Halbjahresbericht

ARIAD Active Allocation

zum 31. Juli 2017

MONEGA

DAS ATTRAKTIVE FONDSKONZEPT

Halbjahresbericht des ARIAD Active Allocation

zum 31. Juli 2017

- **Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV** 2
- **Vermögensaufstellung** 3
- **Wertpapierkurse bzw. Marktsätze** 4
- **Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV** 6
- **Firmenspiegel** 7

Vermögensübersicht gem. § 9 KARBV

	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
I. Vermögensgegenstände	**23.301.729,68**	**105,31**
1. Aktien	**0,00**	**0,00**
2. Anleihen	**5.145.870,00**	**23,26**
Gebietskörperschaften	5.145.870,00	23,26
3. Derivate	**-247.100,00**	**-1,12**
Aktienindex-Derivate	-247.100,00	-1,12
4. Forderungen	**1.067.966,37**	**4,83**
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	**13.778.629,40**	**62,27**
6. Bankguthaben	**3.556.363,91**	**16,07**
7. Sonstige Vermögensgegenstände	**0,00**	**0,00**
II. Verbindlichkeiten	**-1.174.397,64**	**-5,31**
Sonstige Verbindlichkeiten	-1.174.397,64	-5,31
III. Fondsvermögen	**22.127.332,04**	**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 31.07.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere								**5.145.870,00**	**23,26**
Verzinsliche Wertpapiere									
Euro								**5.145.870,00**	**23,26**
0,0000 % NRW FRN LSA R.1324	DE000NRW0FT5		EUR	3.000.000	3.000.000	- %	102,485	3.074.550,00	13,89
0,1700 % BERLIN FRN LSA A.494	DE000A2AAPN5		EUR	2.000.000	2.000.000	- %	103,566	2.071.320,00	9,36
Summe Wertpapiervermögen								**5.145.870,00**	**23,26**
Derivate								**-247.100,00**	**-1,12**
Aktienindex-Derivate									
Aktienindex-Terminkontrakte								**33.000,00**	**0,15**
EURO STOXX 50 IND.FUT. 09/17		EUREX	STK	100		EUR	11,000	33.000,00	0,15
Optionsrechte								**-280.100,00**	**-1,27**
Optionsrechte auf Aktienindices									
CALL EURO STOXX 50 3500 08/17		EUREX	STK	-300		EUR	19,700	-59.100,00	-0,27
CALL EURO STOXX 50 3600 08/17		EUREX	STK	-300		EUR	1,500	-4.500,00	-0,02
CALL EURO STOXX 50 3800 12/17		EUREX	STK	-600		EUR	7,700	-46.200,00	-0,21
PUT EURO STOXX 50 3400 08/17		EUREX	STK	-325		EUR	15,000	-48.750,00	-0,22
PUT EURO STOXX 50 3400 09/17		EUREX	STK	-325		EUR	37,400	-121.550,00	-0,55
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								**17.334.993,31**	**78,34**
Bankguthaben								**17.334.993,31**	**78,34**
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle									
KREISSPARKASSE KÖLN			EUR	3.260.300,63		%	100,000	3.260.300,63	14,73
Vorzeitig kündbares Termingeld									
BAYERISCHE LANDESBANK			EUR	3.600.000,00		%	100,000	3.600.000,00	16,27
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL GENOSSENSCHAFTSBANK			EUR	3.500.000,00		%	100,000	3.500.000,00	15,82
HSH NORDBANK AG (MERGER OF HAMBURGISCHE LANDESBANK AND LANDESBANK SCHLESWIG-HOLSTEIN)			EUR	3.087.797,73		%	100,000	3.087.797,73	13,95
UNICREDIT BANK AG			EUR	3.590.831,67		%	100,000	3.590.831,67	16,23
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
KREISSPARKASSE KÖLN			JPY	38.400.888,00		%	100,000	296.063,28	1,34
Sonstige Vermögensgegenstände								**1.067.966,37**	**4,83**
ZINSANSPRÜCHE			EUR	-12.373,63				-12.373,63	-0,06
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	1.080.340,00				1.080.340,00	4,88
Sonstige Verbindlichkeiten								**-1.174.397,64**	**-5,31**
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-1.081.904,80				-1.081.904,80	-4,89
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-70.492,84				-70.492,84	-0,32

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 31.07.2017	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
ERHALTENE VARIATION MARGIN			EUR	-22.000,00				-22.000,00	-0,10
Fondsvermögen						**EUR**		**22.127.332,04**	**100,00*)**

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

ARIAD Active Allocation (I)	
ISIN	DE000A14N7U1
Fondsvermögen (EUR)	17.985.133,82
Anteilwert (EUR)	114,19
Umlaufende Anteile (STK)	157.505,00

ARIAD Active Allocation (R)	
ISIN	DE000A141WG3
Fondsvermögen (EUR)	4.142.198,22
Anteilwert (EUR)	51,64
Umlaufende Anteile (STK)	80.208,00

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:
Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 31.07.2017 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 31.07.2017		
Japanische Yen	(JPY)	129,70500 = 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

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**	**29.250**
Basiswerte: (PUT EURO STOXX 50 3000 04/17, PUT EURO STOXX 50 3000 05/17)		
Verkaufte Kaufoptionen (call)	**EUR**	**10.500**
Basiswerte: (CALL EURO STOXX 50 3500 07/17)		
Verkaufte Verkaufoptionen (put)	**EUR**	**64.025**
Basiswerte: (PUT EURO STOXX 50 3200 03/17, PUT EURO STOXX 50 3200 04/17, PUT EURO STOXX 50 3300 04/17, PUT EURO STOXX 50 3300 05/17, PUT EURO STOXX 50 3300 06/17, PUT EURO STOXX 50 3400 07/17)		

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	**23,26 %**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	**-1,12 %**

Sonstige Angaben

ARIAD Active Allocation (I)	
ISIN	DE000A14N7U1
Fondsvermögen (EUR)	17.985.133,82
Anteilwert (EUR)	114,19
Umlaufende Anteile (STK)	157.505,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 4,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,80%, derzeit 1,10%
Mindestanlagesumme (EUR)	250.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

ARIAD Active Allocation (R)	
ISIN	DE000A141WG3
Fondsvermögen (EUR)	4.142.198,22
Anteilwert (EUR)	51,64
Umlaufende Anteile (STK)	80.208,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 4,00%, derzeit 2,50%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 1,80%, derzeit 1,50%
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):	101,12 %
- Externe Modell-Bewertungen / Sonstige Bewertungen Dritter (§ 28 KARBV):	0,00 %
- Modell-Bewertungen (§ 28 KARBV):	0,00 %

Börsengehandelte Derivate:	
- Markt-/Börsenkurse (§ 27 KARBV):	-1,12 %

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 31.12.2016)
gegründet: 09.10.2000
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 Fünger
Christian Finke

Verwahrstelle

Kreissparkasse Köln
Neumarkt 18-24, 50667 Köln

modifiziert verfügbare haftende Eigenmittel:	EURO	2.062.400.000,00

(Stand 31.12.2015)

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

ARIAD Active Allocation (I)
WKN: A14N7U
ISIN: DE000A14N7U1

ARIAD Active Allocation (R)
WKN: A141WG
ISIN: DE000A141WG3