

Halbjahresbericht

FO Core *plus*

zum 30. April 2019

Halbjahresbericht des FO Core *plus*

ZUM 30. APRIL 2019

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6
■ Firmenspiegel	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	26.243.242,23	100,06
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-1.493.096,12	-5,69
Aktienindex-Derivate	-1.493.096,12	-5,69
4. Forderungen	0,00	0,00
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.071.781,09	4,09
7. Sonstige Vermögensgegenstände	26.664.557,26	101,67
Zielfondsanteile	26.664.557,26	101,67
Indexfonds	26.664.557,26	101,67
II. Verbindlichkeiten	-16.116,85	-0,06
Sonstige Verbindlichkeiten	-16.116,85	-0,06
III. Fondsvermögen	26.227.125,38	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 30.04.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Investmentanteile								26.664.557,26	101,67
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro								14.557.248,80	55,50
DEKA DAX ETF	DE000ETFL011	ANT		22.910	22.910	-	EUR 112,340	2.573.709,40	9,81
DEKA MDAX UCITS ETF	DE000ETFL441	ANT		10.240	10.240	-	EUR 250,700	2.567.168,00	9,79
ISHARES STOXX EUROPE 600	DE0002635307	ANT		120.670	120.670	-	EUR 38,940	4.698.889,80	17,92
LYXOR IND.-L.CO.ST.EUR.600(DR)	LU0908500753	ANT		30.040	30.040	-	EUR 157,040	4.717.481,60	17,99
US-Dollar								9.639.718,34	36,75
ISHARES VII- CORE S&P 500	IE00B5BMR087	ANT		18.080	18.080	-	USD 288,350	4.651.885,43	17,74
SPDR S&P 500	IE00B6YX5C33	ANT		18.945	18.945	-	USD 295,058	4.987.832,91	19,02
Japanische Yen								2.467.590,12	9,41
ISHARES VII-NIKKEI 225	IE00B52MJD48	ANT		14.620	14.620	-	JPY 21.067,000	2.467.590,12	9,41
Summe Wertpapiervermögen								26.664.557,26	101,67
Derivate								-1.493.096,12	-5,69
Aktienindex-Derivate									
Optionsrechte								-1.493.096,12	-5,69
Optionsrechte auf Aktienindices									
CALL DAX 11600 06/19		EUREX	STK	-78			EUR 810,200	-315.978,00	-1,20
CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 23750 06/19		OSE	STK	-12			JPY 43,000	-4.134,02	-0,02
CALL STXE 600 INDEX FUTURE 365 06/19		EUREX	STK	-480			EUR 23,400	-561.600,00	-2,14
PUT DAX 11500 06/19		EUREX	STK	78			EUR 49,700	19.383,00	0,07
PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 21500 06/19		OSE	STK	13			JPY 240,000	24.996,40	0,10
PUT STXE 600 INDEX FUTURE 365 06/19		EUREX	STK	480			EUR 1,300	31.200,00	0,12
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte									
CALL E-MINI S&P 500 FUT.2740 06/19		CME	STK	-73			USD 220,100	-716.842,15	-2,73
PUT E-MINI S&P 500 FUT. 2490 06/19		CME	STK	37			USD 3,700	6.107,79	0,02
PUT E-MINI S&P 500 FUT. 2775 06/19		CME	STK	36			USD 14,800	23.770,86	0,09
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.071.781,09	4,09
Bankguthaben								1.071.781,09	4,09
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	808.751,21			% 100,000	808.751,21	3,08
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			JPY	7.540.232,00			% 100,000	60.409,84	0,23
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	227.076,28			% 100,000	202.620,04	0,77
Sonstige Verbindlichkeiten								-16.116,85	-0,06
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.037,90				-1.037,90	0,00
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-15.078,95				-15.078,95	-0,06
Fondsvermögen							EUR	26.227.125,38	100,00*

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

FO Core *plus*

ISIN	DE000A2JN5A6
Fondsvermögen (EUR)	26.227.125,38
Anteilwert (EUR)	101,97
Umlaufende Anteile (STK)	257.211,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 30.04.2019 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.04.2019

Japanische Yen	(JPY)	124,81795 = 1 (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,12070 = 1 (EUR)

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CME	Chicago - Chicago Mercantile Exchange (CME)
EUREX	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
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**

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
---------------------	------------------------------------	---------------------

Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (put)	EUR	24.938
----------------------------------------	------------	---------------

Basiswerte: (PUT DAX 10550 06/19, PUT DAX 11600 12/18, PUT NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 21875 12/18, PUT STXE 600 INDEX FUTURE 335 06/19, PUT STXE 600 INDEX FUTURE 365 12/18)

Verkaufte Kaufoptionen (call)	EUR	13.929
--------------------------------------	------------	---------------

Basiswerte: (CALL DAX 12700 12/18, CALL NIKKEI 225 STOCK AVERAGE 24250 12/18, CALL STXE 600 INDEX FUTURE 395 12/18)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	101,67 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-5,69 %

Sonstige Angaben

FO Core plus

ISIN	DE000A2JN5A6
Fondsvermögen (EUR)	26.227.125,38
Anteilwert (EUR)	101,97
Umlaufende Anteile (STK)	257.211,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 5,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,50%, derzeit 0,68%
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 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):	86,68 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	19,02 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-5,69 %
------------------------------------	---------

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⁾
Deka DAX ETF	0,15000 % p.a.
Deka MDAX UCITS ETF	0,30000 % p.a.
iShares STOXX Europe 600	0,19000 % p.a.
iSharesVII- Core S&P 500	0,07000 % p.a.
iSharesVII-Nikkei 225	0,48000 % p.a.
Lyxor Ind.-L.Co.St.Eur.600(DR)	0,30000 % p.a.
SPDR S&P 500	0,09000 % p.a.

¹⁾ Von anderen Kapitalverwaltungsgesellschaften 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 31.12.2018)
 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

Kreissparkasse Köln
 Neumarkt 18-24, 50667 Köln
 modifiziert verfügbare haftende
 Eigenmittel: EURO 2.265.300.000,00
 (Stand 31.12.2017)

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

WKN: A2JN5A
 ISIN: DE000A2JN5A6

