

Jahresbericht

alpha beta Aktien Global Plus

zum 31. August 2018

Jahresbericht des alpha beta Aktien Global Plus

ZUM 31. AUGUST 2018

■ Tätigkeitsbericht	2
■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV	4
■ Vermögensaufstellung	5
■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze	6
■ Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	8
■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)	
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (I)	9
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (R)	9
■ Entwicklung der Anteilklasse	
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (I)	10
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (R)	10
■ Berechnung der Ausschüttung	
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (I)	11
– ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS (R)	11
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	12
■ Vermerk des Abschlussprüfers	16
■ Firmenspiegel	17

■ Tätigkeitsbericht

Sehr geehrte Anlegerin,
sehr geehrter Anleger,

hiermit legen wir Ihnen den Jahresbericht des Fonds alpha beta Aktien Global Plus für das Rumpfgeschäftsjahr vom 15. September 2017 bis zum 31. August 2018 vor.

Die Gesellschaft hat die alpha beta asset management GmbH, Frankfurt am Main, als Fondsmanager für den Fonds bestellt.

Der Fonds alpha beta Aktien Global Plus soll zu mindestens 51 Prozent seines Wertes in Kapitalbeteiligungen (Aktien und Aktienfonds) in- und ausländischer Aussteller investieren, ein regionaler Schwerpunkt ist nicht vorgesehen. Ziel der Anlagepolitik des Fondsmanagements dieses Sondervermögens ist es, risikoangemessene Wertzuwächse zu erzielen.

Die Mandatsstruktur zum Berichtsstichtag stellt sich wie folgt dar:

	Fondsvermögen	Anteile	Anteilwert
alpha beta Aktien Global Plus	16.603.527,33 EUR		
alpha beta Aktien Global Plus (I)	10.674.307,51 EUR	107.634,00	99,17 EUR
alpha beta Aktien Global Plus (R)	5.929.219,82 EUR	119.846,00	49,47 EUR

Zum Berichtsstichtag besteht folgende Asset Allocation:

	Tageswert EUR	Tageswert % FV
Fondsanteile	15.552.918,49	93,67 %
Derivate	14.320,00	0,09 %
Kasse / Forder. u. Verbindl.	1.036.288,84	6,24 %
Summe	16.603.527,33	100,00 %

Die größten Einzelpositionen im Portfolio (gemessen am Tageswert in Euro) sind zum Berichtsstichtag:

Bezeichnung	Tageswert % FV
ISHSV-S+P500 EUR HGD ACC	19,22%
XTR.STOXX EUROPE 600 1C	12,56%
AIS-AM.FL.RA.EO.C.1-3 AEO	10,22%
UBS-ETF-MSCI E.MA.S.R.ADL	6,09%
XTR.EURO STOXX 50 1D	5,88%

Der Fonds investiert in ein globales Aktienuniversum und setzt dieses regelmäßig mittels ETF um. Im (theoretischen) Ausgangszeitpunkt liegt die Investitionsquote der Strategie nahe 100%. Über jede individuelle Anlageklasse wird zu Stichtagen ein zweistufiger Risikomanagementprozess berechnet, der die Investition in die jeweilige, individuelle Anlageklasse entweder vollinvestiert belässt, diese halbiert oder sogar komplett eliminieren kann. Die Überprüfung dieser Allokation bzw. die Durchführung des Risikomanagements erfolgt grundsätzlich 14-tägig, wobei die Überwachung der Einhaltung von Risikoparametern des Fonds auch auf täglicher Basis erfolgt. Risikoreduzierungen können durch Derivate-Absicherungen oder durch den effektiven Verkauf von Aktien-ETF in Kasse oder geldmarktnahe Anlagen erfolgen.

Nach Fondsaufgabe am 15. September 2017 wurde die Investitionsquote zunächst sukzessive erhöht. So wurde z.B. die Quote mittels Investitionen in kanadische Aktien oder in US-Finanz- und Industriewerten gesteigert.

Hierzu werden je nach Einschätzung der Wirtschafts- und Kapitalmarktlage und der Börsenaussichten im Rahmen der Anlagepolitik die nach dem KAGB und den Anlagebedingungen zugelassenen Vermögensgegenstände erworben und veräußert. Zulässige Vermögensgegenstände sind Wertpapiere (z.B. Aktien, Anleihen, Genussscheine und Zertifikate), Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Investmentanteile, Derivate und sonstige Anlageinstrumente. Derivate dürfen zu Investitions- und Absicherungszwecken erworben werden.

Der Fonds ist an keine Benchmark gebunden. Je nach Marktlage kann er sowohl zyklisch als auch antizyklisch handeln.

Im 4. Quartal wurde die Position in US Technologiewerten erhöht. So war der Fonds ab Oktober bis zum Jahresende 2017 fast vollständig investiert.

Zu Beginn des Jahres 2018 wurde die hohe Investitionsquote zunächst beibehalten. Im Zuge der ab Anfang Februar erfolgenden, scharfen Marktkorrektur wurden vor allem europäische ETF-Positionen liquidiert, aber auch Branchen wie z.B. globale Basiskonsumgüter, europäische Nicht-Basiskonsumgüter, nachhaltige Energiewerte oder US-Small-Cap-Werte. Gegen März/April erreichte die Aktienquote ihr bisheriges Tief. Über die (Früh-)Sommermonate wurde die Aktienquote wieder erhöht. Generell hat die Seitwärtsentwicklung, insbesondere der europäischen Märkte, zu einem vorsichtigeren Vorgehen durch das Risikomanagement geführt. So wurden zahlreiche Aktienmarktpositionen durch Futures abgesichert oder sogar effektiv verkauft. Insbesondere chinesische Aktien und solche aus den Entwicklungsländern im Allgemeinen unterlagen einem Risikoabbau.

Stabil zeigten sich dabei die US-Märkte. So war der US-Aktienmarkt, abgebildet durch den S&P-500 auf währungsgesicherter Basis, während des gesamten Jahres zumindest hälftig allokiert. US Small-Cap-Werte waren seit April voll allokiert. Die einzige Anlageklasse, die in 2018 über den gesamten Zeitraum bis zum Berichtsstichtag voll allokiert war, ist ein ETF auf globale Automatisierungs- und Robotertechnik. Zum Berichtsstichtag lag die Aktienquote bei ca. 69 %.

Die geringe Volatilität erfüllt die Risikoerwartungen und -ziele des Fondsmanagements.

Der Anteilklasse I erzielte im Berichtszeitraum einen Wertverlust in Höhe von -0,58 %. Im gleichen Zeitraum erzielte die Anteilklasse R eine Performance von -0,84 %.

Die durchschnittliche Volatilität der Anteilklasse I lag im Berichtszeitraum bei 7,52 %. Die durchschnittliche Volatilität der Anteilklasse R lag im gleichen Zeitraum bei 7,52 %.

Im Berichtszeitraum wurde für die Anteilklasse I ein saldiertes Veräußerungsergebnis in Höhe von -322.487,63 Euro realisiert. Das Ver-

■ Tätigkeitsbericht

äußerungsergebnis ist im Wesentlichen auf die Veräußerungen von Investmentanteilen sowie Futures und Forwards zurückzuführen.

Im Berichtszeitraum wurde für die Anteilklasse R ein saldiertes Veräußerungsergebnis in Höhe von -179.044,20 Euro realisiert. Das Veräußerungsergebnis ist im Wesentlichen auf die Veräußerungen von Investmentanteilen sowie Futures und Forwards zurückzuführen.

Die Wertentwicklung des Fonds kann durch folgende Risiken und Unsicherheiten beeinträchtigt werden:

Risiken im Zusammenhang mit der Investition in Investmentanteile

Die Risiken der Anteile an anderen Investmentvermögen, die für den Fonds erworben werden (sogenannte „Zielfonds“), stehen in engem Zusammenhang mit den Risiken der in diesen Zielfonds enthaltenen Vermögensgegenstände bzw. der von diesen verfolgten Anlagestrategien. Da die Manager der einzelnen Zielfonds voneinander unabhängig handeln, kann es aber auch vorkommen, dass mehrere Zielfonds gleiche oder einander entgegengesetzte Anlagestrategien verfolgen. Hierdurch können bestehende Risiken kumulieren, und eventuelle Chancen können sich gegeneinander aufheben. Es ist der Gesellschaft im Regelfall nicht möglich, das Management der Zielfonds zu kontrollieren. Deren Anlageentscheidungen müssen nicht zwingend mit den Annahmen oder Erwartungen der Gesellschaft übereinstimmen. Der Gesellschaft wird die aktuelle Zusammensetzung der Zielfonds oftmals nicht zeitnah bekannt sein. Entspricht die Zusammensetzung nicht ihren Annahmen oder Erwartungen, so kann sie gegebenenfalls erst deutlich verzögert reagieren, indem sie Zielfondsanteile zurückgibt.

Offene Investmentvermögen, an denen der Fonds Anteile erwirbt, könnten zudem zeitweise die Rücknahme der Anteile aussetzen. Dann ist die Gesellschaft daran gehindert, die Anteile an dem Zielfonds zu veräußern, indem sie diese Auszahlung des Rücknahmepreises bei der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle des Zielfonds zurückgibt.

Risiken im Zusammenhang mit Derivatgeschäften

Die Gesellschaft darf für den Fonds Derivatgeschäfte abschließen. Der Kauf und Verkauf von Optionen sowie der Abschluss von Terminkontrakten oder Swaps sind mit folgenden Risiken verbunden:

- Kursänderungen des Basiswertes können den Wert eines Optionsrechts oder Terminkontraktes vermindern. Vermindert sich der Wert bis zur Wertlosigkeit, kann die Gesellschaft gezwungen sein, die erworbenen Rechte verfallen zu lassen. Durch Wertänderungen des einem Swap zugrunde liegenden Vermögenswertes kann der Fonds ebenfalls Verluste erleiden.
- Durch die Hebelwirkung von Optionen kann der Wert des Fondsvermögens stärker beeinflusst werden, als dies beim unmittelbaren Erwerb der Basiswerte der Fall ist. Das Verlustrisiko kann bei Abschluss des Geschäfts nicht bestimmbar sein.
- Ein liquider Sekundärmarkt für ein bestimmtes Instrument zu einem gegebenen Zeitpunkt kann fehlen. Eine Position in Derivaten kann dann unter Umständen nicht wirtschaftlich neutralisiert (geschlossen) werden.
- Der Kauf von Optionen birgt das Risiko, dass die Option nicht ausgeübt wird, weil sich die Preise der Basiswerte nicht wie erwartet entwickeln, so dass die vom Fonds gezahlte Optionsprämie verfällt. Beim Verkauf von Optionen besteht die Gefahr, dass der Fonds zur Abnahme von Vermögenswerten zu einem höheren als dem aktuellen Marktpreis, oder zur Lieferung von Vermögenswerten zu einem niedrigeren als dem aktuellen Marktpreis verpflichtet. Der Fonds erleidet dann einen Verlust in Höhe der Preisdifferenz minus der eingenommenen Optionsprämie.

- Bei Terminkontrakten besteht das Risiko, dass die Gesellschaft für Rechnung des Fonds verpflichtet ist, die Differenz zwischen dem bei Abschluss zugrunde gelegten Kurs und dem Marktkurs zum Zeitpunkt der Glattstellung bzw. Fälligkeit des Geschäftes zu tragen. Damit würde der Fonds Verluste erleiden. Das Risiko des Verlusts ist bei Abschluss des Terminkontrakts nicht bestimmbar.
- Der gegebenenfalls erforderliche Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) ist mit Kosten verbunden.
- Die von der Gesellschaft getroffenen Prognosen über die künftige Entwicklung von zugrunde liegenden Vermögensgegenständen, Zinssätzen, Kursen und Devisenmärkten können sich im Nachhinein als unrichtig erweisen.
- Die den Derivaten zugrunde liegenden Vermögensgegenstände können zu einem an sich günstigen Zeitpunkt nicht gekauft bzw. verkauft werden bzw. müssen zu einem ungünstigen Zeitpunkt gekauft oder verkauft werden.
- Durch die Verwendung von Derivaten können potenzielle Verluste entstehen, die unter Umständen nicht vorhersehbar sind und sogar die Einschusszahlungen überschreiten können. Bei außerbörslichen Geschäften, sogenannten over-the-counter (OTC)-Geschäften, können folgende Risiken auftreten:
- Es kann ein organisierter Markt fehlen, so dass die Gesellschaft die für Rechnung des Fonds am OTC-Markt erworbenen Finanzinstrumente schwer oder gar nicht veräußern kann.
- Der Abschluss eines Gegengeschäfts (Glattstellung) kann aufgrund der individuellen Vereinbarung schwierig, nicht möglich oder mit erheblichen Kosten verbunden sein.

Währungsrisiko

Sofern Vermögenswerte eines Fonds in anderen Währungen als der jeweiligen Fondswährung angelegt sind, erhält der Fonds die Erträge, Rückzahlungen und Erlöse aus solchen Anlagen in der jeweiligen Währung. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Fonds.

Eine Vermögensaufstellung über das Portfolio zum 31. August 2018 sowie eine Übersicht über während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen, finden Sie auf den Folgeseiten dieses Berichts.

Anmerkungen

Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI-Methode ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen oder Rücknahmeabschlägen.

WIR WEISEN DARAUF HIN, DASS DIE HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG DES FONDS KEINE PROGNOSE FÜR DIE ZUKUNFT ERMÖGLICHT.

Im Berichtszeitraum wurden keine Transaktionen für Rechnung des Fonds über Broker ausgeführt, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind.

■ Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	16.615.920,96	100,07
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	0,00	0,00
3. Derivate	-3.780,00	-0,02
Aktienindex-Derivate	-3.780,00	-0,02
4. Forderungen	24.740,00	0,15
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.042.042,47	6,28
7. Sonstige Vermögensgegenstände	15.552.918,49	93,67
Zielfondsanteile	15.552.918,49	93,67
Indexfonds	15.552.918,49	93,67
II. Verbindlichkeiten	-12.393,63	-0,07
Sonstige Verbindlichkeiten	-12.393,63	-0,07
III. Fondsvermögen	16.603.527,33	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 31.08.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Investmentanteile							15.552.918,49	93,67	
Gesellschaftsfremde Investmentanteile									
Euro							9.945.167,45	59,90	
AIS-A.FLOAT.RATE EO C.1-3 'A'	LU1681041114		ANT	16.800	4.000	6.900 EUR	101,010	1.696.968,00	10,22
ISHARES DAX	DE0005933931		ANT	3.190	3.190	- EUR	107,660	343.435,40	2,07
ISHARES V-S&P 500 EUR-HD.	IE00B3ZW0K18		ANT	49.000	49.000	- EUR	65,130	3.191.370,00	19,22
SSGA SEII-MSCI EUR.CON.S.DISC.	IE00BKWQ0C77		ANT	5.110	7.710	2.600 EUR	116,880	597.256,80	3,60
XTR.(IE) - S&P 500 '1C'	IE00BM67HW99		ANT	16.900	16.900	- EUR	44,446	751.137,40	4,52
XTRACKERS EURO STOXX 50 '1D'	LU0274211217		ANT	26.930	76.660	49.730 EUR	36,280	977.020,40	5,88
XTRACKERS FTSE MIB '1D'	LU0274212538		ANT	14.310	14.310	- EUR	21,115	302.155,65	1,82
XTRACKERS STOXX EUR.600 '1C'	LU0328475792		ANT	25.770	25.770	- EUR	80,940	2.085.823,80	12,56
US-Dollar							5.607.751,04	33,77	
AIS-AMUNDI F.RATE DL CORP. 'C'	LU1681040900		ANT	7.700	7.700	- USD	106,280	700.286,86	4,22
ISHARESIII-MSCI AUSTRALIEN	IE00B5377D42		ANT	15.240	70.660	55.420 USD	35,540	463.485,88	2,79
ISHARESIII-MSCI JP.SM.CAP.	IE00B2QWDY88		ANT	17.370	76.810	59.440 USD	42,081	625.493,70	3,77
ISHARESIII-S&P SM.CAP.600	IE00B2QWCY14		ANT	14.780	22.180	7.400 USD	72,815	920.941,80	5,55
ISHARESII-S&P GL CLEAN EN.	IE00B1XNHC34		ANT	39.440	237.280	197.840 USD	5,059	170.735,76	1,03
ISHARES VII-MSCI CANADA	IE00B52SF786		ANT	4.820	9.070	4.250 USD	130,600	538.671,92	3,24
ISHSIV-AUTOM.&ROBOT.U.	IE00BYZK4552		ANT	58.080	58.080	- USD	7,819	388.613,28	2,34
UBS-ETF-MSCI E.M.S.RES.U. 'A'	LU1048313891		ANT	89.620	225.190	135.570 USD	13,190	1.011.541,84	6,09
XTR.(IE)-MSCI WORLD C.ST. '1C'	IE00BM67HN09		ANT	27.600	69.360	41.760 USD	33,364	787.980,00	4,75
Summe Wertpapiervermögen							15.552.918,49	93,67	
Derivate							-3.780,00	-0,02	
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte							-3.780,00	-0,02	
EURO STOXX 50 IND.FUT. 09/18		EUREX	STK	-19				7.560,00	0,05
STXE 600 INDEX FUT.(50) 09/18		EUREX	STK	-54				-11.340,00	-0,07
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							1.042.042,47	6,28	
Bankguthaben							1.042.042,47	6,28	
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	1.037.325,12		%	100,000	1.037.325,12	6,25
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			USD	5.512,70		%	100,000	4.717,35	0,03
Sonstige Vermögensgegenstände							24.740,00	0,15	
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	6.640,00				6.640,00	0,04
GELEISTETE VARIATION MARGIN			EUR	18.100,00				18.100,00	0,11

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.08.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Sonstige Verbindlichkeiten								-12.393,63	-0,07
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-12.393,63				-12.393,63	-0,07
Fondsvermögen						EUR		16.603.527,33	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)	10.674.307,51
Anteilwert (EUR)	99,17
Umlaufende Anteile (STK)	107.634,00

alpha beta Aktien Global Plus (R)

ISIN	DE000A2DL379
Fondsvermögen (EUR)	5.929.219,82
Anteilwert (EUR)	49,47
Umlaufende Anteile (STK)	119.846,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 31.08.2018 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.08.2018

US-Dollar	(USD)	1,16860 = 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

AMUNDI ETF FR EUR.COR.1-3	FR0012005734	ANT	28.500	8.800
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

ISHARES-MSCI EM.MARK.	IE00B0M63177	ANT	67.890	67.890
ISHARES NASDAQ-100	DE000A0F5UF5	ANT	30.890	30.890
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
XTRACKERS HARVEST CSI300 '1D'	LU0875160326	ANT	138.550	138.550
XTRACKERS MSCI CHINA '1C'	LU0514695690	ANT	138.410	138.410

■ 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	9.963
----------------------------	------------	--------------

Basiswerte: (EURO STOXX 50 IND.FUT. 03/18, EURO STOXX 50 IND.FUT. 06/18, S&P 500 INDEX MINI FUT. 06/18, S&P 500 INDEX MINI FUT. 09/18, STXE 600 INDEX FUT.(50) 03/18, STXE 600 INDEX FUT.(50) 06/18)

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

alpha beta Aktien Global Plus (I)

	EUR insgesamt
Anteile im Umlauf	107.634,00
I. Erträge	
1. Dividenden inländischer Aussteller	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-2.882,65
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	245.706,95
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	0,00
9. Abzug ausländischer Quellensteuer	0,00
10. Sonstige Erträge	0,29
Summe der Erträge	242.824,59
II. Aufwendungen	
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00
2. Verwaltungsvergütung	-78.521,36
3. Verwahrstellenvergütung	-10.462,96
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-7.453,86
5. Sonstige Aufwendungen	-10.074,46
Summe der Aufwendungen	-106.512,64
III. Ordentlicher Nettoertrag	136.311,95
IV. Veräußerungsgeschäfte	
1. Realisierte Gewinne	387.359,84
2. Realisierte Verluste	-709.847,47
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-322.487,63
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-186.175,68
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	309.019,13
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-190.751,03
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	118.268,10
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-67.907,58

■ Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

alpha beta Aktien Global Plus (R)

	EUR insgesamt
Anteile im Umlauf	119.846,00
I. Erträge	
1. Dividenden inländischer Aussteller	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	0,00
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	0,00
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	-1.602,98
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	136.685,11
8. Erträge aus Wertpapier-Darlehen- und -Pensionsgeschäften	0,00
9. Abzug ausländischer Quellensteuer	0,00
10. Sonstige Erträge	0,16
Summe der Erträge	135.082,29
II. Aufwendungen	
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,00
2. Verwaltungsvergütung	-55.293,81
3. Verwahrstellenvergütung	-5.816,70
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	-7.096,83
5. Sonstige Aufwendungen	-6.600,32
Summe der Aufwendungen	-74.807,66
III. Ordentlicher Nettoertrag	60.274,63
IV. Veräußerungsgeschäfte	
1. Realisierte Gewinne	215.550,53
2. Realisierte Verluste	-394.594,73
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-179.044,20
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-118.769,57
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	158.931,17
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-99.582,67
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	59.348,50
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	-59.421,07

■ 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)	10.769.901,20
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	10.841.316,28
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-71.415,08
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	949,51
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-67.907,58
davon nicht realisierte Gewinne	309.019,13
davon nicht realisierte Verluste	-190.751,03
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	10.674.307,51

■ Vergleichende Übersicht mit den letzten Geschäftsjahren

Die Entwicklung der Anteilklasse im Jahresvergleich entfällt.

Die Anteilklasse wurde zum 15.09.2017 gebildet.

■ Entwicklung der Anteilklasse

alpha beta Aktien Global Plus (R)

	EUR insgesamt
I. Wert der Anteilklasse am Beginn des Geschäftsjahres	0,00
1. Ausschüttung für das Vorjahr	0,00
2. Zwischenausschüttungen	-13.140,18
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	6.014.220,74
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	6.136.451,37
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-122.230,63
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-12.439,67
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	-59.421,07
davon nicht realisierte Gewinne	158.931,17
davon nicht realisierte Verluste	-99.582,67
II. Wert der Anteilklasse am Ende des Geschäftsjahres	5.929.219,82

■ Vergleichende Übersicht mit den letzten Geschäftsjahren

Die Entwicklung der Anteilklasse im Jahresvergleich entfällt.

Die Anteilklasse wurde zum 15.09.2017 gebildet.

■ Berechnung der Ausschüttung

alpha beta Aktien Global Plus (I)

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	107.634,00	
I. Für die Ausschüttung verfügbar	136.146,82	1,26
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-186.175,68	-1,73
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	322.322,50	2,99
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	0,00	0,00
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung	136.146,82	1,26
1. Zwischenausschüttung	28.470,49	0,26
2. Endausschüttung	107.676,33	1,00

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Gesamtausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres und den Vortrag aus dem Vorjahr übersteigt.

■ Berechnung der Ausschüttung

alpha beta Aktien Global Plus (R)

	EUR insgesamt	EUR pro Anteil
Anteile im Umlauf	119.846,00	
I. Für die Ausschüttung verfügbar	61.192,38	0,51
1. Vortrag aus dem Vorjahr	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-118.769,57	-0,99
3. Zuführung aus dem Sondervermögen *)	179.961,95	1,50
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	0,00	0,00
1. Der Wiederanlage zugeführt	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung	61.192,38	0,51
1. Zwischenausschüttung	14.057,93	0,12
2. Endausschüttung	47.134,45	0,39

*) Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Gesamtausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres und den Vortrag aus dem Vorjahr übersteigt.

■ **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure **EUR** **1.691.470,00**

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen **93,67 %**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen **-0,02 %**

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.

Angaben nach dem qualifizierten Ansatz:

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko

kleinster potenzieller Risikobetrag	-1,97 %
größter potenzieller Risikobetrag	-9,08 %
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	-4,28 %

Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde

Die Risikomessung erfolgte im qualifizierten Ansatz durch die Berechnung des Value at Risk (VaR) über das Verfahren der historischen Simulation.

Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden

Das Value at Risk (VaR) wurde auf einer effektiven Historie von 500 Handelstagen mit einem Konfidenzniveau von 99% und einer unterstellten Haltedauer von 10 Werktagen berechnet.

Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte **0,98**

Die Angabe zum Leverage stellt einen Faktor dar.

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens

Index	Gewicht
MSCI World Index (EUR)	50,00 %
MSCI World Net Return Index (EUR Hedged)	50,00 %

Sonstige Angaben

alpha beta Aktien Global Plus (I)

ISIN	DE000A141WR0
Fondsvermögen (EUR)	10.674.307,51
Anteilwert (EUR)	99,17
Umlaufende Anteile (STK)	107.634,00
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)	5.929.219,82
Anteilwert (EUR)	49,47
Umlaufende Anteile (STK)	119.846,00
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 sind 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 sind 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 sind 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):	100,02 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:

- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-0,02 %
------------------------------------	---------

Devisentermingeschäfte:

- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %
------------------------------------	--------

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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 sowie zur Gesamtkostenquote

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen.

Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung in wesentlichem Umfang (mehr als 10 %).

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile:

Investmentanteile	Verwaltungsvergütung ¹⁾
AIS-A.FLOAT.RATE EO C.1-3 'A'	0,18000 % p.a.
AIS-Amundi F.RATE DL CORP. 'C'	0,07000 % p.a.
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 '1D'	0,01000 % p.a.
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 Rücknahmeabschläge gezahlt.

Transaktionskosten EUR **10.002,45**

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

alpha beta Aktien Global Plus (I)

Gesamtkostenquote (ohne Performancefee und Transaktionskosten) **1,34 %**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Bei der an dieser Stelle ausgewiesenen Gesamtkostenquote handelt es sich um eine auf der Basis eines Geschäftsjahres vorgenommene Kostenschätzung.

alpha beta Aktien Global Plus (R)

Gesamtkostenquote (ohne Performancefee und Transaktionskosten) **1,61 %**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

Bei der an dieser Stelle ausgewiesenen Gesamtkostenquote handelt es sich um eine auf der Basis eines Geschäftsjahres vorgenommene Kostenschätzung.

■ **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen sowie Zusammensetzung der Verwaltungsvergütung

alpha beta Aktien Global Plus (I)

Die Verwaltungsvergütung setzt sich wie folgt zusammen:		
Verwaltungsvergütung KVG	EUR	-78.521,36
Basisvergütung Asset Manager	EUR	0,00
Performanceabhängige Vergütung Asset Manager	EUR	0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen:

Gebühren für Übersetzung, WM/BaFin, Schnittstellen, Transaktionsregister und Anwaltskosten	EUR	-7.246,09
--	-----	-----------

alpha beta Aktien Global Plus (R)

Die Verwaltungsvergütung setzt sich wie folgt zusammen:		
Verwaltungsvergütung KVG	EUR	-55.293,81
Basisvergütung Asset Manager	EUR	0,00
Performanceabhängige Vergütung Asset Manager	EUR	0,00

Wesentliche sonstige Aufwendungen:

Gebühren für Übersetzung, WM/BaFin, Schnittstellen, Transaktionsregister und Anwaltskosten	EUR	-5.027,22
--	-----	-----------

Angaben zur Vergütung gemäß § 101 KAGB

Die nachfolgenden Informationen - insbesondere die Vergütung und deren Aufteilung sowie die Bestimmung der Anzahl der Mitarbeiter - basieren auf dem Jahresabschluss der Gesellschaft vom 31. Dezember 2017 betreffend das Geschäftsjahr 2017.

Die Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr 2017 gezahlten Vergütungen beträgt 3,16 Mio. EUR (nachfolgend „Gesamtsumme“) und verteilt sich auf 35 Mitarbeiter.

Hiervon entfallen 2,56 Mio. EUR auf feste und 0,60 Mio. EUR auf variable Vergütungen. Die Grundlage der ermittelten Vergütungen bildet der in der Gewinn- und Verlustrechnung niedergelegte Personalaufwand. Die Vergütungsangaben beinhalten dabei neben den an die Mitarbeiter ausgezahlten fixen und variablen Vergütungen individuell versteuerte Sachzuwendungen wie z.B. Dienstwagen. Aus dem Sondervermögen wurden keine direkten Beträge, auch nicht als Carried Interest, an Mitarbeiter gezahlt.

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Vergütung an Mitarbeiter (in Mio. EUR)		
	EUR	3,16
davon fix	EUR	2,56
davon variabel	EUR	0,60

Zahl der begünstigten Mitarbeiter inkl. Geschäftsführer: **35**

Summe der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2017 von der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (in Mio. EUR)

	EUR	2,64
davon an Geschäftsführer	EUR	0,88
davon an sonstige Führungskräfte	EUR	0,98
davon an Mitarbeiter mit Kontrollfunktion*	EUR	1,34
davon an übrige Risktaker	EUR	0,64

*Hinweis: Soweit zwischen Führungskräften und Mitarbeitern mit Kontrollfunktion Personenidentität besteht, werden die entsprechenden Vergütungen in beiden Positionen und damit doppelt ausgewiesen.

Summe der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2017 von der KVG gezahlten Vergütungen an Mitarbeiter in der gleichen Einkommensstufe wie Risktaker (in Mio. EUR): **0,41**

Die Vergütungen der Mitarbeiter folgen einer festgelegten Vergütungspolitik, deren Grundsätze als Zusammenfassung auf der Homepage der Gesellschaft veröffentlicht werden. Sie besteht aus einer festen Vergütung, die sich bei Tarifangestellten nach dem Tarifvertrag und bei außertariflichen Mitarbeitern nach dem jeweiligen Arbeitsvertrag richtet. Darüber hinaus ist für alle Mitarbeiter grundsätzlich eine variable Vergütung vorgesehen, die sich an dem Gesamtergebnis des Unternehmens und dem individuellen Leistungsbeitrag des einzelnen Mitarbeiters orientiert. Je nach Geschäftsergebnis bzw. individuellem Leistungsbeitrag kann die variable Vergütung jedoch auch komplett entfallen. Der Prozess zur Bestimmung der individuellen variablen Vergütung folgt einem einheitlich vorgegebenen Prozess in einer jährlich stattfindenden Beurteilung mit festen Beurteilungskriterien. Zusätzlich werden allen Mitarbeitern einheitlich Förderungen im Hinblick auf vermögenswirksame Leistungen, Altersvorsorge, Versicherungsschutz, Kantinennutzung, öffentlichen Nahverkehr etc. angeboten. Mitarbeiter ab einer bestimmten Karrierestufe haben zudem einen Anspruch auf Gestellung eines Dienstwagens gemäß der geltenden CarPolicy der Gesellschaft.

Die Vergütungspolitik wurde im Rahmen des jährlichen Reviews 2017 überprüft.

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben zur Vergütung im Auslagerungsfall

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen aus dem Fonds an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

Die Auslagerungsunternehmen haben folgende Informationen veröffentlicht:

alpha beta assetmanagement

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der Auslagerungsunternehmen gezahlten	
Mitarbeitervergütung (EUR)	294.000,00
davon feste Vergütung (EUR)	294.000,00
davon variable Vergütung (EUR)	0,00
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen (EUR)	0,00
Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens	4

Köln, den 10.12.2018

Monega
Kapitalanlagegesellschaft mbH

Die Geschäftsführung

■ Vermerk des Abschlussprüfers

An die Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Köln:

Die Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, hat uns beauftragt gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) den Jahresbericht des Sondervermögens alpha beta Aktien Global Plus für das Rumpfgeschäftsjahr vom 15. September 2017 bis 31. August 2018 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Jahresberichts nach den Vorschriften des KAGB liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Jahresbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach §102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Jahresbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Sondervermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Jahresbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben

beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Jahresbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Jahresbericht für das Rumpfgeschäftsjahr vom 15. September 2017 bis 31. August 2018 den gesetzlichen Vorschriften.

Düsseldorf, den 10. Dezember 2018

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Schobel
Wirtschaftsprüfer

Warnke
Wirtschaftsprüfer

■ 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
 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 2.265.300.000,00
 (Stand 31.12.2017)

Vertrieb

alpha beta asset management GmbH
 Bockenheimer Landstraße 2-4
 60306 Frankfurt am Main

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

