

Halbjahresbericht

SWuK Prämienfonds

zum 30. Juni 2019

Halbjahresbericht des SWuK Prämienfonds

ZUM 30. JUNI 2019

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7
■ Firmenspiegel	8

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	13.041.816,02	118,23
1. Aktien	99.525,82	0,90
Rohstoffe	54.948,19	0,50
Gesundheitswesen	44.577,63	0,40
2. Anleihen	3.116.551,63	28,25
Regierungsanleihen	3.116.551,63	28,25
3. Derivate	-771.008,44	-6,99
Derivate auf einzelne Wertpapiere	-771.008,44	-6,99
4. Forderungen	1.992.083,20	18,06
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	4.000.000,00	36,26
6. Bankguthaben	4.604.663,81	41,74
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-2.010.949,56	-18,23
Sonstige Verbindlichkeiten	-2.010.949,56	-18,23
III. Fondsvermögen	11.030.866,46	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 30.06.2019	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere								3.216.077,45	29,16	
Aktien										
US-Dollar								99.525,82	0,90	
MOSAIC	US61945C1036		STK	2.500	2.500	-	USD	25,030	54.948,19	0,50
TEVA PHARMA.IND. (ADRS)	US8816242098		STK	5.500	11.000	5.500	USD	9,230	44.577,63	0,40
Verzinsliche Wertpapiere								3.116.551,63	28,25	
Euro										
0,0000 % BUND SCHANW. V.17-19	DE0001104701		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	100,280	1.002.800,00	9,09
0,0000 % BUND. SCHANW. V.18-20	DE0001104727		EUR	100.000	100.000	-	%	100,639	100.638,63	0,91
0,0000 % BUND SCHANW. V.18-20	DE0001104719		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	100,470	1.004.700,00	9,11
0,0000 % BUND SCHANW. V.18-20	DE0001104735		EUR	1.000.000	1.000.000	-	%	100,841	1.008.413,00	9,14
Summe Wertpapiervermögen								3.216.077,45	29,16	
Derivate								-771.008,44	-6,99	
Derivate auf einzelne Wertpapiere										
Wertpapier-Optionsrechte								-771.008,44	-6,99	
Optionsrechte auf Aktien										
PUT AURUBIS 42 12/19		EUREX	STK	-4.500			EUR	2,870	-12.915,00	-0,12
PUT AURUBIS 44 03/20		EUREX	STK	-4.500			EUR	5,420	-24.390,00	-0,22
PUT BASF 66 12/19		EUREX	STK	-3.000			EUR	4,790	-14.370,00	-0,13
PUT BAYER 60 12/19		EUREX	STK	-3.000			EUR	4,550	-13.650,00	-0,12
PUT BIOGEN IDEC 200 03/20		CBOE	STK	-1.000			USD	10,000	-8.781,17	-0,08
PUT CONTINENTAL 130 12/19		EUREX	STK	-1.500			EUR	11,220	-16.830,00	-0,15
PUT COVESTRO 44 12/19		EUREX	STK	-4.500			EUR	3,520	-15.840,00	-0,14
PUT COVESTRO 46 03/20		EUREX	STK	-4.500			EUR	5,510	-24.795,00	-0,22
PUT DAIMLER 49 12/19		EUREX	STK	-4.000			EUR	3,440	-13.760,00	-0,12
PUT DRAEGERWERK 44 03/20		EUREX	STK	-4.500			EUR	1,270	-5.715,00	-0,05
PUT DUERR AG 32 12/19		EUREX	STK	-5.000			EUR	4,000	-20.000,00	-0,18
PUT DUERR AG 34 03/20		EUREX	STK	-5.000			EUR	5,920	-29.600,00	-0,27
PUT E.ON 10 03/20		EUREX	STK	-20.000			EUR	0,910	-18.200,00	-0,16
PUT EVONIK INDUSTRIES AG 24 03/20		EUREX	STK	-8.500			EUR	1,180	-10.030,00	-0,09
PUT FRESENIUS MEDICAL CARE 64 12/19		EUREX	STK	-3.000			EUR	3,140	-9.420,00	-0,09
PUT FRESENIUS 44 12/19		EUREX	STK	-2.500			EUR	2,030	-5.075,00	-0,05
PUT GEA GROUP 19 03/20		EUREX	STK	-10.000			EUR	0,620	-6.200,00	-0,06
PUT GENERAL ELECTRIC 09 10/19		CBOE	STK	-20.000			USD	0,204	-3.577,45	-0,03
PUT HELLA GMBH+CO. KGAA O.N. 46 03/20		EUREX	STK	-4.000			EUR	6,130	-24.520,00	-0,22
PUT JUNGHEINRICH AG 24 12/19		EUREX	STK	-5.000			EUR	0,840	-4.200,00	-0,04
PUT KION GROUP AG 48 12/19		EUREX	STK	-3.500			EUR	1,700	-5.950,00	-0,05
PUT KRONES 68 03/20		EUREX	STK	-3.000			EUR	5,040	-15.120,00	-0,14
PUT K+S 15 12/19		EUREX	STK	-14.000			EUR	0,780	-10.920,00	-0,10
PUT LEONI 16 12/19		EUREX	STK	-6.500			EUR	3,050	-19.825,00	-0,18
PUT LEONI 26 12/19		EUREX	STK	-4.000			EUR	12,020	-48.080,00	-0,44
PUT LEONI 30 12/19		EUREX	STK	-3.500			EUR	15,970	-55.895,00	-0,51
PUT MOSAIC CO/THE 30 01/17		CBOE	STK	-3.000			USD	5,598	-14.745,79	-0,13
PUT NEWMONT MINING 33 01/20		CBOE	STK	-7.000			USD	0,825	-5.068,05	-0,05
PUT OSRAM AG 36 12/19		EUREX	STK	-5.500			EUR	8,420	-46.310,00	-0,42
PUT OSRAM AG 38 12/19		EUREX	STK	-3.500			EUR	10,100	-35.350,00	-0,32

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.06.2019	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
PUT PETROCHINA 65 09/12		CBOE	STK	-3.000			USD 10,033	-26.431,51	-0,24
PUT RIO TINTO PLC LS-10 ADR 1 55 01/20		CBOE	STK	-3.000			USD 2,100	-5.532,14	-0,05
PUT ROYAL DUTCH SHELL 27 12/19		EOE	STK	-7.500			EUR 0,910	-6.825,00	-0,06
PUT ROYAL DUTCH SHELL 28 03/20		EOE	STK	-7.000			EUR 1,840	-12.880,00	-0,12
PUT SOFTWARE 30 12/19		EUREX	STK	-5.000			EUR 2,070	-10.350,00	-0,09
PUT SUEZÜCKER 12 12/19		EUREX	STK	-10.000			EUR 0,390	-3.900,00	-0,04
PUT TEVA PHARMA. 15 01/20		CBOE	STK	-7.500			USD 5,870	-38.661,09	-0,35
PUT TEVA PHARMA. 17,50 01/20		CBOE	STK	-2.000			USD 8,280	-14.542,15	-0,13
PUT VALE 10,00 01/20		CBOE	STK	-11.100			USD 0,270	-2.631,72	-0,02
PUT VOLKSWAGEN VZ. 140 12/19		EUREX	STK	-1.000			EUR 6,900	-6.900,00	-0,06
PUT WACKER CHEMIE 72 03/20		EUREX	STK	-3.000			EUR 10,190	-30.570,00	-0,28
PUT WACKER CHEMIE 80 12/19		EUREX	STK	-2.500			EUR 13,910	-34.775,00	-0,32
PUT WESTERN DIGITAL 42,5 01/20		CBOE	STK	-4.000			USD 4,478	-15.727,08	-0,14
PUT WESTERN DIGITAL 45,0 01/20		CBOE	STK	-4.500			USD 5,606	-22.150,29	-0,20
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								8.604.663,81	78,01
Bankguthaben								8.604.663,81	78,01
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	4.587.565,32			% 100,000	4.587.565,32	41,59
Vorzeitig kündbares Termingeld									
DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE FRANKFURT			EUR	2.000.000,00			% 100,000	2.000.000,00	18,13
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL GENOSSENSCHAFTSBANK			EUR	2.000.000,00			% 100,000	2.000.000,00	18,13
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	19.471,76			% 100,000	17.098,49	0,16
Sonstige Vermögensgegenstände								1.992.083,20	18,06
ZINSANSPRÜCHE			EUR	-158,34				-158,34	0,00
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	1.992.241,54				1.992.241,54	18,06
Sonstige Verbindlichkeiten								-2.010.949,56	-18,23
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-2.000.000,00				-2.000.000,00	-18,13
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-10.949,56				-10.949,56	-0,10
Fondsvermögen							EUR	11.030.866,46	100,00*)
Anteilwert							EUR	97,78	
Umlaufende Anteile							STK	112.815,3930	

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

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.06.2019 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.06.2019

US-Dollar	(USD)	1,13880 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CBOE	Chicago - Chicago Board Options Exchange (CBOE)
EOE	Amsterdam - Euronext Amsterdam - Derivatives
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**

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

Wertpapier-Optionsrechte

Optionsrechte auf Aktien

Verkaufte Verkaufsoptionen (put)	EUR	850
---	------------	------------

Basiswerte: (PUT FRESENIUS 40 12/19, PUT GEA GROUP 17 12/19, PUT KRONES 68 12/19, PUT MOSAIC CO/THE 30 01/17, PUT RIO TINTO PLC LS-10 ADR 1 47,5 01/20, PUT RWE 19 12/19, PUT TEVA PHARMA. 17,50 01/20)

Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate

Optionsrechte auf Aktienindices

Gekaufte Verkaufsoptionen (put)	EUR	3.391
--	------------	--------------

Basiswerte: (PUT DAX 10000 06/19, PUT DAX 10300 03/19, PUT DAX 10450 06/19, PUT DAX 10500 06/19, PUT DAX 11000 05/19, PUT DAX 11000 06/19, PUT DAX 11050 03/19, PUT DAX 11500 06/19, PUT S&P 500 2300 06/19, PUT S&P 500 2650 03/19)

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	29,16 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-6,99 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	97,78
Umlaufende Anteile (STK)	112.815,3930

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):	106,99 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-6,99 %
------------------------------------	---------

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 31.12.2018)
 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: A2JQL0
 ISIN: DE000A2JQL00

