

Halbjahresbericht

alpha beta Aktien Global Plus

zum 28. Februar 2018

Halbjahresbericht des alpha beta Aktien Global Plus

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)	
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (I)	6
■ Entwicklung der Anteilklasse	
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (I)	7
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
■ Firmenspiegel	10

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	17.097.563,82	100,07
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-69.270,00	-0,41
Aktienindex-Derivate	-69.270,00	-0,41
4. Forderungen	87.796,12	0,51
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	2.124.043,74	12,43
7. Sonstige Vermögensgegenstände	14.954.993,96	87,53
Zielfondsanteile	14.954.993,96	87,53
Indexfonds	14.954.993,96	87,53
II. Verbindlichkeiten	-11.357,03	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-11.357,03	-0,07
III. Fondsvermögen	17.086.206,79	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
Investmentanteile								14.954.993,96	87,53
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								9.751.647,90	57,07
AMUNDI ETF FR EUR.COR.1-3	FR0012005734		ANT	19.700	28.500	8.800 EUR	101,520	1.999.944,00	11,71
ISHARES DAX	DE0005933931		ANT	3.190	3.190	- EUR	108,000	344.520,00	2,02
ISHARES V-S&P 500 EUR-HD.	IE00B3ZW0K18		ANT	49.000	49.000	- EUR	62,100	3.042.900,00	17,81
SSGA SEII-MSCI EUR.CON.S.DISC.	IE00BKWQ0C77		ANT	2.590	5.190	2.600 EUR	116,200	300.958,00	1,76
XTR.(IE) - S&P 500 '1C'	IE00BM67HW99		ANT	16.900	16.900	- EUR	42,554	719.162,60	4,21
XTRACKERS EURO STOXX 50 '1D'	LU0274211217		ANT	26.930	76.660	49.730 EUR	36,585	985.234,05	5,77
XTRACKERS FTSE MIB '1D'	LU0274212538		ANT	14.310	14.310	- EUR	23,515	336.499,65	1,97
XTRACKERS STOXX EUR.600 '1C'	LU0328475792		ANT	25.770	25.770	- EUR	78,480	2.022.429,60	11,84
US-Dollar								5.203.346,06	30,45
ISHARES III-MSCI JP.SM.CAP.	IE00B2QWDY88		ANT	18.940	42.150	23.210 USD	44,893	696.348,89	4,08
ISHSIV-AUTOM.&ROBOT.U.	IE00BYZK4552		ANT	58.080	58.080	- USD	8,063	383.502,24	2,24
UBS-ETF-MSCI E.M.S.RES.U. 'A'	LU1048313891		ANT	182.080	182.080	- USD	15,252	2.274.341,07	13,31
XTRACKERS HARVEST CSI300 '1D'	LU0875160326		ANT	138.550	138.550	- USD	12,648	1.435.100,90	8,40
XTRACKERS MSCI CHINA '1C'	LU0514695690		ANT	24.880	138.410	113.530 USD	20,321	414.052,96	2,42
Summe Wertpapiervermögen								14.954.993,96	87,53
Derivate								-69.270,00	-0,41
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte								-69.270,00	-0,41
EURO STOXX 50 IND.FUT. 03/18		EUREX	STK	-19		EUR	-9,000	-17.860,00	-0,10
STXE 600 INDEX FUT.(50) 03/18		EUREX	STK	-106		EUR	-1,400	-51.410,00	-0,30
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								2.124.043,74	12,43
Bankguthaben								2.124.043,74	12,43
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	2.124.043,74		%	100,000	2.124.043,74	12,43
Sonstige Vermögensgegenstände								87.796,12	0,51
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	9.396,12				9.396,12	0,05
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	78.400,00				78.400,00	0,46
Sonstige Verbindlichkeiten								-11.357,03	-0,07
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-11.357,03				-11.357,03	-0,07
Fondsvermögen						EUR		17.086.206,79	100,00*)

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

alpha beta Aktien Global Plus (I)

ISIN	DE000A141WR0
Fondsvermögen (EUR)	11.093.065,32
Anteilwert (EUR)	102,38
Umlaufende Anteile (STK)	108.348,00

alpha beta Aktien Global Plus (R)

ISIN	DE000A2DL379
Fondsvermögen (EUR)	5.993.141,47
Anteilwert (EUR)	51,14
Umlaufende Anteile (STK)	117.198,00

■ 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

US-Dollar	(USD)	1,22105 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

■ 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
---------------------	------	------------------------------------	-------------------	----------------------

Investmentanteile

Gesellschaftsfremde Investmentanteile

Euro

ISH.STOXX EUR.600 UTILITY	DE000A0Q4R02	ANT	18.070	18.070
XTR.II EUR CASH SWAP '1C'	LU0290358497	ANT	10.700	10.700

US-Dollar

ISHARESIII-MSCI AUSTRALIEN	IE00B5377D42	ANT	55.420	55.420
ISHARESIII-S&P SM.CAP.600	IE00B2QWCY14	ANT	7.400	7.400
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34	ANT	157.810	157.810
ISHARES-MSCI EM.MARK.	IE00B0M63177	ANT	67.890	67.890
ISHARES NASDAQ-100	DE000A0F5UF5	ANT	30.890	30.890
ISHARES VII-MSCI CANADA	IE00B52SF786	ANT	4.250	4.250
ISHARES V-S&P 500 FIN.SEC.U.E.	IE00B4JNQZ49	ANT	119.820	119.820
SSGA S&P US IND.SEL.SEC.	IE00BWBXM724	ANT	42.480	42.480
XTR.(IE)-MSCI WORLD C.ST. '1C'	IE00BM67HN09	ANT	41.760	41.760

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

alpha beta Aktien Global Plus (I)

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	108.348,00	
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	0,00	0,0000000
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-806,56	-0,0074442
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00	0,0000000
7. Erträge aus Investmentanteilen	156.615,52	1,4454860
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	155.808,96	1,4380419
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00	0,0000000
2. Verwaltungsvergütung	-38.131,84	-0,3519386
3. Verwahrstellenvergütung	-5.013,71	-0,0462741
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-5.165,91	-0,0476789
5. Sonstige Aufwendungen	-6.742,97	-0,0622344
Summe der Aufwendungen	-55.054,43	-0,5081259
III. Ordentlicher Nettoertrag	100.754,53	0,9299159
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	361.324,11	3,3348480
2. Realisierte Verluste	-160.903,07	-1,4850581
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	200.421,04	1,8497899
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	301.175,57	2,7797059
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	137.153,25	1,2658586
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-157.976,20	-1,4580444
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-20.822,95	-0,1921858
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	280.352,62	2,5875200

■ Entwicklung der Anteilklasse

alpha beta Aktien Global Plus (I)

	EUR insgesamt
I. Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres	0,00
1. Ausschüttung für das Vorjahr	0,00
2. Zwischenausschüttungen	-28.635,62
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	10.841.316,28
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	10.841.316,28
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	32,04
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	280.352,62
davon nicht realisierte Gewinne	137.153,25
davon nicht realisierte Verluste	-157.976,20
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	11.093.065,32

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	87,53 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,41 %

Sonstige Angaben

alpha beta Aktien Global Plus (I)

ISIN	DE000A141WR0
Fondsvermögen (EUR)	11.093.065,32
Anteilwert (EUR)	102,38
Umlaufende Anteile (STK)	108.348,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,75%
Mindestanlagesumme (EUR)	100.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

alpha beta Aktien Global Plus (R)

ISIN	DE000A2DL379
Fondsvermögen (EUR)	5.993.141,47
Anteilwert (EUR)	51,14
Umlaufende Anteile (STK)	117.198,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 1,50%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,95%
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):	100,41 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-0,41 %
------------------------------------	---------

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⁾
Amundi ETF FR Eur.Cor.1-3	0,10000 % p.a.
iShares DAX	0,15000 % p.a.
iShares NASDAQ-100	0,30000 % p.a.
iShares V-S&P 500 Fin.Sec.U.E.	0,15000 % p.a.
iSharesIII-MSCI Australien	0,50000 % p.a.
iSharesIII-MSCI Jp.Sm.Cap.	0,58000 % p.a.
iSharesIII-S&P Sm.Cap.600	0,40000 % p.a.
iSharesII-S&P Gl Clean En.	0,65000 % p.a.
iShares-MSCI Em.Mark.	0,75000 % p.a.
iSharesVII-MSCI Canada	0,48000 % p.a.
iSharesV-S&P 500 EUR-Hd.	0,45000 % p.a.
iShsIV-Autom.&Robot.U.	0,40000 % p.a.
iSh.STOXX Eur.600 Utility	0,45000 % p.a.
SSGA SEII-MSCI Eur.Cons.Disc.	0,30000 % p.a.
SSGA S&P US Ind.Sel.Sec.	0,15000 % p.a.
UBS-ETF-MSCI E.M.S.Res.U. 'A'	0,53000 % p.a.
Xtrackers Euro Stoxx 50 'ID'	0,01000 % p.a.

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Xtrackers FTSE MIB '1D'	0,20000 % p.a.
Xtrackers Harvest CSI300 '1D'	0,45000 % p.a.
Xtrackers MSCI China '1C'	0,45000 % p.a.
Xtrackers Stoxx Eur.600 '1C'	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE) - S&P 500 '1C'	0,10000 % p.a.
Xtr.(IE)-MSCI World C.St. '1C'	0,15000 % p.a.
Xtr.II EUR Cash Swap '1C'	0,05000 % 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 Rücknahmeaufschläge 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 2.168.200.000,00
 (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

alpha beta Aktien Global Plus (I)
 WKN: A141WR
 ISIN: DE000A141WR0

alpha beta Aktien Global Plus (R)
 WKN: A2DL37
 ISIN: DE000A2DL379

