

Halbjahresbericht

Monega Dänische Covered Bonds SLD

zum 30. April 2020

Halbjahresbericht des Monega Dänische Covered Bonds SLD

ZUM 30. APRIL 2020

■ Vermögensübersicht	2
■ Vermögensaufstellung	3
■ Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind	5
■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	6

■ Vermögensübersicht

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände	193.403.362,97	100,02
1. Aktien	0,00	0,00
2. Anleihen	192.157.646,15	99,37
Gedekte Schuldverschreibungen	163.583.254,61	84,60
Regierungsanleihen	25.893.588,21	13,39
Agency	2.680.803,33	1,39
3. Derivate	-144.337,19	-0,07
Devisen-Derivate	-144.337,19	-0,07
4. Forderungen	161.703,28	0,08
5. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	0,00	0,00
6. Bankguthaben	1.228.350,73	0,64
7. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00	0,00
II. Verbindlichkeiten	-32.877,38	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten	-32.877,38	-0,02
III. Fondsvermögen	193.370.485,59	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 30.04.2020	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere								192.157.646,15	99,37	
Verzinsliche Wertpapiere										
Dänische Kronen								192.157.646,15	99,37	
0,2500 % DÄNEMARK V.18-22	DK0009923997		DKK	48.000.000	50.000.000	2.000.000	%	102,030	6.565.196,99	3,40
0,3750 % KOMMUNEKREDIT V.20-45	DK0008931538		DKK	20.000.000	20.000.000	-	%	99,990	2.680.803,33	1,39
0,5000 % DÄNEMARK V.19-29	DK0009923807		DKK	134.000.000	284.000.000	150.000.000	%	107,600	19.328.391,22	10,00
0,5000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006349568		DKK	16.891.015	17.000.000	108.985	%	94,695	2.144.180,91	1,11
0,5000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50	DK0002046176		DKK	222.475.067	224.000.000	1.524.933	%	94,794	28.270.978,01	14,62
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525081		DKK	29.139.017	160.280.194	131.141.177	%	94,779	3.702.249,33	1,91
0,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009525321		DKK	81.999.891	82.000.000	109	%	94,069	10.340.426,25	5,35
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE S.27S	DK0004613262		DKK	169.913.638	170.000.000	86.362	%	94,069	21.426.607,00	11,08
0,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004613189		DKK	129.060.494	130.000.000	939.506	%	94,745	16.391.860,98	8,48
1,0000 % DLR KRED. PFE V.19-50	DK0006348750		DKK	52.979.608	53.000.000	20.392	%	97,179	6.901.759,18	3,57
1,0000 % JYSKE REALKR. HYP.-PFE V.19-50	DK0009397739		DKK	152.766.665	164.955.798	12.189.133	%	97,600	19.987.434,47	10,34
1,0000 % NORDEA KREDIT HYP.-PFE V.19-50	DK0002044718		DKK	116.969.838	165.000.000	48.030.162	%	97,585	15.301.555,94	7,91
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50	DK0009524431		DKK	144.848.649	239.978.522	95.129.874	%	97,450	18.922.343,83	9,79
1,0000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.19-50	DK0004612884		DKK	29.426.267	227.000.000	197.573.733	%	97,497	3.845.962,68	1,99
1,5000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.17-50	DK0009513152		DKK	100.000.000	100.000.000	-	%	101,626	13.623.336,06	7,05
1,5000 % REALKR.DANM. HYP.-PFE V.17-50	DK0004608189		DKK	20.000.000	20.000.000	-	%	101,622	2.724.559,97	1,41
Summe Wertpapiervermögen								192.157.646,15	99,37	
Derivate								-144.337,19	-0,07	
Devisen-Derivate										
Devisenterminkontrakte								-144.337,19	-0,07	
DKK/EUR 373.120.000,00		OTC						-27.396,22	-0,01	
DKK/EUR 384.685.130,00		OTC						-28.405,18	-0,01	
DKK/EUR 563.120.945,60		OTC						-88.535,79	-0,05	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								1.228.350,73	0,64	
Bankguthaben								1.228.350,73	0,64	
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			EUR	137.451,58			%	100,000	137.451,58	0,07
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen										
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK, F			DKK	8.137.780,42			%	100,000	1.090.899,15	0,56
Sonstige Vermögensgegenstände								161.703,28	0,08	
ZINSANSPRÜCHE			EUR	161.703,28				161.703,28	0,08	

■ Vermögensaufstellung

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.	Bestand 30.04.2020	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Sonstige Verbindlichkeiten								-32.877,38	-0,02
KOSTENABGRENZUNGEN			EUR	-32.877,38				-32.877,38	-0,02
Fondsvermögen						EUR		193.370.485,59	100,00^{*)}

Anteilwert	EUR	99,69
Umlaufende Anteile	STK	1.939.694,00

^{*)} 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 30.04.2020 oder letztbekannte.

Devisenkurs(e) bzw. Konversionsfaktor(en) (in Mengennotiz) per 30.04.2020

Dänische Kronen	(DKK)	7,45970 = 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 % DÄNEMARK DK0009923567 V.16-27	DKK	55.000.000	55.000.000	
1,0000 % NYKREDIT REALKR. PFE V.19-50 DK0009522815	DKK	30.000.000	30.000.000	

■ **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

Devisenterminkontrakte (Verkauf)	EUR	173.500
DKK/EUR	EUR	173.500

■ Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen	99,37 %
Bestand der Derivate am Fondsvermögen	-0,07 %

Sonstige Angaben

Anteilwert (EUR)	99,69
Umlaufende Anteile (STK)	1.939.694,00

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 gleichartig).

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.

