

Halbjahresbericht

Monega Dänische Covered Bonds SLD

zum 30. April 2022

Halbjahresbericht des Monega Dänische Covered Bonds SLD

ZUM 30. APRIL 2022

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	6
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	156.649.162,47	102,18
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	152.843.352,64	99,69
Gedekte Schuldverschreibungen	128.298.794,49	83,68
Regierungsanleihen	17.685.320,21	11,54
Agency	6.859.237,94	4,47
3. Derivate	32.203,77	0,02
Devisen-Derivate	32.203,77	0,02
4. Forderungen	222.050,93	0,14
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	3.551.555,13	2,32
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-3.335.426,21	-2,18
Sonstige Verbindlichkeiten	-3.335.426,21	-2,18
III. Fondsvermögen	153.313.736,26	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 30.04.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere								151.643.562,35	98,91	
Verzinsliche Wertpapiere										
Dänische Kronen								151.643.562,35	98,91	
0,2500 % DÄNEMARK V.18-22	DK0009923997		DKK	122.400.000	600.000	17.000.000	%	100,190	16.485.529,92	10,75
0,3750 % KOMMUNEKREDIT V.20-45	DK0008931538		DKK	20.000.000	-	-	%	74,123	1.992.875,09	1,30
0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006349568		DKK	44.718.903	-	792.195	%	79,513	4.779.983,55	3,12
0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006349642		DKK	34.900.000	-	-	%	78,435	3.679.869,74	2,40
0,5000 % KOMMUNEKREDIT V.19-39	DK0008931371		DKK	40.000.000	-	-	%	77,690	4.177.555,52	2,72
0,5000 % NYKREDIT REALKR. HYP-PFE 20-53	DK0009530917		DKK	34.995.522	-	3.381	%	76,900	3.617.728,15	2,36
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525081		DKK	4.616.412	-	84.982	%	79,060	490.635,00	0,32
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525321		DKK	13.969.402	-	3.152	%	78,803	1.479.840,54	0,97
0,5000 % REALKR.DANM. HYP-PFE S.27S	DK0004613262		DKK	29.020.292	-	60.157.170	%	78,354	3.056.751,04	1,99
0,5000 % REALKR.DANM. HYP-PFE V.19-50	DK0004613189		DKK	365.891	-	6.618	%	79,055	38.884,63	0,03
1,0000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006348750		DKK	45.917.503	-	56.807.376	%	80,868	4.991.741,47	3,26
1,0000 % JYSKE REALKR. HYP-PFE V.19-50	DK0009397739		DKK	49.462.648	-	143.675	%	81,465	5.416.834,17	3,53
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.19-50	DK0002044551		DKK	10.195.394	10.282.267	86.874	%	83,006	1.137.655,06	0,74
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.19-50	DK0002044718		DKK	35.415.103	-	17.012	%	81,270	3.869.152,90	2,52
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.20-53	DK0002047224		DKK	6.099.273	6.147.548	48.275	%	82,032	672.602,57	0,44
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.20-53	DK0002047307		DKK	5.850.937	-	30.000.514	%	79,917	628.581,71	0,41
1,0000 % NORDEA KRED.RK. HYP-PFE 20-53	DK0002049006		DKK	73.500.000	-	-	%	76,307	7.539.609,21	4,92
1,0000 % REALKR.DANM. HYP-PFE V.19-50	DK0004612454		DKK	13.438.304	-	44.886.493	%	83,460	1.507.717,39	0,98
1,0000 % REALKR.DANM. HYP-PFE 20-53	DK0004616794		DKK	15.349.779	8.437.435	20.017	%	76,324	1.574.926,74	1,03
1,5000 % DLR KR.	DK0006350731		DKK	40.099.627	20.000.000	373	%	83,999	4.528.053,67	2,95
1,5000 % DLR KRED. PFE V.21-53	DK0006352786		DKK	21.617.614	-	260.375	%	85,467	2.483.724,01	1,62
1,5000 % JYSKE REALKR. HYP- PFE 20-53	DK0009403644		DKK	14.354.774	-	145.226	%	85,644	1.652.686,30	1,08
1,5000 % JYSKE REALKR. HYP-PFE V.20-53	DK0009403727		DKK	3.981.371	-	13.116	%	84,182	450.556,23	0,29
1,5000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.17-50	DK0002040567		DKK	43.127.424	43.672.141	544.717	%	86,960	5.041.620,68	3,29
1,5000 % NORDEA KREDIT HYP-PFE V.21-53	DK0002050442		DKK	92.999.662	64.999.865	20.000.146	%	84,175	10.523.534,11	6,86
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50	DK0009513152		DKK	11.811.417	-	310.122	%	87,550	1.390.129,49	0,91
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53	DK0009528424		DKK	120.204.112	20.000.000	27.283.519	%	84,650	13.678.655,30	8,92
1,5000 % NYKREDIT REALKR.PFE. V.20-53	DK0009527616		DKK	28.966.957	15.800.000	42.685.157	%	86,100	3.352.765,21	2,19
1,5000 % REALKR.DANM. HYP-PFE V.17-50	DK0004608189		DKK	237.428	-	5.019	%	86,900	27.736,35	0,02
1,5000 % REALKR.DANM. HYP-PFE. V.21-53	DK0004619384		DKK	90.183.956	18.408.075	159.219	%	84,220	10.210.373,67	6,66

Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53	DK0004619467		DKK	21.860.952	22.000.000	139.048	%	86,000	2.527.345,64	1,65
2,0000 % KOMMUNEKREDIT V.03-24	DK0008923196		DKK	5.000.000	-	-	%	102,478	688.807,33	0,45
2,0000 % NORDEA KRED.RK. HYP.-PFE 21-53	DK0002050871		DKK	26.995.673	27.000.000	4.327	%	86,297	3.131.749,25	2,04
2,0000 % NORDEA KRED.RK. HYP.-PFE 21-53	DK0002051093		DKK	1.999.018	2.000.000	982	%	88,888	238.867,38	0,16
2,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53	DK0009528697		DKK	46.903.177	47.000.000	96.823	%	89,300	5.630.550,18	3,67
2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53	DK0004619624		DKK	17.974.050	-	16.834	%	86,301	2.085.253,70	1,36
2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53	DK0004620127		DKK	0	26.500.000	26.500.000	%	88,853	0,00	0,00
2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53	DK0004622099		DKK	26.800.000	26.800.000	-	%	90,062	3.244.692,15	2,12
2,5000 % DLR KRED. PFE V.22-53	DK0006354568		DKK	32.000.000	32.000.000	-	%	93,525	4.023.229,55	2,62
2,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53	DK0009535122		DKK	8.600.000	8.600.000	-	%	93,639	1.082.560,90	0,71
2,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE S.23S	DK0004622842		DKK	21.000.000	21.000.000	-	%	93,638	2.643.434,42	1,72
3,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.22-53	DK0002053891		DKK	2.000.000	2.000.000	-	%	96,790	260.230,14	0,17
3,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53	DK0009535478		DKK	43.000.000	43.000.000	-	%	97,025	5.608.532,29	3,66
Nicht notierte Wertpapiere								1.199.790,29	0,78	
Verzinsliche Wertpapiere										
Dänische Kronen								1.199.790,29	0,78	
0,0000 % DÄNEMARK V.22-31	DK0009924375		DKK	10.000.000	10.000.000	-	%	89,250	1.199.790,29	0,78
Summe Wertpapiervermögen								152.843.352,64	99,69	
Derivate								32.203,77	0,02	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte								32.203,77	0,02	
DKK/EUR 254.348.820,00			OTC					5.159,02	0,00	
DKK/EUR 26.034.400,00			OTC					523,08	0,00	
DKK/EUR 446.226.000,00			OTC					9.283,87	0,01	
DKK/EUR 598.697.900,00			OTC					17.237,80	0,01	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								3.551.555,13	2,32	
Bankguthaben								3.551.555,13	2,32	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	174.707,45			%	100,000	174.707,45	0,11
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			DKK	25.119.694,51			%	100,000	3.376.847,68	2,20
Sonstige Vermögensgegenstände								222.050,93	0,14	
ZINSANSPRÜCHE			EUR	222.050,92				222.050,92	0,14	
FORDERUNGEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	0,01				0,01	0,00	

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Sonstige Verbindlichkeiten								-3.335.426,21	-2,18
VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN			EUR	-3.309.085,21				-3.309.085,21	-2,16
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-26.341,00				-26.341,00	-0,02
Fondsvermögen						EUR		153.313.736,26	100,00^{*)}

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

Monega Dänische Covered Bonds SLD (I)

ISIN	DE000A2PF0F8
Fondsvermögen (EUR)	153.313.736,26
Anteilwert (EUR)	84,56
Umlaufende Anteile (STK)	1.813.092,00

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 29.04.2022 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 29.04.2022

Dänische Kronen	(DKK)	7,43880 = 1 (EUR)
-----------------	-------	-------------------

■ Marktschlüssel

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 Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
---------------------	------	------------------------------	----------------	-------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Verzinsliche Wertpapiere

Dänische Kronen

0,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50	DK0002046176	DKK		- 121.369.331
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE 20-53	DK0004616604	DKK		- 14.128.341
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009524431	DKK		- 15.128.745
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004612884	DKK		- 49.246.188
1,0000 % REALKR.DANM. HYP-PFE V.20-53	DK0004616018	DKK		- 7.358.133

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,69 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	0,02 %

Sonstige Angaben

Monega Dänische Covered Bonds SLD (I)

ISIN	DE000A2PF0F8
Fondsvermögen (EUR)	153.313.736,26
Anteilwert (EUR)	84,56
Umlaufende Anteile (STK)	1.813.092,00
Ausgabeaufschlag	bis zu 3,00%, derzeit 0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	bis zu 0,50%, derzeit 0,17%
Mindestanlagesumme (EUR)	500.000,00
Ertragsverwendung	Ausschüttung

Angaben zum Bewertungsverfahren gemäß §§ 26-31 und 34 KARBV

Das im Folgenden dargestellte Vorgehen bei der Bewertung der Vermögensgegenstände des Sondervermögens findet auch in Zeiten ggf. auftretender Marktverwerfungen i.Z.m. den Auswirkungen der Covid-19 Pandemie Anwendung. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Alle Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse oder einem anderem organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis bewertet, der aufgrund von fest definierten Kriterien als handelbar eingestuft werden kann und der eine verlässliche Bewertung sicherstellt (§§ 27, 34 KARBV).

Die verwendeten Preise sind Börsenpreise, Notierungen auf anerkannten Informationssystemen oder Kurse aus emittentenunabhängigen Bewertungssystemen (§§ 28, 34 KARBV). Anteile an Investmentvermögen werden mit ihrem zuletzt verfügbaren veröffentlichten Rücknahmekurs der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft bewertet.

Bankguthaben werden zum Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen, kündbare Festgelder zum Verkehrswert und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet (§§ 29, 34 KARBV). Die Bewertung erfolgt grundsätzlich zum letzten gehandelten Preis gemäß festgelegtem Bewertungszeitpunkt (Vortag oder gleichtäglich).

Vermögensgegenstände, die nicht zum Handel an einem organisierten Markt zugelassen sind oder für die keine handelbaren Kurse festgestellt werden können, werden mit Hilfe von anerkannten Bewertungsmodellen auf Basis beobachtbarer Marktdaten bewertet. Ist keine Bewertung auf Basis von Modellen möglich, erfolgt eine Bewertung durch andere geeignete Verfahren zur Preisfeststellung (§§ 28, 34 KARBV). Andere geeignete Verfahren kann die Verwendung eines von einem Dritten ermittelten Preises sein und unterliegt einer Plausibilitätsprüfung durch die KVG.

Optionen und Futures, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einem organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils verfügbaren handelbaren Kurs (Settlementpreis der jeweiligen Börse), der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

