

Halbjahresbericht

Greiff Equity L/S

zum 31. Oktober 2018

Halbjahresbericht des Greiff Equity L/S

ZUM 31. OKTOBER 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	6
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7
■ Firmenspiegel	8

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	10.093.576,92	106,80
1. Aktien	8.814.543,81	93,27
Finanzwerte	2.307.770,66	24,42
Konsumgüter	1.824.669,44	19,31
Gesundheitswesen	1.494.176,01	15,81
Industriewerte	1.075.163,29	11,38
Technologie	878.703,19	9,30
Telekommunikation	593.544,68	6,28
Rohstoffe	334.202,54	3,54
Verbraucher-Dienstleistungen	306.314,00	3,24
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	349.212,23	3,70
Aktienindex-Derivate	474.067,59	5,02
Devisen-Derivate	-124.855,36	-1,32
4. Forderungen	7.416,89	0,08
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	922.403,99	9,76
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-643.034,81	-6,80
Sonstige Verbindlichkeiten	-643.034,81	-6,80
III. Fondsvermögen	9.450.542,11	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 31.10.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere							8.814.543,81	93,27	
Aktien									
Euro							2.861.682,08	30,28	
ADIDAS NAM.	DE000A1EWWW0		STK	1.418	1.418	2.037 EUR	208,000	294.944,00	3,12
ALLIANZ VINK.NAM.	DE0008404005		STK	1.676	1.676	1.686 EUR	184,440	309.121,44	3,27
DEUTSCHE BK.	DE0005140008		STK	29.068	29.068	- EUR	8,651	251.467,27	2,66
DT.POST NAM.	DE0005552004		STK	9.030	9.030	- EUR	27,950	252.388,50	2,67
DT.TELEKOM NAM.	DE0005557508		STK	19.817	40.366	44.367 EUR	14,495	287.247,42	3,04
LINDE	IE00BZ12WP82		STK	2.008	2.008	- EUR	144,400	289.955,20	3,07
MERCK	DE0006599905		STK	3.136	685	1.616 EUR	94,620	296.728,32	3,14
MÜNCH.RÜCK. VINK.NAM.	DE0008430026		STK	1.519	1.519	1.966 EUR	189,950	288.534,05	3,05
VONOVIA NAM.	DE000A1ML7J1		STK	7.246	8.969	10.798 EUR	40,420	292.883,32	3,10
VW VORZ.	DE0007664039		STK	2.006	2.006	- EUR	148,760	298.412,56	3,16
US-Dollar							5.952.861,73	62,99	
3M	US88579Y1010		STK	1.624	1.624	- USD	190,260	272.699,56	2,89
AMER.EXPR.	US0258161092		STK	3.192	3.192	4.028 USD	102,730	289.408,38	3,06
APPLE	US0378331005		STK	1.542	269	1.043 USD	218,860	297.852,80	3,15
BOEING	US0970231058		STK	896	896	1.092 USD	354,860	280.618,30	2,97
CISCO SYS.	US17275R1023		STK	7.127	7.127	8.713 USD	45,750	287.772,16	3,05
COCA-COLA	US1912161007		STK	7.109	7.109	10.422 USD	47,880	300.409,44	3,18
GOLDMAN S.GR.	US38141G1040		STK	1.519	1.519	- USD	225,370	302.137,62	3,20
JOHNSON&J.	US4781601046		STK	2.427	2.427	- USD	139,990	299.859,43	3,17
MCDONALD'S	US5801351017		STK	2.046	8.907	6.861 USD	176,900	319.436,39	3,38
MERCK & CO. (NEW)	US58933Y1055		STK	4.734	904	3.545 USD	73,610	307.550,19	3,25
MICROSOFT	US5949181045		STK	3.109	764	1.903 USD	106,810	293.078,23	3,10
PFIZER	US7170811035		STK	7.848	17.562	22.098 USD	43,060	298.252,40	3,16
PROCTER & GAMBLE	US7427181091		STK	3.972	3.972	- USD	88,680	310.875,04	3,29
TRAV.CO.	US89417E1091		STK	2.574	2.574	- USD	125,130	284.263,38	3,01
UNIT.TECHN.	US9130171096		STK	2.458	2.458	- USD	124,210	269.456,93	2,85
UNITEDHEALTH GR.	US91324P1021		STK	1.265	1.605	2.025 USD	261,350	291.785,67	3,09
VERIZON COMM.	US92343V1044		STK	6.079	6.079	7.900 USD	57,090	306.297,26	3,24
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	US9314271084		STK	4.747	4.747	- USD	79,770	334.202,54	3,54
WALMART	US9311421039		STK	3.461	3.461	- USD	100,280	306.314,00	3,24
WALT DISNEY	US2546871060		STK	2.966	2.966	- USD	114,830	300.592,01	3,18
Summe Wertpapiervermögen							8.814.543,81	93,27	
Derivate							349.212,23	3,70	
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte							474.067,59	5,02	
DAX FUTURE 12/18		EUREX	STK	-15				233.550,00	2,47
MINI DOW JONES INDEX 12/18		CBOT	STK	-37				240.517,59	2,55
Devisen-Derivate									
Devisenterminkontrakte							-124.855,36	-1,32	
USD/EUR 7.397.300,00		OTC						-124.855,36	-1,32

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.10.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								922.403,99	9,76
Bankguthaben								922.403,99	9,76
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	471.094,29		%	100,000	471.094,29	4,98
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	511.356,45		%	100,000	451.309,70	4,78
Sonstige Vermögensgegenstände								7.416,89	0,08
DIVIDENDENANSPRÜCHE			EUR	7.416,89				7.416,89	0,08
Sonstige Verbindlichkeiten								-643.034,81	-6,80
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-154.291,17				-154.291,17	-1,63
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-14.676,05				-14.676,05	-0,16
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-474.067,59				-474.067,59	-5,02
Fondsvermögen						EUR		9.450.542,11	100,00*)
Anteilwert						EUR		99,57	
Umlaufende Anteile						STK		94.910,00	

*) 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 31.10.2018 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.10.2018

US-Dollar	(USD)	1,13305 = 1 (EUR)
-----------	-------	-------------------

■ Marktschlüssel

b) Terminbörsen

CBOT	Chicago - Chicago Board of Trade (CBOT)
------	---

EUREX	Frankfurt/Zürich - Eurex (Eurex DE/Eurex Zürich)
-------	--

c) OTC	Over-the-Counter
--------	------------------

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

Aktien

Euro

BASF NAM.	DE000BASF111	STK	3.673	3.673
BAYER NAM.	DE000BAY0017	STK	-	3.348
BEIERSDORF	DE0005200000	STK	744	4.694
BMW	DE0005190003	STK	-	4.361
COVESTRO	DE0006062144	STK	3.657	3.657
DT.BÖRSE NAM.	DE0005810055	STK	-	2.990
DT.LUFTHANSA VINK.NAM.	DE0008232125	STK	12.330	12.330
E.ON NAM.	DE000ENAG999	STK	-	40.229
FRESENIUS	DE0005785604	STK	-	5.314
FRESENIUS MED.C.	DE0005785802	STK	14.747	14.747
HENKEL VORZ.	DE0006048432	STK	2.591	5.885
INFINEON TECHN. NAM.	DE0006231004	STK	13.731	13.731
LINDE UMT.	DE000A2E4L75	STK	2.183	2.183
RWE	DE0007037129	STK	12.799	31.211
SAP	DE0007164600	STK	784	4.578
SIEMENS NAM.	DE0007236101	STK	6.087	6.087
THYSSENKRUPP	DE0007500001	STK	22.029	38.710
WIRE CARD	DE0007472060	STK	1.612	1.612

US-Dollar

CATERPILLAR	US1491231015	STK	2.245	2.245
CHEVRON	US1667641005	STK	-	3.299
DOWDUPONT	US26078J1007	STK	8.439	8.439
EXXON MOB.	US30231G1022	STK	10.568	10.568
GEN.ELEC.	US3696041033	STK	28.000	28.000
HOME DEPOT	US4370761029	STK	2.228	2.228
IBM	US4592001014	STK	4.710	4.710
INTEL	US4581401001	STK	-	6.298
JPMORGAN	US46625H1005	STK	2.898	2.898
NIKE 'B'	US6541061031	STK	5.641	12.121
VISA 'A'	US92826C8394	STK	617	4.285

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Aktien

Euro

BAYER BEZ.R.	DE000BAY1BR7	STK	-	3.348
--------------	--------------	-----	---	-------

■ 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

Verkaufte Kontrakte	EUR	18.194
----------------------------	------------	---------------

Basiswerte: (DAX FUTURE 06/18, DAX FUTURE 09/18, MINI DOW JONES INDEX 06/18, MINI DOW JONES INDEX 09/18, MINI DOW JONES INDEX 12/18)

Devisenterminkontrakte (Verkauf)	EUR	5.962
---	------------	--------------

USD/EUR	EUR	5.962
---------	-----	-------

Devisenterminkontrakte (Kauf)	EUR	836
--------------------------------------	------------	------------

USD/EUR	EUR	836
---------	-----	-----

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	93,27 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	3,70 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	99,57
Umlaufende Anteile (STK)	94.910,00

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):	96,30 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	5,02 %
------------------------------------	--------

Devisentermingeschäfte:

- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	-1,32 %
------------------------------------	---------

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 31.12.2017)
 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: A141WK
 ISIN: DE000A141WK5

