

Halbjahresbericht

Monega Dänische Covered Bonds SLD

zum 30. April 2023

Halbjahresbericht des Monega Dänische Covered Bonds SLD

ZUM 30. APRIL 2023

| | |
|--|---|
| ■ Vermögensübersicht | 2 |
| ■ Vermögensaufstellung | 3 |
| ■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind | 7 |
| ■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV | 8 |

■ Vermögensübersicht

| | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 136.120.488,42 | 100,21 |
| 1. Aktien | 0,00 | 0,00 |
| 2. Anleihen | 135.050.643,16 | 99,42 |
| Gedekte Schuldverschreibungen | 112.978.577,08 | 83,17 |
| Regierungsanleihen | 16.418.305,74 | 12,09 |
| Agency | 5.653.760,34 | 4,16 |
| 3. Derivate | 323.630,91 | 0,24 |
| Devisen-Derivate | 323.630,91 | 0,24 |
| 4. Forderungen | 314.008,60 | 0,23 |
| 5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen | 0,00 | 0,00 |
| 6. Bankguthaben | 432.205,75 | 0,32 |
| 7. Sonstige Vermögensgegenstände | 0,00 | 0,00 |
| II. Verbindlichkeiten | -282.252,06 | -0,21 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | -282.252,06 | -0,21 |
| III. Fondsvermögen | 135.838.236,36 | 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 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens | |
|--|--------------|-------|------------------------------------|-----------------------|-------------------|---|------|-----------------------|------------------------------|-------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | 135.050.643,16 | 99,42 | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Dänische Kronen | | | | | | | | 135.050.643,16 | 99,42 | |
| 0,0000 % DÄNEMARK V.20-31 | DK0009924102 | | DKK | 55.000.000 | 55.000.000 | - | % | 80,620 | 5.949.097,06 | 4,38 |
| 0,0000 % DÄNEMARK V.22-31 | DK0009924375 | | DKK | 17.000.000 | - | - | % | 80,860 | 1.844.285,83 | 1,36 |
| 0,3750 % KOMMUNEKREDIT V.20-45 | DK0008931538 | | DKK | 20.000.000 | - | - | % | 57,213 | 1.535.210,42 | 1,13 |
| 0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-50 | DK0006349568 | | DKK | 19.293.837 | - | 2.380.386 | % | 70,144 | 1.815.744,35 | 1,34 |
| 0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-50 | DK0006349642 | | DKK | 29.900.000 | - | - | % | 66,775 | 2.678.740,57 | 1,97 |
| 0,5000 % KOMMUNEKREDIT V.19-39 | DK0008931371 | | DKK | 40.000.000 | - | - | % | 64,494 | 3.461.185,50 | 2,55 |
| 0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50 | DK0009525081 | | DKK | 0 | - | - | % | 69,474 | 0,00 | 0,00 |
| 0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50 | DK0009525321 | | DKK | 0 | - | - | % | 67,350 | 0,01 | 0,00 |
| 0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE S.27S | DK0004613262 | | DKK | 28.932.978 | - | 40.815 | % | 67,012 | 2.601.305,10 | 1,92 |
| 0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50 | DK0004613189 | | DKK | 0 | - | - | % | 69,093 | 0,01 | 0,00 |
| 1,0000 % DLR KRED. PFE V.19-50 | DK0006348750 | | DKK | 30.905.043 | - | 7.607 | % | 70,650 | 2.929.456,76 | 2,16 |
| 1,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.19-50 | DK0009397739 | | DKK | 39.274.058 | - | 76.010 | % | 68,917 | 3.631.430,30 | 2,67 |
| 1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50 | DK0002044718 | | DKK | 35.385.796 | - | 14.525 | % | 68,933 | 3.272.666,30 | 2,41 |
| 1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.20-53 | DK0002049006 | | DKK | 58.499.798 | - | 202 | % | 61,998 | 4.866.061,79 | 3,58 |
| 1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50 | DK0004612454 | | DKK | 12.978.890 | - | 229.425 | % | 73,400 | 1.278.142,20 | 0,94 |
| 1,5000 % DÄNEMARK V.11-23 | DK0009923054 | | DKK | 65.000.000 | - | 5.000.000 | % | 98,900 | 8.624.922,85 | 6,35 |
| 1,5000 % DLR KR. | DK0006350731 | | DKK | 40.083.010 | - | 9.849 | % | 73,525 | 3.954.038,87 | 2,91 |
| 1,5000 % DLR KRED. PFE V.21-53 | DK0006352786 | | DKK | 20.989.055 | - | 315.832 | % | 78,250 | 2.203.549,43 | 1,62 |
| 1,5000 % JYSKE REALKR. HYP.- PFE 20-53 | DK0009403644 | | DKK | 0 | - | - | % | 76,585 | 0,00 | 0,00 |
| 1,5000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.20-53 | DK0009403727 | | DKK | 3.964.092 | - | 6.314 | % | 72,131 | 383.628,80 | 0,28 |
| 1,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.17-50 | DK0002040567 | | DKK | 41.711.350 | - | 715.942 | % | 77,806 | 4.354.245,46 | 3,21 |
| 1,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.21-53 | DK0002050442 | | DKK | 96.987.596 | - | 8.091 | % | 72,133 | 9.386.328,74 | 6,91 |
| 1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50 | DK0009513152 | | DKK | 11.427.195 | - | 191.538 | % | 78,167 | 1.198.418,88 | 0,88 |
| 1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53 | DK0009528424 | | DKK | 150.572.052 | - | 296.872 | % | 72,562 | 14.658.825,77 | 10,79 |
| 1,5000 % NYKREDIT REALKR.PFE. V.20-53 | DK0009527616 | | DKK | 3.349.451 | - | 50.722 | % | 76,916 | 345.649,52 | 0,25 |
| 1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.17-50 | DK0004608189 | | DKK | 229.774 | - | 3.822 | % | 77,711 | 23.956,82 | 0,02 |
| 1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE. V.21-53 | DK0004619384 | | DKK | 43.939.135 | - | 81.451 | % | 72,092 | 4.249.953,18 | 3,13 |
| 2,0000 % KOMMUNEKREDIT V.03-24 | DK0008923196 | | DKK | 5.000.000 | - | - | % | 97,992 | 657.364,42 | 0,48 |
| 2,0000 % NORDEA KR. HYP.-PFE 17-50 IOH | DK0002039049 | | DKK | 8.971.404 | - | 12.159 | % | 80,257 | 966.026,25 | 0,71 |
| 2,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.21-53 | DK0002050871 | | DKK | 26.995.673 | - | - | % | 76,057 | 2.754.729,30 | 2,03 |

■ Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens | |
|--|--------------|-------|------------------------------|--------------------|------------------------------------|-------------------|------|-----------------|----------------------|------|
| 2,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.21-53 | DK0002051093 | | DKK | 1.998.875 | - | 143 | % | 79,210 | 212.427,68 | 0,16 |
| 2,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50 | DK0009515876 | | DKK | 4.476.714 | - | 9.994 | % | 80,860 | 485.667,10 | 0,36 |
| 2,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.20-53 | DK0009528697 | | DKK | 46.556.652 | - | 154.689 | % | 79,558 | 4.969.482,57 | 3,66 |
| 2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53 | DK0004619624 | | DKK | 17.924.173 | - | 23.950 | % | 76,074 | 1.829.451,69 | 1,35 |
| 2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.21-53 | DK0004620127 | | DKK | 0 | - | - | % | 79,579 | 0,00 | 0,00 |
| 2,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004622099 | | DKK | 6.763.512 | - | 86.667 | % | 82,052 | 744.572,57 | 0,55 |
| 2,5000 % DLR KRED. PFE V.22-53 | DK0006354568 | | DKK | 31.219.674 | - | 385.053 | % | 86,275 | 3.613.756,69 | 2,66 |
| 2,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53 | DK0009535122 | | DKK | 8.382.766 | - | 111.225 | % | 85,798 | 964.956,02 | 0,71 |
| 2,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE S.23S | DK0004622842 | | DKK | 15.537.042 | - | 198.829 | % | 85,585 | 1.784.068,69 | 1,31 |
| 3,0000 % JYSKE REALKR. PFE V.22-43 | DK0009408874 | | DKK | 8.729.155 | - | 177.727 | % | 91,867 | 1.075.913,38 | 0,79 |
| 3,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.22-53 | DK0002053891 | | DKK | 1.967.355 | - | 22.514 | % | 89,302 | 235.716,20 | 0,17 |
| 3,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE S.01E SDO | DK0009537177 | | DKK | 11.640.504 | - | 257.439 | % | 92,500 | 1.444.638,12 | 1,06 |
| 3,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53 | DK0009535478 | | DKK | 37.165.657 | - | 5.426.420 | % | 89,608 | 4.468.191,15 | 3,29 |
| 3,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004622925 | | DKK | 29.549.588 | - | 354.543 | % | 89,327 | 3.541.438,85 | 2,61 |
| 4,0000 % DLR KRED. PFE V.22-53 | DK0006355961 | | DKK | 12.345.278 | - | 115.762 | % | 95,204 | 1.576.890,92 | 1,16 |
| 4,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.22-53 | DK0009409252 | | DKK | 6.918.888 | - | 63.156 | % | 95,352 | 885.139,38 | 0,65 |
| 4,0000 % NYKREDIT REALKR. HYP.-PFE V.22-53 | DK0009537680 | | DKK | 10.987.315 | - | 9.029 | % | 94,500 | 1.393.057,22 | 1,03 |
| 4,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004623659 | | DKK | 20.176.053 | - | 178.913 | % | 95,800 | 2.593.267,32 | 1,91 |
| 4,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004623733 | | DKK | 33.918.920 | 10.000.000 | 61.354 | % | 94,260 | 4.289.582,47 | 3,16 |
| 5,0000 % DLR KRED. FRN PFE V.22-53 | DK0006356696 | | DKK | 4.978.102 | - | 21.898 | % | 99,198 | 662.540,25 | 0,49 |
| 5,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.22-53 | DK0002056050 | | DKK | 14.988.836 | - | 11.164 | % | 98,751 | 1.985.889,02 | 1,46 |
| 5,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53 | DK0009539116 | | DKK | 17.887.242 | - | 112.758 | % | 99,487 | 2.387.565,53 | 1,76 |
| 5,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53 | DK0009539389 | | DKK | 1.995.220 | 2.000.000 | 4.780 | % | 98,860 | 264.640,94 | 0,19 |
| 5,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004623816 | | DKK | 16.387.370 | - | 112.630 | % | 99,400 | 2.185.451,76 | 1,61 |
| 5,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.22-53 | DK0004624038 | | DKK | 5.987.173 | 6.000.000 | 12.827 | % | 99,125 | 796.252,14 | 0,59 |
| 6,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.22-56 | DK0009410425 | | DKK | 3.793.696 | - | 206.304 | % | 100,876 | 513.447,34 | 0,38 |
| 6,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.22-53 | DK0009540122 | | DKK | 3.837.321 | - | 162.679 | % | 101,327 | 521.673,67 | 0,38 |

■ Vermögensaufstellung

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. | Bestand 30.04.2023 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|------|-------|------------------------------------|-----------------------|--|----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | 135.050.643,16 | 99,42 |
| Derivate | | | | | | | | 323.630,91 | 0,24 |
| Devisen-Derivate | | | | | | | | | |
| Devisenterminkontrakte | | | | | | | | 323.630,91 | 0,24 |
| DKK/EUR 254.150.460,00 | | OTC | | | | | | 49.911,03 | 0,04 |
| DKK/EUR 297.212.000,00 | | OTC | | | | | | 61.633,05 | 0,05 |
| DKK/EUR 445.470.000,00 | | OTC | | | | | | 212.086,83 | 0,16 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | 432.205,75 | 0,32 |
| Bankguthaben | | | | | | | | 432.205,75 | 0,32 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | | | | | | | | |
| DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F | | | EUR | 260.000,00 | | | % 100,000 | 260.000,00 | 0,19 |
| DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F | | | EUR | 81.019,17 | | | % 100,000 | 81.019,17 | 0,06 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F | | | DKK | 679.650,06 | | | % 100,000 | 91.186,58 | 0,07 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | 314.008,60 | 0,23 |
| ZINSANSPRÜCHE | | | EUR | 314.008,60 | | | | 314.008,60 | 0,23 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | -282.252,06 | -0,21 |
| VERBINDLICHKEITEN AUS SCHWEBENDEN GESCHÄFTEN | | | EUR | -353,30 | | | | -353,30 | 0,00 |
| KOSTENABGRENZUNGEN | | | EUR | -21.898,76 | | | | -21.898,76 | -0,02 |
| VERBINDLICHKEITEN AUS CASH COLLATERAL | | | EUR | -260.000,00 | | | | -260.000,00 | -0,19 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 135.838.236,36 | 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) | 135.838.236,36 |
| Anteilwert (EUR) | 75,44 |
| Umlaufende Anteile (STK) | 1.800.669,00 |

■ Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse bzw. Marktsätze per 28.04.2023 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 28.04.2023

| | | |
|-----------------|-------|-------------------|
| Dänische Kronen | (DKK) | 7,45340 = 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

| | | | | |
|---------------------------------------|-----|--------------|--|--|
| 0,2500 % DÄNEMARKDK0009923997 V.18-22 | DKK | - 45.400.000 | | |
|---------------------------------------|-----|--------------|--|--|

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

| | |
|---|----------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen | 99,42 % |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen | 0,24 % |

Sonstige Angaben

Monega Dänische Covered Bonds SLD (I)

| | |
|-----------------------------|-----------------------------|
| ISIN | DE000A2PF0F8 |
| Fondsvermögen (EUR) | 135.838.236,36 |
| Anteilwert (EUR) | 75,44 |
| Umlaufende Anteile (STK) | 1.800.669,00 |
| 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.

