2,76
Reise & Freizeit	750.929,41	2,06
Dienstleistungen	507.571,90	1,40
Immobilien	490.253,85	1,35
3. Derivate	-13.000,00	-0,04
Zins-Derivate	-13.000,00	-0,04
4. Forderungen	330.287,82	0,91
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	1.001.320,58	2,75
6. Bankguthaben	665.427,84	1,83
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-319.051,04	-0,88
Sonstige Verbindlichkeiten	-319.051,04	-0,88
III. Fondsvermögen	36.373.317,60	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 30.04.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere							23.655.462,88	65,04		
Verzinsliche Wertpapiere										
Euro							23.655.462,88	65,04		
0,5000 % CARLSBERG BREW. MTN V.17-23	XS1677902162		EUR	100.000	-	- %	98,041	98.041,49	0,27	
0,7500 % BERKSHIRE HATHAWAY V.15-23	XS1200670955		EUR	1.000.000	-	- %	100,754	1.007.536,40	2,77	
0,8750 % CK HUTCH.FIN.(16) II V.16-24	XS1497312295		EUR	1.000.000	-	- %	98,217	982.173,00	2,70	
0,8750 % GRENKE FIN. MTN V.17-22	XS1678629186		EUR	1.000.000	-	- %	100,330	1.003.300,00	2,76	
0,8750 % IMERYS MTN V.16-22	FR0013143344		EUR	500.000	-	- %	101,430	507.150,00	1,39	
1,0000 % WÜRTH FIN.INT. MTN V.15-22	XS1234248919		EUR	500.000	-	- %	102,775	513.874,50	1,41	
1,1250 % SIXT V.16-22	DE000A2BPDU2		EUR	500.000	-	500.000 %	99,840	499.200,00	1,37	
1,3750 % PIRELLI&C. MTN V.18-23	XS1757843146		EUR	500.000	500.000	- %	98,200	491.000,00	1,35	
1,5000 % FROMAGERIES BEL V.17-24	FR0013251329		EUR	600.000	-	- %	101,140	606.840,00	1,67	
1,5000 % PERNOD-RICARD V.16-26	FR0013172939		EUR	600.000	-	- %	102,414	614.484,74	1,69	
1,6250 % SOLVAY FIN. V.15-22	BE6282459609		EUR	1.000.000	-	- %	104,597	1.045.968,93	2,88	
1,7500 % EXOR V.18-28	XS1753808929		EUR	500.000	500.000	- %	98,345	491.724,25	1,35	
1,8750 % ERICSSON MTN V.17-24	XS1571293684		EUR	500.000	-	- %	97,795	488.975,25	1,34	
1,8750 % GLENC.FIN.EUR. MTN V.16-23	XS1489184900		EUR	600.000	-	- %	103,652	621.914,25	1,71	
1,8750 % IPSEN V.16-23	FR0013183563		EUR	200.000	-	- %	102,340	204.680,00	0,56	
1,8750 % PERKINELMER V.16-26	XS1405780617		EUR	1.000.000	-	- %	100,278	1.002.778,00	2,76	
2,0000 % PEUGEOT MTN V.18-25	FR0013323326		EUR	500.000	500.000	- %	99,870	499.350,15	1,37	
2,1250 % BUZZI UNICEM V.16-23	XS1401125346		EUR	500.000	-	- %	104,667	523.334,75	1,44	
2,1250 % EUROFINS SCIEN. V.17-24	XS1651444140		EUR	300.000	-	- %	101,510	304.530,00	0,84	
2,1250 % ILIAD V.15-22	FR0013065372		EUR	500.000	-	- %	104,620	523.100,00	1,44	
2,5000 % PRYSMIAN V.15-22	XS1214547777		EUR	500.000	-	- %	103,730	518.650,00	1,43	
2,5000 % SKY MTN V.14-26	XS1109741329		EUR	700.000	-	300.000 %	107,969	755.780,73	2,08	
2,5000 % THYSSENKRUPP MTN V.15-25	DE000A14J587		EUR	500.000	-	- %	105,212	526.061,75	1,45	
2,5000 % WENDEL V.15-27	FR0012516417		EUR	1.000.000	-	- %	104,360	1.043.603,30	2,87	
2,6250 % BERTELSMANN MTN V.12-22	XS0811690550		EUR	1.100.000	-	- %	109,406	1.203.465,73	3,31	
2,7500 % LAGARDÈRE V.16-23	FR0013153160		EUR	1.000.000	-	- %	104,850	1.048.500,00	2,88	
2,7500 % VESTAS WIND SYS. V.15-22	XS1197336263		EUR	500.000	-	- %	105,860	529.300,00	1,46	
2,7500 % ZF NTHA.CAP. V.15-23	DE000A14J7G6		EUR	1.000.000	-	- %	107,611	1.076.113,90	2,96	
3,0000 % AMÉRICA MÓVIL V.12-21	XS0802174044		EUR	1.000.000	-	- %	108,625	1.086.245,60	2,99	
3,1250 % EUTELSAT V.12-22	FR0011339746		EUR	800.000	-	- %	110,980	887.840,00	2,44	
3,1250 % THYSSENKRUPP MTN V.14-19	DE000A1R0410		EUR	600.000	-	- %	103,613	621.675,12	1,71	
3,2500 % EUROFINS SCIEN. FRN V.17-UND.	XS1716945586		EUR	300.000	300.000	- %	99,120	297.360,00	0,82	
3,2500 % HEIDELB.CEM.FIN.LU MTN V.13-21	XS1002933072		EUR	500.000	-	500.000 %	109,833	549.165,19	1,51	
3,8750 % HORNBAACH BAUMARKT V.13-20	DE000A1R02E0		EUR	500.000	-	- %	105,453	527.265,85	1,45	

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
4,0000 % LOUIS DREYFUS COMP. V.13-20	XS1000918018		EUR	600.000	-	- %	106,170	637.020,00	1,75
4,2500 % BAYWA FRN V.17-UND.	XS1695284114		EUR	300.000	300.000	- %	105,820	317.460,00	0,87
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere								11.052.869,52	30,39
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								11.052.869,52	30,39
1,1250 % RYANAIR MTN V.17-23	XS1565699763		EUR	500.000	-	- %	101,045	505.222,79	1,39
1,2500 % KELLOGG V.15-25	XS1199356954		EUR	1.000.000	-	- %	99,808	998.081,40	2,74
1,6250 % JAB HOLD. V.15-25	DE000A1Z0TA4		EUR	1.000.000	-	- %	101,743	1.017.426,16	2,80
1,7500 % MÖLNLYCKE HOLD. V.15-24	XS1317732771		EUR	1.000.000	-	- %	102,595	1.025.949,58	2,82
2,1250 % ADLER R. EST. V.17-24	XS1731858715		EUR	500.000	500.000	- %	98,051	490.253,85	1,35
2,1250 % INEOS FIN. V.17-25	XS1577947440		EUR	500.000	-	- %	96,505	482.525,70	1,33
2,1250 % REXEL V.17-25	XS1716833352		EUR	500.000	500.000	- %	96,785	483.926,45	1,33
2,3750 % CELLNEX TELEC. MTN V.16-24	XS1468525057		EUR	500.000	-	- %	101,387	506.932,85	1,39
2,5000 % DUFY ONE V.17-24	XS1699848914		EUR	100.000	-	- %	101,389	101.388,70	0,28
2,5000 % MAHLE MTN V.14-21	XS1068092839		EUR	400.000	-	- %	105,110	420.440,00	1,16
3,0000 % ELIS V.15-22	XS1225112272		EUR	500.000	-	- %	101,514	507.571,90	1,40
3,2500 % SCHAEFFLER FIN. V.15-25	XS1212470972		EUR	1.000.000	-	- %	106,530	1.065.300,00	2,93
3,6250 % PHOENIX PIB DUT.FIN. 14-21	XS1091770161		EUR	1.000.000	-	- %	108,328	1.083.283,30	2,98
4,5000 % DUFY FIN. V.15-23	XS1266592457		EUR	800.000	-	- %	104,104	832.835,52	2,29
4,7500 % FIAT CHRY.FIN.EUR. MTN V.14-21	XS1048568452		EUR	700.000	-	- %	111,543	780.801,91	2,15
4,7500 % INT.GAME TECHN. V.12-20	XS0860855930		EUR	700.000	-	- %	107,276	750.929,41	2,06
Summe Wertpapiervermögen								34.708.332,40	95,42
Derivate								-13.000,00	-0,04
Zins-Derivate									
Zinsterminkontrakte								-13.000,00	-0,04
EURO-BUND-FUTURE 06/18		EUREX	STK	-1.000.000				-13.000,00	-0,04
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.666.748,42	4,58
Bankguthaben								1.666.748,42	4,58
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	665.427,84		%	100,000	665.427,84	1,83
Vorzeitig kündbares Termingeld									
UNICREDIT BANK AG			EUR	1.001.320,58		%	100,000	1.001.320,58	2,75
Sonstige Vermögensgegenstände								330.287,82	0,91
ZINSANSPRÜCHE			EUR	316.287,82				316.287,82	0,87
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	14.000,00				14.000,00	0,04
Sonstige Verbindlichkeiten								-319.051,04	-0,88
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-304.392,25				-304.392,25	-0,84

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-14.658,79				-14.658,79	-0,04
Fondsvermögen						EUR		36.373.317,60	100,00*

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

WGZ Corporate M (I)

ISIN	DE000A1JSWX5
Fondsvermögen (EUR)	24.863.069,14
Anteilwert (EUR)	99,48
Umlaufende Anteile (STK)	249.918,00

WGZ Corporate M (R)

ISIN	DE000A1143P2
Fondsvermögen (EUR)	11.510.248,46
Anteilwert (EUR)	101,63
Umlaufende Anteile (STK)	113.251,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.04.2018 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

1,3750 % METRO MTN V.14-21	DE000A13R8M3	EUR	-	500.000
2,1250 % NESTE V.15-22	FI4000148671	EUR	-	700.000
2,6250 % EUTELSAT V.13-20	FR0011660596	EUR	-	500.000
3,3750 % EUROFINS SCIEN. V.15-23	XS1268496640	EUR	-	500.000
5,6250 % BARRY CALLEBAUT SERV. V.11-21	BE6222320614	EUR	-	500.000
7,0000 % SAF HOLLAND V.12-18	DE000A1HA979	EUR	-	500.000

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

1,0000 % PROSEGUR V.18-23	XS1759603761	EUR	500.000	500.000
1,6250 % CARNIVAL V.16-21	XS1319820624	EUR	-	800.000
1,8750 % BSH HAUSGERÄTE V.13-20	XS0992602465	EUR	-	500.000
3,2500 % REXEL V.15-22	XS1238996018	EUR	-	500.000

Nicht notierte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Euro

5,6250 % EGGER HOLZWERKST. V.11-18	AT0000A0NBF0	EUR	-	250.000
------------------------------------	--------------	-----	---	---------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	95,42 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,04 %

Sonstige Angaben

WGZ Corporate M (I)

ISIN	DE000A1JSWX5
Fondsvermögen (EUR)	24.863.069,14
Anteilwert (EUR)	99,48
Umlaufende Anteile (STK)	249.918,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,50%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,75%, derzeit 0,35%
Mindestanlagesumme (EUR)	100.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

WGZ Corporate M (R)

ISIN	DE000A1143P2
Fondsvermögen (EUR)	11.510.248,46
Anteilwert (EUR)	101,63
Umlaufende Anteile (STK)	113.251,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 2,50%, derzeit 1,50%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,75%, derzeit 0,65%
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):	100,04 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-0,04 %
------------------------------------	---------

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



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

DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank
 Platz der Republik, 60265 Frankfurt am Main

Eigenkapital gezeichnet und eingezahlt:	EURO	4.657.000.000,00
modifiziert verfügbare haftende Eigenmittel:	EURO	19.050.000.000,00

(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

WGZ Corporate M (I)

WKN: A1JSWX

ISIN: DE000A1JSWX5

WGZ Corporate M (R)

WKN: A1143P

ISIN: DE000A1143P2

